

ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

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

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし)

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書 (全体版)

第2期

(決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日~2018年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ」は、
このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先 (コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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

<4667>

<2768>

<2769>

<4668>

<2770>

<2771>

<4669>

<2772>

<2773>

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年11月30日）

（作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30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。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）
組入制限	ベビーファンドの マザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの 株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの 株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			T O P I X		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2017年11月30日)	円 11,827	円 0	% 18.3	1,792.08	% 16.2	% 98.7	% 1.3	百万円 1,308
2 期末(2018年11月30日)	11,209	0	△ 5.2	1,667.45	△ 7.0	98.7	1.3	2,014

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

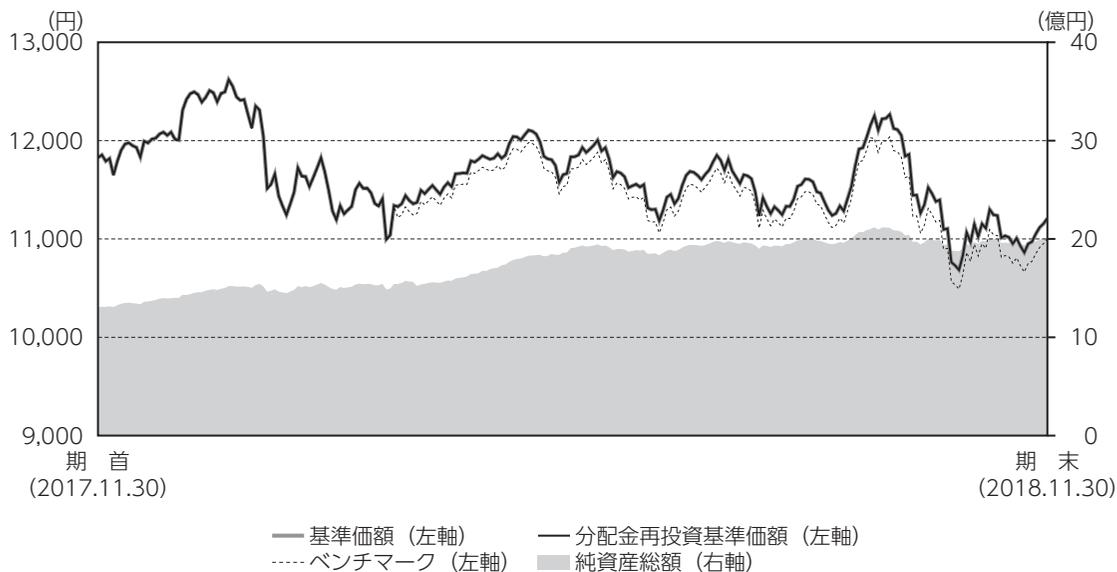
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

*ベンチマークはTOP I Xです。

■基準価額・騰落率

期首：11,827円

期末：11,209円（分配金0円）

騰落率：△5.2%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（TOP 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。

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2017年11月30日	円	%		%	%	%
	11,827	—	1,792.08	—	98.7	1.3
12月末	12,005	1.5	1,817.56	1.4	98.8	1.1
2018年 1 月末	12,129	2.6	1,836.71	2.5	99.0	1.0
2 月末	11,681	△1.2	1,768.24	△1.3	98.9	1.0
3 月末	11,441	△3.3	1,716.30	△4.2	98.0	2.0
4 月末	11,847	0.2	1,777.23	△0.8	98.5	1.5
5 月末	11,653	△1.5	1,747.45	△2.5	98.3	1.7
6 月末	11,553	△2.3	1,730.89	△3.4	99.4	0.6
7 月末	11,700	△1.1	1,753.29	△2.2	99.3	0.7
8 月末	11,580	△2.1	1,735.35	△3.2	98.7	1.3
9 月末	12,221	3.3	1,817.25	1.4	98.7	1.3
10月末	11,065	△6.4	1,646.12	△8.1	98.4	1.6
(期末) 2018年11月30日	11,209	△5.2	1,667.45	△7.0	98.7	1.3

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みません。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、堅調な国内企業業績や米国税制改革法案の議会審議の進展および同法の成立が好感され、上昇しました。しかし、2018年2月に米国長期金利が急上昇したこと、また3月に米国が新たな関税を課す方針を示し貿易摩擦激化への懸念が高まったことにより、株価は下落しました。4月以降は、米国の保護主義的な政策への警戒感が強まる一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったこと、また通商問題でも一部で妥協を探る動きなどがあり、株価は横ばい圏で推移しました。9月半ばからは、米中貿易摩擦でいったん悪材料出尽くしとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、株価は上昇しました。10月には、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。しかし11月に入ると、株価急落からの反発や米中首脳会談において米中貿易摩擦に何らかの進展が見られるとの期待が高まり、株価は上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

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

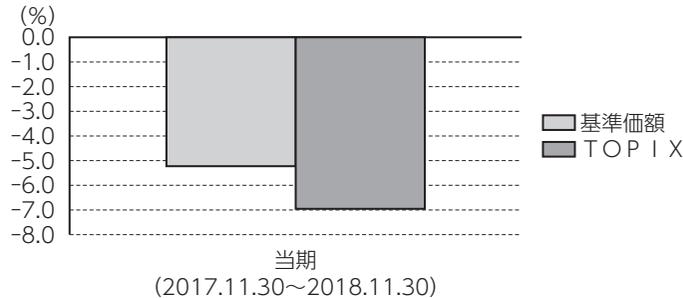
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△7.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.2%となりました。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、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（1万口当たり）

項 目	当 期 2017年12月1日 ～2018年11月30日	
	当期分配金（税込み）	（円）
対基準価額比率	（%）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,245

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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ってまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2017.12.1~2018.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	26円	0.227%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,645円です。
(投 信 会 社)	(18)	(0.151)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	27	0.234	

(注1) 当作成期中の費用（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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30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	842,466	931,895	112,513	124,613

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年12月1日から2018年11月30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	23,181,999千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	142,686,202千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.16

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成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当作成期中の利害関係人との取引状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 16,362	百万円 1,033	% 6.3	百万円 6,819	百万円 1,283	% 18.8
株式先物取引	22,127	-	-	21,957	-	-
コール・ローン	2,058,308	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.2%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年12月1日から2018年11月30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 24	百万円 16	百万円 297

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2017年12月1日から2018年11月30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 16

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	19千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B)÷(A)	2.6%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成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	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	1,175,567	1,905,520	2,014,707

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,014,707	99.8
コール・ローン等、その他	3,939	0.2
投資信託財産総額	2,018,646	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,018,646,379円
コール・ローン等	3,939,110
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	2,014,707,269
(B) 負債	3,811,337
未払解約金	1,531,637
未払信託報酬	2,226,746
その他未払費用	52,954
(C) 純資産総額(A - B)	2,014,835,042
元本	1,797,553,299
次期繰越損益金	217,281,743
(D) 受益権総口数	1,797,553,299口
1万口当り基準価額(C / D)	11,209円

* 期首における元本額は1,106,392,276円、当作成期間中における追加設定元本額は1,072,657,156円、同解約元本額は381,496,133円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,209円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,124円
受取利息	210
支払利息	△ 2,334
(B) 有価証券売買損益	△ 96,694,882
売買益	10,132,736
売買損	△106,827,618
(C) 信託報酬等	△ 4,056,805
(D) 当期損益金(A + B + C)	△100,753,811
(E) 前期繰越損益金	106,343,428
(F) 追加信託差損益金	211,692,126
(配当等相当額)	(117,542,288)
(売買損益相当額)	(94,149,838)
(G) 合計(D + E + F)	217,281,743
次期繰越損益金(G)	217,281,743
追加信託差損益金	211,692,126
(配当等相当額)	(117,542,288)
(売買損益相当額)	(94,149,838)
分配準備積立金	106,343,778
繰越損益金	△100,754,161

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示していません。

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	117,542,288
(d) 分配準備積立金	106,343,778
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	223,886,066
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	223,886,066
(h) 受益権総口数	1,797,553,299口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン TOP I Xインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2018年9月19日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年11月30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11～21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

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

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	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	
		千株	千円	円			千株	千円	円			千株	千円	円	
トヨタ自動車		54.2	379,353	6,999	トヨタ自動車		60.8	400,748	6,591						
日本郵政		172.6	225,018	1,303	ソフトバンクグループ		19.7	172,528	8,757						
シャープ		59.3	218,828	3,690	ブリヂストン		27.2	123,455	4,538						
ソニー		37.2	213,403	5,736	三井住友フィナンシャルG		25.2	110,247	4,374						
三菱UFJフィナンシャルG		313.7	210,657	671	本田技研		33.6	106,279	3,163						
ソフトバンクグループ		18.9	167,062	8,839	アステラス製薬		54.6	94,659	1,733						
キーエンス		2.6	157,456	60,560	日本たばこ産業		30.4	93,885	3,088						
武田薬品		33.5	156,734	4,678	リクルートホールディングス		31.5	92,807	2,946						
日本電信電話		29.3	144,704	4,938	ファーストリテイリング		1.9	89,517	47,114						
本田技研		40.3	137,868	3,421	日本電信電話		17.9	85,724	4,789						

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年11月30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（134,890,694千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	柄	2018年11月30日現在		銘柄	柄	2018年11月30日現在		銘柄	柄	2018年11月30日現在		銘柄	柄	2018年11月30日現在	
		株数	評価額			株数	評価額			株数	評価額			株数	評価額
水産・農林業 (0.1%)		千株	千円			千株	千円			千株	千円			千株	千円
極洋		2.6	8,385	日本アクア		2	780	銭高組		0.8	4,400	矢作建設		9.1	6,952
日本水産		81.1	55,634	ファーストコーポレーション		2.3	2,451	鹿島建設		156.4	245,704	ピーエス三菱		7	4,977
マルハニチロ		11.7	48,028	ベステラ		1.5	2,347	不動テトラ		5	9,760	日本ハウスHLDGS		12.6	6,350
カネコ種苗		2.2	3,161	スペースバリューHD		9.8	10,250	大未建設		2.3	2,737	大東建託		23.9	354,437
サカタのタネ		9.9	38,560	ダイセキ環境ソリューション		1.5	1,297	鉄建建設		4	12,080	新日本建設		8.2	9,922
ホクト		6.7	13,527	第一カーター興業		0.9	1,926	西松建設		14.4	37,699	NIPPO		17.7	34,249
ホクリヨウ		1	752	安藤・間		51.5	35,329	三井住友建設		48	33,840	東亜道路		1.2	3,900
鉱業 (0.3%)				東急建設		23.6	27,022	大豊建設		4.6	17,365	前田道路		21.1	47,053
住石ホールディングス		16.4	1,886	コムシスホールディングス		28.7	84,091	前田建設		47.6	56,739	日本道路		1.8	11,106
日鉄鉱業		1.8	10,008	ミサワホーム		6.8	5,650	佐田建設		4	1,732	東亜建設		5.8	9,140
三井松島HLDGS		3.3	5,319	ビーアールホールディングス		6.5	2,580	ナカノフドー建設		4.9	3,062	若築建設		3.4	5,858
国際石油開発帝石		324.5	391,022	高松コンストラクションGP		5.1	14,784	興村組		11	41,635	東洋建設		24.2	10,236
石油資源開発		11.6	27,306	東建コーポレーション		2.5	19,450	東鉄工業		8	26,720	五洋建設		79.3	56,778
K&Oエナジーグループ		3.9	6,380	ソネック		0.8	622	イチケン		1.2	2,598	世紀東急		9.4	6,335
建設業 (3.0%)				ヤマウラ		3	2,706	富士ピー・エス		2	1,034	福田組		2.2	11,902
ヒノキヤグループ		1.7	3,592	大成建設		66.5	331,835	浅沼組		2.4	8,340	住友林業		47.3	79,227
ショーボンドHD		6.3	54,810	大林組		200.3	226,739	戸田建設		77.8	59,439	日本基礎技術		6.6	2,283
ミライト・ホールディングス		20.5	34,112	清水建設		204.4	198,268	熊谷組		9.6	34,512	巴コーポレーション		8.3	3,743
タマホーム		5.2	5,777	飛島建設		5.6	8,736	青木あすなろ建設		3.6	3,700	大和ハウス		185.1	661,732
サンヨーホームズ		1.4	1,225	長谷工コーポレーション		83.7	115,003	北野建設		1.4	5,705	ライト工業		12.9	19,930
				松井建設		7.3	6,226	植木組		0.8	1,962	積水ハウス		205.2	351,097

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30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
日特建設	5.6	3,920	カルビー	27.2	102,272	ユーグレナ	24.5	17,101	トーモク	3.5	6,597
北陸電気工事	3.1	3,100	森永乳業	11.9	39,567	ミヨシ油脂	2.8	3,578	ザ・パック	4.4	14,212
ユアテック	10.7	10,015	六甲バター	4.3	10,246	理研ビタミン	2.8	10,836	化学 (7.3%)		
四電工	1	2,738	ヤクルト	44.3	378,765	繊維製品 (0.7%)			クラレ	98.3	173,401
中電工	8.6	21,706	明治ホールディングス	42.4	378,632	片倉工業	7.2	8,769	旭化成	415.3	516,217
関電工	30.5	35,929	雪印メグミルク	14.4	45,504	グンゼ	4.2	18,711	共和レザー	3.4	3,019
きんでん	44.6	87,683	プリマハム	8.3	17,894	東洋紡	24.7	40,582	昭和電工	38.8	176,540
東京エネシス	6.7	6,465	日本ハム	25.8	108,618	ユニチカ	17	9,316	住友化学	459	282,744
トーエネック	1.9	5,966	林兼産業	1.8	1,209	富士紡ホールディングス	3	3,330	住友精化	2.9	13,978
住友電設	4.6	9,563	丸大食品	6.3	12,732	倉敷紡績	5.5	15,950	日産化学	35.9	221,144
日本電設工業	11.5	28,543	S Foods	5.3	25,996	シキボウ	3.2	3,724	ラサ工業	2.1	3,492
協和エクシオ	26.1	74,646	伊藤ハム米久HLDGS	38.1	28,765	日本毛織	19.7	18,104	クレハ	5.4	42,930
新日本空調	5.7	11,759	サッポロホールディングス	21.9	56,611	ダイト紙ボウ	12.7	1,282	多木化学	0.9	8,703
九電工	13.2	58,278	アサヒグループホールディングス	125.3	595,676	トーア紡コーポレーション	2.6	1,414	テイカ	4.8	9,792
三機工業	15.1	18,437	キリンHD	270.9	721,948	グایدローリミテッド	6.9	2,525	石原産業	11.2	13,966
日揮	57.5	95,335	宝ホールディングス	45	65,115	帝国繊維	6.6	16,196	片倉コープアグリ	2.2	2,633
中外炉工業	1.9	4,689	オノンホールディングス	16.8	6,484	帝人	47.4	92,904	日東エフシー	4.6	3,597
ヤマト	5.9	3,752	養命酒	1.9	4,603	東レ	453.2	403,483	日本曹達	9.2	24,913
太平電業	4.4	12,276	コカ・コーラボトラーズHD	45.9	149,175	サカイ オーベックス	1.4	3,453	東ソー	90	144,000
高砂熱学	16.9	34,425	サントリー食品インター	40	190,400	住江織物	1.6	4,368	トクヤマ	16.8	52,248
三晃金属	0.8	2,408	グایدローグループHD	3.4	21,012	日本フェルト	2.9	1,392	セントラル硝子	12.7	35,534
朝日工業社	1.4	4,662	伊藤園	19.9	103,679	イチカワ	0.8	1,206	東亞合成	36.6	45,457
明星工業	1.2	10,140	キーコーヒー	5.9	12,679	日東製網	0.6	907	大阪ソーダ	6.4	17,004
大氣社	9.1	29,029	ユニカフェ	1.8	2,282	アツギ	4.8	5,140	関東電化	13.9	13,121
ダイダイン	4.4	11,233	ジャパンフーズ	0.8	986	ダイニック	2.2	1,775	デンカ	22.9	83,814
日比谷総合設備	6.3	12,133	日清オイリオグループ	7.7	27,104	セーレン	14.4	27,331	信越化学	102.9	1,042,891
東芝プラントシステム	14.5	36,003	不二製油グループ	14.6	52,998	ソト	2.2	2,173	日本カーバイド	2	3,874
OSJB HD	29	9,802	かどや製油	0.6	3,504	東海染工	0.7	786	堺化学	3.9	10,834
東洋エンジニア	7.7	6,729	J-オイルミルズ	3.1	12,555	小松マテリアル	9.6	8,688	第一元素化学工業	4.8	5,020
千代田化工建	47.6	15,327	キューコマ	39.5	261,490	ワコールホールディングス	17	52,615	エア・ウォーター	47.5	87,257
新興プランテック	12.1	13,963	味の素	135.5	265,918	ホグメディカル	7.2	24,660	大陽日酸	48.2	92,158
食料品 (4.4%)			キューピー	33.3	91,774	クラウン	16.3	1,907	日本化学工業	2	5,496
日本製粉	19.7	38,158	ハウス食品G本社	22.9	92,172	クラウディアHLDGS	1.4	693	東邦アセチレン	1	1,436
日清製粉G本社	67.7	161,464	カゴメ	23.9	79,228	T S Iホールディングス	21.4	16,114	日本バーカライジング	31.7	47,137
日東富士製粉	0.4	2,248	焼津水産化工	2.9	3,166	マツオカコーポレーション	1.8	5,841	高圧ガス	9.6	8,515
昭和産業	5.4	15,319	アリアケジャパン	5.5	53,955	ワールド	6	11,850	チタン工業	0.8	2,056
鳥越製粉	5.3	5,024	ピエトロ	0.7	1,150	三陽商会	3.6	7,394	四国化成	9.9	12,335
中部飼料	7.2	10,116	エバラ食品工業	1.4	3,119	ナイガイ	2	990	戸田工業	1.3	3,191
フィード・ワン	39.5	8,295	ニチレイ	31.1	99,675	オンワードホールディングス	35.6	24,101	ステラ ケミファ	3.4	10,931
東洋精糖	0.9	1,055	東洋水産	30.7	119,423	ルックホールディングス	2.1	2,459	保土谷化学	2	5,178
日本甜菜糖	3.4	6,687	イートアンド	2	3,542	ゴールドウイン	5.3	62,381	日本触媒	9.8	74,186
三井製糖	4.7	14,194	大冷	0.7	1,277	デサント	14.3	31,788	大日精化	4.9	16,268
塩水港精糖	6.5	1,631	ヨシムラ・フード・HLDGS	1.6	1,073	キング	3	1,500	カナカ	15.5	65,875
日新製糖	2.9	6,916	日清食品HD	25.4	186,182	ヤマトインターナショナル	3.7	1,690	三菱瓦斯化学	59.7	111,280
森永製菓	15	74,850	永谷園ホールディングス	3.1	8,639	パルプ・紙 (0.3%)			三井化学	52.8	152,116
中村屋	1.6	7,224	一正蒲鉾	2.3	2,520	特種東海製紙	3.7	17,112	J S R	58.3	105,931
江崎グリコ	18	99,540	フジック	6.4	15,961	王子ホールディングス	263	174,632	東京応化工業	10	36,150
名糖産業	2.9	4,277	ロックフィールド	6.4	10,796	日本製紙	28	59,080	大阪有機化学	5.4	7,533
井村屋グループ	2.6	8,099	日本たばこ産業	345.6	975,801	三菱製紙	9.4	5,508	三菱ケミカルHLDGS	389.2	361,411
不二家	3.2	8,044	ケンコーマヨネーズ	3.3	7,590	北越コーポレーション	38.5	22,137	K Hネオケム	8.9	27,100
山崎製パン	49	116,767	わらべや日洋HD	3.9	7,632	中越パルプ	2.6	4,157	ダイセル	90.4	114,808
第一屋製パン	1.1	1,258	なとり	3.3	6,187	巴川製紙	1.9	2,166	住友ベークライト	10	41,200
モロゾフ	1	5,470	イフジ産業	1	713	大王製紙	28.5	39,729	積水化学	127.5	234,855
亀田製菓	3.7	19,832	ピックルスコーポレーション	1.4	3,158	阿波製紙	1.5	882	日本ゼオン	52.6	60,700
寿スプリッツ	6.3	30,555	北の達人コーポ	23.5	12,337	レンゴ	60.4	58,165	アイカ工業	17.5	66,937

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30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	
宇部興産	29.3	75,799	ポーラ・オルビスHD	25.4	81,407	久光製薬	17.6	127,600	住友大阪セメント	12	61,200
積水樹脂	9.7	21,689	ノビアホールディングス	3.8	20,102	持田製薬	4.5	46,395	太平洋セメント	37.7	144,768
タキロンシーアイ	12.6	8,051	アジュパ/コスメジャパン	1.3	1,335	参天製薬	112.9	219,364	日本ヒューム	5.9	5,664
旭有機材	4	7,404	エステル	4.2	9,164	扶桑薬品	2.1	5,968	日本コンクリート	12.7	3,911
日立化成	26.8	48,132	アプロカネショウ	2.4	5,923	日本ケミファ	0.8	3,308	三谷セキサン	2.8	7,954
ニチパン	3	6,786	コニシ	10.6	19,853	ツムラ	18.4	64,676	アジアパイルHD	8.3	5,760
リケンテクノス	16.3	8,345	長谷川香料	7.2	11,289	日医工	14.5	25,288	東海カーボン	54.1	85,261
大倉工業	2.9	6,243	星光PMC	4.3	3,938	キッセイ薬品工業	10.5	36,855	日本カーボン	2.8	15,176
積水化成成品	8.7	9,404	小林製薬	16.7	131,930	生化学工業	11.5	17,940	東洋炭素	3.5	9,579
群栄化学	1.7	5,355	荒川化学工業	5.4	8,807	栄研化学	10.4	27,092	ノリタケ	3.6	20,268
タイガース ポリマー	2.8	1,932	メック	4.1	5,494	日水製薬	2.5	3,045	TOYO	45.9	201,730
ミライアル	1.6	1,555	日本高純度化学	2	4,774	鳥居薬品	3.2	8,416	日本碍子	72.5	122,017
ダイキアクシス	2	2,362	タカラバイオ	15.6	44,272	JCRファーマ	4.2	24,402	日本特殊陶業	50.4	117,532
ダイキョーニシカワ	12.2	14,005	JCU	7.7	14,229	東和薬品	2.8	23,632	ダントーホールディングス	5.6	711
竹本容器	1	2,783	新田ゼラチン	3.7	2,763	富士製薬工業	4	7,692	MA RUWA	2	12,840
森六ホールディングス	3.2	9,648	OATアグリオ	0.8	1,791	沢井製薬	12.1	72,600	品川フラクトリーズ	1.6	6,888
日本化薬	37	55,315	デクセルアルズ	15.4	15,261	ゼリア新薬工業	11.7	24,616	黒崎播磨	1.2	8,100
カーリットホールディングス	6.3	5,808	アース製薬	4.5	25,155	第一三共	170.7	711,306	ヨータイ	5.1	3,498
日本精化	4.9	5,429	北興化学	6.5	3,627	キョーリン製薬HD	15.1	41,192	イソライト	3	1,641
扶桑化学工業	5.9	14,006	大成ラミック	1.9	5,871	大幸薬品	2.7	5,427	東京薬業	7.5	3,495
トリケミカル	1.3	5,837	クミアイ化学	24.6	17,859	ダイト	3.4	11,628	ニッカトール	2.7	2,913
ADEKA	28.6	51,451	日本農薬	14.6	8,146	大塚ホールディングス	113.7	629,329	フジミンコーポレートッド	5.3	12,910
日油	22.5	84,375	アキレス	4.2	9,475	大正製薬HD	13.4	175,808	クニミネ工業	2	1,966
新日本理化	11.3	2,135	有沢製作所	9.3	7,635	ペプチドリーム	27.4	127,410	エーアンドエーマテリアル	1.1	1,257
ハリマ化成グループ	5	5,840	日東電工	45	279,135	石油・石炭製品 (0.8%)			ニチアス	16.3	35,908
花王	144.8	1,210,238	レック	6.4	13,171	日本コークス工業	49.4	5,236	ニチハ	8.3	25,771
三光工業製薬	2.2	6,056	三光合成	4.6	1,794	昭和セイル石油	55.4	97,448	鉄鋼 (1.0%)		
石原ケミカル	1.6	3,419	きもと	10	2,190	ニチレキ	7.5	8,580	新日鐵住金	263.9	547,856
日華化学	2.1	2,576	藤森工業	5.3	17,172	ユシロ化学	3	4,068	神戸製鋼所	108.1	100,965
ニイタカ	0.9	1,563	前澤化成工業	4	4,536	ピービー・カストロール	2.1	3,160	中山製鋼所	7.7	4,504
三洋化成	4	22,480	ウェーブロックHLDGS	1.4	1,226	富士石油	14.1	4,794	合同製鐵	2.8	5,448
有機合成薬品	6.7	1,668	ジェイ エス ピー	3.5	8,463	MORESCO	2.4	3,993	JFEホールディングス	159.2	318,638
大日本塗料	7	7,847	エフピコ	4.9	33,957	出光興産	46.2	190,806	日新製鋼	14.4	21,096
日本ペイントHOLD	48.2	194,005	天馬	4.1	8,556	JXTGホールディングス	1,008.3	691,996	東京製鐵	31.5	30,807
関西ペイント	65.6	139,531	信越ポリマー	10.6	8,798	コスモエネルギーHLDGS	17.2	45,562	共英製鋼	6.7	14,740
神東塗料	7.9	1,453	東リ	14.6	4,336	ゴム製品 (0.8%)			大和工業	12.5	37,100
中国塗料	19.2	20,006	ニフコ	23.9	69,190	横浜ゴム	34.6	82,209	東京鐵鋼	2.3	3,153
日本特殊塗料	4.3	7,619	バルカー	4.8	13,214	東洋ゴム	30.6	54,865	大阪製鐵	4	8,004
藤倉化成	8.7	5,515	ユニ・チャーム	126.5	449,581	ブリヂストン	183.4	843,640	淀川製鋼所	7.9	19,189
太陽ホールディングス	4.9	17,909	医薬品 (5.2%)			住友ゴム	53.6	81,311	丸一鋼管	20.9	70,433
DI C	26.4	95,172	協和発酵キリン	74.6	173,594	藤倉ゴム	4.9	2,508	モリ工業	1.7	4,617
サカタインクス	12.8	17,318	武田薬品	235.4	1,001,627	オカモト	4.2	25,074	大同特殊鋼	9.6	44,112
東洋インキSCホールディン	12.5	35,087	アステラス製薬	549.8	959,126	フコク	2.5	2,327	日本高周波	2	1,372
T&K TOKA	5	6,025	大日本住友製薬	44.3	163,910	ニッタ	6.7	26,197	日本冶金工	48.7	13,733
富士フィルムHLDGS	123.9	558,789	塩野義製薬	78	585,624	住友理工	11.7	13,010	山陽特殊製鋼	7.4	19,092
資生堂	118.6	856,766	田辺三菱製薬	62	108,066	三ツ星ベルト	7.8	19,195	愛知製鋼	3.3	13,183
ライオン	83	185,837	わかもと製薬	7.1	2,115	バンドー化学	11.4	14,056	日立金属	63.6	81,280
高砂香料	4.1	15,949	あすか製薬	7.2	8,856	ガラス・土石製品 (0.9%)			日本金属	1.4	1,955
マンダム	13.4	44,622	日本新薬	15.6	121,056	日東紡績	8.8	19,131	大平洋金属	4	13,280
ミルボン	7.4	36,408	ピオフェルミン製薬	1	2,758	AGC	59.7	230,143	新日本電工	35	9,380
ファンケル	26.6	78,789	中外製薬	62.2	483,294	日本板硝子	28.3	27,394	栗本鉄工所	2.9	4,770
コーセー	10.1	170,993	科研製薬	10.7	62,167	石塚硝子	0.8	1,719	虹技	0.7	1,120
コタ	2.8	4,384	エーザイ	71.4	743,631	日本山村硝子	2.3	4,098	日本鑄鉄管	0.5	637
シーズ・ホールディングス	7.4	43,364	ロート製薬	30.6	109,701	日本電気硝子	25.8	78,690	三菱製鋼	4.3	8,724
シーボン	0.7	1,898	小野薬品	140.7	386,291	オハラ	2.4	5,733	日亜鋼業	8.4	2,830

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30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
日本精線	0.8	2,808	三洋工業	0.7	1,432	ナプテスコ	32.5	102,050	油研工業	1	2,045
エンビプロHD	1.2	698	岡部	11.8	11,682	三井海洋開発	6.3	17,797	タダノ	28.8	39,196
シンニッタン	9.1	3,758	ジークト	6.4	10,182	レオン自動車	5.8	10,567	フジテック	21.7	30,249
新家工業	1.3	2,375	中国工業	0.9	535	SMC	17.5	673,400	CKD	16.5	18,826
非鉄金属 (0.8%)			東プレ	10.9	25,200	新川	4.4	2,257	キトー	4.5	8,419
大紀アルミニウム	9.6	6,249	高周波熱線	11.3	11,571	ソルコム	2	10,340	平和	16.7	40,380
日本軽金属HD	159.7	40,563	東京製綱	3.6	4,150	ユニオンツール	2.6	9,438	理想科学工業	5.2	10,077
三井金属	15.9	41,228	サンコール	3.2	2,310	オイレス工業	8.3	16,575	SANKYO	15.1	68,554
東邦亜鉛	3.2	12,256	モリテックスチル	4.5	2,142	日精エーエスピー	1.7	6,910	日本金銭機械	6.5	7,332
三菱マテリアル	39	124,215	パイオラックス	9.5	26,410	サトーホールディングス	7.1	21,264	マースグループHLDGS	3.7	8,672
住友鉱山	80.8	267,044	エイチワン	5.8	6,380	技研製作所	4.1	16,974	福島工業	3.8	16,625
DOWAホールディングス	13.8	51,612	日本発条	58.7	59,287	日本エアテック	1.8	1,243	オーイズミ	2.8	1,453
古河機金	9.7	13,958	中央発條	0.6	2,082	カワタ	1.2	2,107	ダイコク電機	2.7	4,592
エス・サイエンス	26.4	1,821	アドバネクス	0.7	1,111	日精樹脂工業	4.8	4,900	竹内製作所	9.9	22,621
大阪チタニウム	6.9	14,621	立川ブランド	2.6	3,164	オカダアイオン	2	3,436	アマノ	17	41,616
東邦チタニウム	10.6	14,787	三益半導体	4.5	6,952	ワイエシホールディングス	2.3	1,699	JUKI	8.3	12,574
UACJ	8.9	21,155	機械 (5.1%)			小松製作所	270.1	819,213	サンデンホールディングス	7.2	6,336
CKサンエツ	1.1	3,036	日本ドライケミカル	1.5	1,977	住友重機械	34.1	128,386	蛇の目マシン	5.3	3,005
古河電工	17	56,355	日本製鋼所	17.9	37,124	日立建機	23.9	74,926	マックス	9.1	13,577
住友電工	220.5	351,146	三浦工業	25.6	77,440	日工	1.6	4,008	グローリー	16.4	47,084
フジクラ	70.7	34,855	タクマ	21.6	34,452	巴工業	2.4	5,678	新晃工業	5.7	9,405
昭和電線HLDGS	6.8	4,739	ツガミ	13.1	11,161	井関農機	5.9	10,897	大和冷機工業	9.1	11,957
東京特殊電線	0.7	1,372	オーコム	7.5	42,375	TOWA	5	3,705	セガサミーホールディングス	59.2	94,838
タツタ電線	11.6	6,229	東芝機械	6.6	13,094	丸山製作所	1.2	1,965	日本ピストンリング	2.1	4,380
カナレ電気	1	2,028	アマダホールディングス	91.3	112,481	北川鉄工所	2.6	6,689	リケン	2.8	15,848
平河ヒューテック	2.4	3,177	アイダエンジニア	16.2	14,725	ローツエ	2.6	4,833	T P R	8	21,592
リョービ	7.2	22,284	滝澤鉄工所	1.7	2,745	ツバキ	2	1,334	ツバキ・ナカシマ	8.9	17,203
アーレステイ	7.2	5,256	F U J I	17.6	26,276	クボタ	320.1	620,033	ホシザキ	17.4	153,294
アサヒHD	11	25,861	牧野フライス	6.9	31,774	荏原実業	1.6	3,208	大豊工業	4.8	5,352
金属製品 (0.6%)			オーエスジー	29	66,091	三菱化工機	1.9	3,288	日本精工	122.3	130,494
稲葉製作所	3.2	4,342	ダイジェット	0.6	1,116	月島機械	11.8	15,694	NTN	128.1	48,806
宮地エンジニアリングG	1.8	3,866	旭ダイヤモンド	15.3	10,740	帝国電機製作所	4.2	6,955	ジェイテクト	57.2	82,596
トーカロ	15	14,850	DMG森精機	37.2	59,148	東京機械	2.4	1,058	不二越	5.5	26,675
アルファCO	2	2,790	ソディック	12.8	10,726	新東工業	14.1	13,818	日本トムソン	17.6	11,052
SUMCO	65.2	113,448	ディスコ	8	132,400	渋谷工業	5.3	21,915	THK	37	96,237
川田テクノロジーズ	1.3	11,089	日東工具	3.3	8,283	アイチ コーポレーション	10	6,570	ユーシン精工	4.7	5,517
RS TECHNOLOGIES	1.2	6,048	日進工業	1.7	4,506	小森コーポレーション	16.4	20,532	前澤給装工業	2.3	4,445
東洋製鐵グループHD	37.8	97,713	パンチ工業	4.1	2,550	鶴見製作所	4.7	9,343	イーブル工業	7.2	10,720
ホッカンホールディングス	2.9	4,979	富士ダイス	2.5	1,962	住友精密	0.9	3,163	前澤工業	4.2	1,621
コロナ	3.2	3,651	豊和工業	3.2	2,764	酒井重工業	1.1	2,963	日本ピラー工業	6	9,228
横河ブリッジHLDGS	10.9	20,274	OKK	2.3	2,090	荏原製作所	26.4	77,721	キッツ	24.2	23,522
駒井ハルテック	1.1	2,394	石川製作所	1.4	2,097	石井鉄工所	1.1	2,072	マキタ	72.6	323,433
高田機工	0.5	1,375	東洋機械金属	4.2	2,536	西島製作所	5.9	6,147	日立造船	46.7	18,213
三和ホールディングス	60.9	83,920	津田工業	1.2	2,659	北越工業	6.1	7,698	三菱重工業	99.8	430,836
文化シャッター	17.2	13,484	エンシュウ	1.5	1,984	ダイキン工業	81.2	1,023,932	I H I	45.8	158,239
三協立山	8.2	10,799	島精機製作所	8.1	28,471	オルガン	2.1	6,594	スター精密	10.2	17,258
アルインコ	4.7	5,165	オプトラン	5.8	14,262	トーヨーカネツ	2.2	5,310	電気機器 (13.0%)		
東洋シャッター	1.4	953	NCホールディングス	1.8	1,033	栗田工業	32.2	98,049	日清紡ホールディングス	32.9	33,985
LIXILグループ	87	127,977	フリュー	4.7	4,817	椿本チエイン	7.8	33,111	イビデン	36.6	57,791
日本フィルコン	4.4	2,604	ヤマシンフィルタ	7.3	9,321	大同工業	2.7	2,905	コニカミノルタ	130.3	133,166
ノーリツ	13.2	22,281	日版製作所	10.2	6,861	木村化工機	4.7	2,115	ブラザー工業	77.7	147,396
長府製作所	6	14,328	やまびこ	11.3	14,667	アネスト岩田	9.4	11,580	ミネベアミツミ	110.7	203,909
リンナイ	10.5	85,470	平田機工	2.8	16,912	ダイフク	32.8	190,568	日立	268	881,184
ダイニチ工業	3.1	2,309	ペガサスマシン製造	5.5	4,570	サムコ	1.6	2,096	三菱電機	595.4	891,909
日東精工	8	5,144	タツモ	1.8	1,616	加藤製作所	3	9,105	富士電機	38.4	136,896

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
東洋電機製造	2.7	4,141	富士通ゼネラル	18.1	29,014	レーザーテック	12.3	44,956	三菱ロジスネクスト	7.2	9,432
安川電機	69.2	244,968	ソニー	399.7	2,373,018	スタンレー電気	42.1	139,140	近畿車輛	0.8	1,916
シフォニア テクノロジー	8.3	14,018	TDK	31.2	279,240	岩崎電気	3.2	4,876	日産自動車	703.6	699,589
明電舎	12.2	19,593	帝国通信工業	2.5	3,047	ウシオ電機	36.1	45,919	いすゞ自動車	188.6	304,777
オリジン電気	1.6	3,091	タムラ製作所	23	15,088	岡谷電機	4.3	1,887	トヨタ自動車	664.8	4,522,634
山洋電気	6	12,208	アルプス電気	55	144,705	ヘリオステクノH	5.5	4,323	日野自動車	74.4	86,304
デンヨー	2.8	9,624	池上通信機	1.8	2,575	日本セラミック	6.1	17,446	三菱自動車工業	220.6	153,537
東芝テック	7.4	22,681	パイオニア	98.8	9,089	遠藤照明	4.1	3,271	エフテック	4.1	4,563
芝浦メカトロニクス	1	4,060	日本電波工業	5.4	2,651	古河電池	5	4,145	レシップホールディングス	4	2,892
マブチモーター	16.4	64,862	鈴木	2.8	2,004	双信電機	2.8	1,240	GMB	1.1	1,291
日本電産	71.8	1,085,616	日本トリム	1.1	6,820	山一電機	4.3	6,600	ファルテック	1	969
ユーエーエレクトロニクス	3.2	7,971	ローランド ディー・ジー	3	7,383	図研	3.9	6,887	武蔵精密工業	14	25,144
トレッジ・セミコンダクター	2	3,118	フオスター電機	7	10,829	日本電子	11.9	23,645	日産車体	11.8	11,127
東光高岳	3.5	5,537	クラリオン	7	17,430	カシオ	52.7	83,424	新明和工業	27.9	42,603
ダブル・スコープ	8.7	11,997	SMK	1.6	4,083	ファナック	56.7	1,099,413	極東開発工業	11.9	19,587
宮越ホールディングス	2.5	2,845	ココオ	4.2	7,261	日本シイエムケイ	15.2	13,680	日信工業	11	16,544
ダイヘン	6.8	18,870	ティアック	4.2	1,100	エンプラス	2.7	8,464	トビー工業	4.9	13,122
ヤーマン	8.7	16,277	ホシデン	17.4	15,312	大真空	2.2	2,279	ティラド	2.1	5,369
JVCケンウッド	43.8	12,614	ヒロセ電機	8.6	102,942	ローム	28.8	227,520	曙ブレーキ	32.9	7,172
ミカキエンジニアリング	5.3	4,923	日本航空電子	13.6	19,448	浜松ホトニクス	42.8	169,060	タチエス	10.1	16,149
第一精工	2.5	3,460	TOA	6.9	8,473	三井ハイテック	6.6	8,481	NOK	31.9	54,549
日新電機	14.2	13,504	マクセルホールディングス	12.7	20,218	新光電気工業	20.1	16,140	フタバ産業	16.5	10,098
大崎電気	12.9	10,487	古野電気	7.7	9,948	京セラ	90.9	556,762	K Y B	6.2	17,527
オムロン	63.4	316,366	ユニデンホールディングス	1.7	4,285	太陽誘電	26.5	57,054	大同メタル工業	9.7	9,215
日東工業	10	19,280	アルパイン	10.3	18,941	村田製作所	62.6	1,083,919	プレス工業	29.6	18,144
I D E C	8	20,136	スミダコーポレーション	5.1	7,752	ユーション	9.2	9,062	ミクニ	7.5	4,410
不二電機工業	0.6	823	アイコム	3.2	7,526	双葉電子工業	9.8	17,434	太平洋工業	12.6	21,457
ジーエス・ユアサ コーポ	21.5	56,394	リオン	2.7	5,486	北陸電気工業	2.1	2,259	ケーシン	13.7	26,906
サクサホールディングス	1.4	2,823	本多通信工業	5	3,145	ニチコン	18.8	16,957	河西工業	7.2	7,178
メルコホールディングス	2.5	9,725	船井電機	6.1	4,556	日本ケミコン	4.2	9,840	アイシン精機	49.1	220,459
テクノメディカ	1.3	2,848	横河電機	59.7	124,534	K O A	8.9	13,590	マツダ	186.9	226,149
日本電気	77.3	272,096	新電元工業	2.1	9,817	市光工業	8.9	6,621	今仙電機製作所	5.4	5,724
富士通	57.5	401,752	アズビル	38.9	95,305	小糸製作所	35.8	218,022	本田技研	503.2	1,611,246
沖電気	25.8	38,700	東亜ディーケーケー	2.9	2,778	ミツバ	11	8,217	スズキ	109.1	616,960
岩崎通信機	2.8	2,114	日本光電工業	26.4	97,548	SCREENホールディングス	10.3	58,504	S U B A R U	185.1	467,007
電気興業	3.1	9,176	チノー	2	2,962	キャノン電子	5.5	11,786	安永	2.9	5,550
サンケン電気	6.9	16,691	共和電業	5.7	2,399	キャノン	321	1,033,620	ヤマハ発動機	84.1	196,373
ナカヨ	1.1	1,681	日本電子材料	2.3	1,690	リコー	179.6	197,919	ショーフ	14.1	21,403
アイホン	3.3	5,666	堀場製作所	11.8	62,776	象印マホービン	11.1	12,998	T B K	7	3,136
ルネサスエレクトロニクス	62	33,170	アドバンテス	40.6	98,901	MUTOホールディングス	0.7	1,594	エクセディ	8	23,312
セイコーエプソン	74	133,496	小野測器	2.6	1,833	東京エレクトコ	39.8	631,825	豊田合成	19.3	42,170
ワコム	43.4	24,911	エスベック	5.2	10,956	輸送用機器 (8.0%)			愛三工業	9.2	7,645
アルパック	13.7	57,129	キーエンス	29.3	1,804,880	トヨタ紡織	20.8	36,379	盟和産業	1	1,082
アクセル	2.4	1,406	日置電機	3.1	13,144	芦森工業	1.2	2,062	日本プラスト	4.6	4,245
E I Z O	5.4	25,650	シスメックス	46.4	280,673	ユニプレス	11.5	24,587	ヨロズ	5.5	8,217
ジャパンディスプレイ	139.1	9,737	日本マイクロナクス	9.7	9,515	豊田自動織機	48.3	281,106	エフ・シー・シー	10.7	31,575
日本信号	16.1	16,293	メガチップス	4.7	12,920	モリタホールディングス	10.4	23,275	シマノ	24	397,920
京三製作所	14	7,070	O B A R A GROUP	3.5	17,010	三桜工業	7.5	4,860	ティ・エス テック	13.8	45,402
能美防災	8.2	18,482	澤藤電機	0.7	1,367	デンソー	131.4	689,455	ジャムコ	3	9,615
ホーチキ	4.1	5,383	原田工業	1.9	1,774	東海理化電機	15.7	32,734	精密機器 (1.8%)		
星和電機	3	1,380	コーセル	8.2	9,512	三井E&SHD	21.3	26,220	テルモ	84.4	564,214
エレコム	5.5	16,527	イリソ電子工業	5.4	26,865	川崎重工業	46.4	122,635	クリエートメディック	1.8	1,981
パナソニック	680.5	792,442	オプテックスグループ	10.5	24,192	名村造船所	17.9	10,006	日機装	19.4	21,960
シャープ	59.1	99,524	千代田インテグレ	2.6	6,344	サノヤスホールディングス	7.8	1,677	島津製作所	76.8	203,827
アンリツ	38.5	71,648	アイ・オー・データ	2.4	2,834	日本車輛	2.2	5,821	J M S	5.1	3,034

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30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
クボテック	1.2	410	凸版印刷	84.2	153,917	小田急電鉄	95.8	243,811	三井倉庫HOLD	6.9	13,834
長野計器	4.6	4,402	大日本印刷	84	220,584	京王電鉄	33.4	209,752	住友倉庫	21.5	31,325
パイ・テクノロジー	1.4	22,302	図書印刷	5.6	4,648	京成電鉄	44.7	164,496	沢尻倉庫	3.1	5,152
東京計器	3.7	4,103	共同印刷	1.8	4,771	富士急行	8.2	26,404	東陽倉庫	9.9	3,108
愛知時計	0.8	3,236	N I S S H A	12.2	21,728	新京成電鉄	1.5	3,183	日本トランスシティ	12.6	6,199
インターアクション	3.2	8,256	光村印刷	0.5	1,152	東日本旅客鉄道	106.1	1,094,952	ケイヒン	1	1,430
オーバル	5.5	1,562	宝印刷	3.1	5,707	西日本旅客鉄道	53.5	423,131	中央倉庫	3.3	3,564
東京精密	10.8	36,504	アシックス	59.2	96,851	東海旅客鉄道	53.4	1,245,555	川西倉庫	1.1	1,829
マニー	7.2	38,448	ツツミ	1.9	4,130	西武ホールディングス	76.1	159,657	安田倉庫	4.6	4,025
ニコン	104	185,120	小松ウオール工業	1.8	3,771	湯島運輸	9.4	16,760	東洋埠頭	1.6	2,494
トプコン	32	56,032	ヤマハ	35.5	173,595	西日本鉄道	16.7	49,398	宇徳	4.7	2,528
オリンパス	88.9	284,035	河合楽器	1.8	7,254	ハマキョウレックス	4.6	19,343	上組	34.8	88,705
理研計器	5.2	12,355	クリナップ	5.5	3,987	サカイ引越センター	3.1	19,933	サンリツ	1.4	926
タムロン	5.2	9,505	ピジヨン	36	168,300	近鉄グループHLDGS	56.6	267,718	キムラユニティー	1.5	1,674
HOYA	120.1	828,690	兼松システム	0.4	704	阪急阪神HLDGS	75.5	290,675	キューソー流通システム	1.4	3,512
シード	2.5	3,960	キングダム	4.7	4,295	南海電鉄	25.3	76,785	近鉄エクスプレス	10.6	20,277
ノーリツ鋼機	4.7	9,188	リントック	14.1	36,237	京阪ホールディングス	25.4	120,396	東海運	3.3	1,155
エー・アンド・デイ	5.4	4,498	イトーキ	10.8	6,663	神戸電鉄	1.4	5,600	エーアイテイ	3.6	3,668
朝日インテック	21.6	114,912	任天堂	36.7	1,270,187	名古屋鉄道	45.4	129,163	内外トランスライン	1.7	2,801
シチズン時計	65	39,000	三菱鉛筆	9.8	21,334	山陽電鉄	4.3	10,160	日本コンセプト	1.5	1,716
リズム時計	1.9	3,885	タカラスタンダード	12.4	22,047	日本通運	22.2	151,848	情報・通信業 (7.6%)		
大研医器	4.6	3,519	コクコ	28.5	49,846	ヤマトホールディングス	99.1	297,151	NECネットエスアイ	6.5	16,432
メニコン	8.1	24,243	ナカバヤシ	5.7	3,368	山丸	15.7	83,524	システナ	20.9	30,534
シンシア	0.9	575	グローブライド	2.9	8,378	丸運	3.2	1,020	デジタルアーツ	3.1	20,119
松風	2.7	3,329	オカムラ	20.9	34,213	丸全昭和運輸	4.5	14,017	新日鉄住金SOI	8.8	28,556
セイコーHD	9.2	23,184	美津濃	5.8	14,975	セコングループHLDGS	31	27,404	キューブシステム	3.1	2,390
ニプロ	41.2	63,571	電気・ガス業 (1.9%)			トナミホールディングス	1.4	9,128	エシジア	1.2	1,684
その他製品 (2.1%)			東京電力HD	476.6	328,377	ニッコンホールディングス	21.4	62,209	コア	2.4	3,362
中本パックス	1.6	2,955	中部電力	182.4	310,444	日石輸送	0.7	2,020	ソリトンシステムズ	3.3	2,989
スノーピーク	2.2	3,051	関西電力	243.3	414,583	福山通運	7.3	36,354	ソフトクリエイトHD	2.5	4,347
パラマウントベッドHD	6.8	32,606	中国電力	82.1	117,731	セイノーホールディングス	42.3	71,275	T I S	19.5	102,180
トランザクション	3.2	2,646	北陸電力	58.3	58,941	エスライン	1.6	1,862	ネオス	2.1	2,803
S H O - B I	1.7	676	東北電力	139.4	206,869	神奈川中央交通	1.4	5,467	電算システム	2.2	5,000
ニホンラッシュ	2.5	5,200	四国電力	53.4	72,891	日立物流	12.5	38,375	グリ	31.4	15,574
前田工織	6.6	17,199	九州電力	122.6	163,425	丸和運輸機関	3	10,065	コーエーテックモHD	12	22,608
永大産業	7.6	3,412	北海道電力	55.6	43,256	C&FJホールディングス	5.7	7,410	三菱総合研究所	2.3	8,878
アートネイチャー	6.4	4,364	沖縄電力	11	24,838	九州旅客鉄道	47.3	177,375	ポルテージ	1.2	816
バンダイナムコHLDGS	61.7	294,309	電源開発	47.3	138,210	SGホールディングス	53.4	148,398	電算	0.7	1,488
アイ印刷	1.3	861	エフオン	3.6	3,679	海運業 (0.2%)			AGS	3.3	2,593
共立印刷	10.2	2,529	イーレックス	10.3	7,137	日本郵船	47.4	91,339	ファインデックス	4.9	3,537
S H O E I	2.9	12,861	レノバ	6.2	7,229	商船三井	33.6	89,678	ハイ・コミュニケーションズ	1.3	2,546
フランスベッドHLDGS	8.2	7,945	東京瓦斯	116.9	341,874	川崎汽船	17.4	28,379	プレインパッド	1.3	9,581
パイロットコーポレーション	10.4	61,048	大阪瓦斯	115.5	238,969	N S ユナイテッド海運	3.2	9,792	K L a b	10.4	12,355
萩原工業	3.2	5,472	東邦瓦斯	29.6	135,864	明海海運	5.9	2,236	ポルトフウィン・ビットクル	3.9	10,237
トップパン・フォームズ	12.7	13,220	北海道瓦斯	3.1	4,662	飯野海運	27.5	12,402	イーブフインシアティブ	0.9	1,581
フジールインターナショナル	13.3	54,397	広島ガス	11.9	4,295	共栄タンカー	0.4	731	ネクソン	148.9	199,823
タカラトミー	24.9	35,258	西部瓦斯	6.7	16,736	乾汽船	5.2	5,340	アイスタイル	14.9	17,328
廣済堂	5.5	2,354	静岡ガス	18.1	17,683	空運業 (0.6%)			エムアップ	2	4,406
エステールホールディングス	1.5	1,050	メタウォーター	2.8	8,918	日本航空	103.3	422,910	エイチーム	3.6	6,102
アーク	23.5	2,350	陸運業 (4.6%)			ANAホールディングス	103.1	417,658	テクノスジャパン	4.9	5,007
タカノ	2.2	1,955	SBSホールディングス	6.1	8,350	パスコ	1.1	1,175	e n i s h	2	1,156
プロネクサス	5	5,735	東武鉄道	63	204,750	倉庫・運輸関連業 (0.2%)			コロプラ	16.6	14,193
ホクシン	3.7	592	相鉄ホールディングス	20.7	71,415	トランコム	1.6	10,432	オルトプラス	3.6	1,519
ウッドワン	2	2,344	東京急行	162.3	320,704	日新	4.8	9,388	ブロードリーフ	28.9	18,351
大建工業	4.5	9,522	京浜急行	81.8	148,139	三菱倉庫	19.8	55,519	クロス・マーケティング	1.7	734

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30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
デジタルハーツHLDGS	2.6	4,342	ムラシタコム・ポリューション	0.5	507	マーベラス	8.8	8,069	高千穂交易	2.2	2,373
メディアドゥハLDGS	1.8	4,987	チェンジ	0.4	2,968	エイベックス	9.9	15,295	伊藤忠食品	1.4	7,448
じげん	6.3	4,214	シンクロ・フード	2.4	1,526	日本ユニシス	18.4	53,268	エレマテック	2.7	6,104
ブイキューブ	3.1	1,624	オークネット	3	3,360	兼松エレクトロニクス	3.2	11,648	JALUX	1.7	4,865
サイバーリンクス	0.9	938	AOI TYO HOLDINGS	6.4	6,720	東京放送HD	39	82,914	あらた	3.2	15,776
ディー・エル・イー	3.8	1,174	マイコム	7.3	13,001	日本テレビHLD S	53.6	95,247	トーメンデバイス	0.8	1,968
フィックスターズ	5.6	7,576	ビーグリー	1.1	1,111	朝日放送グループHD	6.1	4,788	東京エレクトロデバイス	2.1	4,013
VOYAGE GROUP	3.1	3,918	オロ	0.6	2,283	テレビ朝日HD	16.2	37,017	フィールズ	5.1	4,671
オプティム	1.3	6,207	ソルクシーズ	2.4	1,989	スカパーJ SATHD	44.7	24,450	双日	324.7	130,529
セレス	1.9	4,054	フェイス	2.3	2,743	テレビ東京HD	4.8	13,200	アルフレッサホールディングス	65.2	196,904
ベリサーブ	0.6	3,318	ハイマックス	0.7	1,267	日本BS放送	1.9	2,352	横浜冷凍	15.2	14,409
ティーガイア	5.9	14,289	野村総合研究所	37.3	185,940	ビジョン	1.8	8,595	神楽	0.7	812
セック	0.9	3,951	サイバネットシステム	4.8	3,244	USEN-NEXT HLDGS	2.3	2,776	ラサ商事	3.2	3,113
日本アジアグループ	6.4	2,355	CEホールディングス	1.5	1,143	ワイヤレスゲート	2.5	1,410	ラクーンホールディングス	3.4	2,397
豆蔵ホールディングス	4	4,288	日本システム技術	0.9	1,798	コネクシオ	4.1	6,055	アルコニクス	6.2	8,091
テクマトリックス	4.1	7,749	インターネットサイディングス	7.4	7,540	日本通信	50.5	7,019	神戸物産	8.9	30,972
プロシップ	0.8	1,992	東邦システムサイエンス	1.8	1,629	クロップス	1	744	あいホールディングス	9.4	21,272
ガンホー・オンライン・エンター	141.3	35,607	ソースネクスト	22.7	16,707	日本電信電話	400.3	1,873,404	ディーブイエックス	2.2	2,684
GMOペイメントゲートウェイ	9.7	67,803	FIG	5.1	2,065	KDDI	515.8	1,374,091	ダイワボウHD	5.4	34,344
ザン	2.8	1,120	フォーカスシステムズ	3.9	4,344	光通信	6.9	124,959	マクコ・富士エレクトロニクス	16.2	28,382
システムリサーチ	0.8	2,884	グレスコ	1.8	6,930	NTTドコモ	420.4	1,105,021	ラクト・ジャパン	1.3	10,348
インターネットアジアティブ	9.6	26,803	フジ・メディア・HD	60.9	107,732	エムティーアイ	6.9	4,146	パイタルKSKHD	11	13,332
さくらインターネット	7	4,144	オービック	20.3	199,143	GMOインターネット	21.3	31,737	八洲電機	6	5,010
ヴェックス	2	3,672	ジャストシステム	8.3	21,173	アイドママーケティングコム	1.3	696	メディアスホールディングス	3.1	2,563
GMOクラウド	1.3	5,213	TDCソフト	5.1	4,962	カドカワ	17.2	24,269	UKCホールディングス	3.8	9,256
SRAホールディングス	3.1	9,424	ヤフー	380.7	123,727	学研ホールディングス	2	8,790	ジュテックHD	1.3	1,384
MINORISリユージョンズ	1.1	1,787	トレンドマイクロ	31.2	203,112	ゼンリン	11.7	32,958	大光	1.4	956
システムインテグレート	1.6	1,604	インフォメーションディベロ	1.6	2,312	昭文社	2.7	1,476	OCHIホールディングス	1.8	2,280
朝日ネット	4.8	2,620	日本オラクル	9.5	70,015	インプレスホールディングス	4.9	808	TOKAIホールディングス	30.9	31,023
eBASE	1.7	2,939	アルファシステムズ	1.9	5,065	アイネット	3.3	5,507	黒谷	1	513
アパント	1.6	2,203	フューチャー	8	14,024	松竹	3.9	46,371	Cominix	0.9	756
アドソル日進	2	3,924	CAC HOLDINGS	4.4	4,725	東宝	38.6	152,470	三洋貿易	3	6,069
フリービット	4	3,952	ソフトバンク・テクノ	2.5	5,295	東映	2.5	34,500	ビュートイガレージ	0.8	1,438
コムチュア	3.3	10,972	トーセ	1.6	1,500	NTTデータ	155.7	205,524	ウイン・パートナーズ	3.7	4,299
サイバーコム	1	1,719	オービックビジネスC	3	29,820	ピー・シー・イー	0.7	1,549	ミタチ産業	1.4	1,101
アステリア	2.9	2,621	伊藤忠テクノソリューション	26.7	58,446	ビジネスB 太田昭和	1	2,068	シップヘルスケアHD	12.2	52,094
マークライنز	2	3,048	アイティフォー	7	5,985	DTS	6.5	26,585	明治電機工業	1.8	3,826
メディカル・データ・ビジ	5.2	5,335	東計電算	0.9	3,055	スクウェア・エニックス・HD	27.2	100,640	デリカフーズHLDGS	1	1,452
gumi	6.7	4,971	エックスネット	1.1	1,007	シーイーシー	6.3	15,466	スターティアホールディングス	1.1	795
ショーケース・ティービー	1.2	1,129	大塚商会	31.7	121,094	カブコム	25.1	55,772	コマダホールディングス	13.5	31,995
モバイルファクトリー	1.6	2,166	サイボウズ	6.8	4,760	アイ・エス・ピー	1.1	2,611	富士興産	2.2	1,383
デジタル・インフォメーション	2.6	4,193	ソフトブレーン	4.5	2,376	ジャステック	3.3	3,514	協栄産業	0.7	1,216
PCIホールディングス	1	2,794	電通国際情報S	3.6	13,824	SCSK	15.4	69,377	小野建	5.1	8,557
パイプHD	0.9	931	デジタルガレージ	11.4	35,397	日本システムウェア	1.9	4,700	佐島電機	4.4	4,624
アイビシー	0.9	1,228	イーエムシステムズ	4.7	5,508	アイネス	7.3	9,263	エコートレーディング	1.5	949
ネオジャパン	1.1	996	ウェザーニューズ	1.9	6,108	TKC	4.9	19,992	伯東	3.9	5,222
PRTIME S	0.4	932	CIJ	4.5	3,388	富士ソフト	8.7	44,718	コンドーテック	4.4	4,545
ランドコンピュータ	0.7	714	東洋ビジネスエンジ	0.6	1,326	NSD	9.5	22,724	中山福	3.4	1,873
オープンドア	2.9	9,642	日本エンタープライズ	5.7	1,311	コナミホールディングス	23.9	121,412	ナガイレーベン	8.5	23,587
マイネット	1.8	3,326	WOWOW	2.8	9,296	福井コンピュータHLD S	1.9	3,334	三菱食品	6.4	19,616
アカツキ	2.1	11,634	スカラ	4.7	3,962	JBCホールディングス	4.6	8,146	松田産業	4.5	6,714
ベネフィットジャパン	0.3	276	IMAGICA GROUP	4.9	2,974	ミロク情報サービス	5.8	14,210	第一興商	8.7	45,066
UBICOMホールディングス	1.1	1,263	ネットワークシステムズ	20.8	48,817	ソフトバンクグループ	244.6	2,330,059	メディアパルHD	63.3	164,580
L I N E	17.8	72,624	システムソフト	13.5	1,539	卸売業 (5.0%)			S P K	1.2	2,868
カナミックネットワーク	0.9	1,773	アルゴグラフィックス	2.5	11,350	ハウスイ	0.5	455	萩原電気HLDGS	2.1	6,730

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30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
アズワン	4.2	35,196	阪和興業	10.1	34,340	バイテックホールディングス	2.7	6,566	クリエイトSDH	8.7	26,926
スズデン	1.9	2,445	正栄食品	3.1	15,004	東テク	1.9	5,339	丸善CHI HD	6.6	2,283
尾家産業	1.8	2,404	カナデン	5.8	7,592	ミスミグループ本社	73.6	189,299	ミサフ	1	495
シモジマ	3.5	3,948	菱電商事	4.9	7,840	アルテック	4.4	1,210	ティーライフ	0.8	784
ドウシヤ	5.6	11,782	フルサト工業	3.1	5,939	タキヒョー	1.7	3,343	エー・ピーカンパニー	0.9	486
小津産業	1.2	2,362	岩谷産業	13	49,140	蔵王産業	0.9	1,273	チムニー	1.7	4,676
高速	3.4	4,110	すてきナイスグループ	2.4	2,719	スズケン	26.8	163,748	シュッピン	4	4,380
たげびし	2.7	3,990	昭光通商	2.3	1,846	ジェコス	4	4,616	ネクステージ	9	10,791
リックス	1.3	2,054	ニチモウ	1.3	2,398	ルネサスイーストン	5.2	2,334	ジョイフル本田	17.2	29,773
丸文	5.1	4,319	極東貿易	1.9	3,357	小売業 (5.3%)			鳥貴族	1.9	4,259
ハピネット	4.8	7,752	イワキ	7	3,696	ローソン	14.8	109,964	キリン堂ホールディングス	2.3	3,714
橋本総業HLDGS	1	1,460	三菱石油	15.6	20,248	サンエー	4.4	20,966	ホットランド	3	4,449
日本ライフライン	18.4	33,083	稲畑産業	14.2	23,117	カワチ薬品	4.5	9,940	すかいらーくHD	54.6	101,556
タカショー	2.8	1,338	G S I クレオス	1.6	2,380	エービーシー・マート	9.2	58,696	綿半ホールディングス	2.2	5,977
エクセル	2.2	4,419	明和産業	6.2	2,740	ハードオフコーポレーション	2.3	2,104	ヨシックス	1	3,325
マルカキカイ	1.9	4,263	ワキタ	12.5	16,312	アスクル	5.1	15,121	コナテッド・スーパーマケ	17.2	22,686
I DOM	19.8	11,286	東邦ホールディングス	17.3	52,159	ゲオホールディングス	8.9	17,007	ゴルフダイジェスト・オン	2.3	1,853
日本エム・ディ・エム	3.4	4,722	サンゲツ	17.7	38,444	アダストリア	8.1	15,057	B E E N O S	1.4	2,294
進和	3.5	8,505	ミツウロコグループ	8.3	5,893	ジューフット	3.9	2,932	あさひ	4.8	7,012
エスケイジャパン	1.4	1,247	シナモンホールディングス	2.4	6,597	シー・ワイ・エス・ベイエリア	0.7	520	日本調剤	2.1	7,707
ダイトロン	2.7	4,158	伊藤忠エネクス	12.9	13,764	くらコーポレーション	3.4	24,276	コスモス薬品	3	69,090
シークス	7.4	13,379	サンリオ	18.2	42,697	キャンドウ	2.7	4,546	トーエル	2.8	2,276
田中商事	1.8	1,128	サンワ テクノス	3.5	4,364	パルグループHLDGS	3	9,240	一六堂	1.2	615
オーハシテクニカ	3.2	4,473	リョーサン	6.5	21,515	エディオン	24.9	31,075	オンリー	1	1,080
白銅	1.8	3,189	新光商事	5.6	9,839	サーユーコーポレーション	11.8	7,799	セブン&アイ・HLDGS	246.3	1,217,460
伊藤忠	410.6	827,769	トーホー	2.6	6,227	ワッツ	1.9	1,548	薬王堂	2.5	8,500
丸紅	578.6	490,363	三信電気	5	10,095	ハローズ	2.2	5,715	クリエイト・レストランツ・ホール	15.7	20,802
高島	0.9	1,828	東陽テクニカ	6.5	5,902	あみやき亭	1.3	5,330	ツルハホールディングス	12.7	142,240
長瀬産業	32.8	55,661	モスフード サービス	7.6	23,294	ひらまつ	11.6	4,280	サンマルクホールディングス	4.6	12,760
蝶理	3.8	7,197	加賀電子	5.8	13,943	大黒天物産	1.4	6,279	フェリシモ	1.3	1,575
豊田通商	65.5	256,760	ソーダニツカ	6.6	4,171	ハニーズホールディングス	5.6	5,090	トリドールホールディングス	7.2	15,926
三共生興	10.2	4,661	立花エレテック	4.2	7,429	ファーマライズHD	1.4	844	T O K Y O B A S E	5.2	3,619
兼松	23.3	33,738	フォーバル	2.6	2,623	アルパン	4.5	8,761	ウイルプラスHLDGS	0.5	484
ツカモトコーポレーション	1	1,178	P A L T A C	10.6	64,448	ハバン	1.9	1,814	ジャパンミート	2.2	4,373
三井物産	483.8	858,503	三谷産業	7.9	2,480	クオールホールディングス	8.6	17,458	サツドラホールディングス	1	1,964
日本紙パルプ	3.3	14,800	太平洋興発	2.3	2,040	ジンス	4	28,080	デファクトスタンダード	0.4	249
日立ハイテクノロジーズ	17.9	72,405	西本WISMETTAC HD	1.3	6,734	ビックカメラ	31.4	50,114	ダイユー・リックHLDGS	3.1	3,692
カメイ	7.6	10,526	ヤマシタヘルスケアHLDGS	0.4	503	DCMホールディングス	31.6	35,581	パロックスジャパン	4.7	5,043
東都水産	0.8	1,609	国際紙パルプ商事	10.6	3,392	ペッパーフードサービス	4.6	18,860	クスリのアオキHLDGS	4.7	39,480
OUGホールディングス	0.9	2,385	ヤマタネ	2.9	5,681	Mon o t a R O	37.2	114,390	カの源HD	1.6	1,545
スターゼン	2.1	9,219	丸紅建材リース	0.5	1,047	丸京一番フーズ	1.4	886	スシローグローバルHLDGS	6.4	39,808
山善	23	27,669	日鉄住金物産	4.1	20,992	DDホールディングス	1.3	3,205	L I X I L ビバ	4.9	8,717
椿本興業	1.3	4,381	泉州電業	1.9	5,071	きちり	1.5	1,237	メディカルシステムネットワーク	6.2	2,852
住友商事	347	604,994	トラスコ中山	12.2	39,345	アークランドサービスHD	4.2	10,558	はるやまHLDGS	2.7	2,419
内田洋行	2.6	7,022	オートバックセブン	23.3	40,448	J. フロント リテイリング	75.2	116,560	ノジマ	10.4	27,092
三菱商事	412.3	1,262,462	モリト	4.1	3,333	ドトール・日レスHD	10.2	22,593	カップ・クリエイト	8.4	12,600
第一実業	2.7	10,827	加藤産業	9.1	31,986	マツモトキヨシHLDGS	24.3	102,424	ライトオン	5	4,720
キャンマークティンヅPN	16.8	36,590	北恵	0.9	896	プロンコビリー	3.1	9,241	ジーンズメイト	1.8	869
西華産業	3.3	5,435	イノテック	4	4,688	Z O Z O	63.4	160,085	良品計画	8.3	253,565
佐藤商事	5	4,980	イエローハット	5.5	16,406	トレジャー・ファクトリー	1.7	1,266	三城ホールディングス	7.5	3,705
菱洋エレクトロ	6	10,788	JKホールディングス	5.2	3,198	物語コーポレーション	1.7	18,819	アドヴァン	9	9,891
東京産業	6.3	3,748	日伝	4.7	8,591	ココカラファイン	6.6	42,768	アルビス	2.2	6,305
ユアサ商事	6	22,830	北沢産業	4.4	1,100	三越伊勢丹HD	110	144,430	コナカ	7.7	3,826
神鋼商事	1.3	3,585	杉本商事	3.1	5,580	H a m e e	1.5	2,746	ハウス ローゼ	0.7	1,334
小林産業	3.1	945	因幡電機産業	8.6	40,549	ウエイシアHD	15.6	89,700	G-7ホールディングス	1.7	4,481

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30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
イオン北海道	6	4,872	近鉄百貨店	2.3	8,579	第四北越フィナンシャルG	10.2	37,740	長野銀行	2	3,302
コジマ	8.8	4,558	パルコ	5.7	7,467	新生銀行	42.9	66,838	名古屋銀行	4.7	17,249
ヒマラヤ	1.7	1,766	丸井グループ	49.8	121,860	おおぞら銀行	32.7	121,971	北洋銀行	88	28,952
コーナン商事	7.7	21,560	アクシアル リテイリング	4.8	19,368	三菱UFJフィナンシャルG	4,095	2,557,327	愛知銀行	2.1	9,219
エコス	2.2	4,591	井筒屋	3.3	788	りそなホールディングス	643.5	387,322	中京銀行	2.4	5,652
ワタミ	7.7	10,949	イオン	226.3	615,762	三井住友トラストHD	115.6	526,211	大光銀行	2	4,250
マルシェ	1.3	1,033	イズミ	11.9	76,517	三井住友フィナンシャルG	414.4	1,733,435	愛媛銀行	8.1	9,355
ドンキホーテホールディング	38.1	262,509	平和堂	11.9	37,485	千葉銀行	208.4	155,258	トマト銀行	2.3	2,996
西松屋チェーン	12.9	12,861	フジ	7	14,973	群馬銀行	116.8	63,188	京葉銀行	25.9	20,720
ゼンショーホールディングス	27.8	78,562	ヤオコー	6.7	45,493	武蔵野銀行	8.7	26,709	栃木銀行	29.9	8,820
幸楽苑ホールディングス	3.7	8,291	ゼビオホールディングス	7.1	10,458	千葉興業銀行	15.9	7,075	北日本銀行	1.8	4,471
ハーフスレイ	1.2	1,312	ケーズホールディングス	61	73,017	筑波銀行	24	5,808	東和銀行	10.3	9,620
サイゼリヤ	9.6	20,832	OLYMPICグループ	3.5	3,027	七十七銀行	18.4	41,823	福島銀行	5.1	2,876
V Tホールディングス	19.6	9,192	日産東京販売HD	8.5	2,949	青森銀行	4.5	14,062	大東銀行	2.9	2,427
魚力	1.6	2,305	GENKY DRUGSTORES	2.3	8,521	秋田銀行	3.7	8,628	トモニホールディングス	45.1	21,332
ポプラ	1.4	854	総合メディアHD	5.1	13,591	山形銀行	6.6	15,754	フィデアホール	56.2	8,711
フジ・コーポレーション	1.2	2,394	ブックオフGHD	3	2,349	岩手銀行	4.1	16,974	池田泉州HD	61.6	20,820
ユナイテッドアローズ	6.7	25,627	アインホールディングス	7.9	69,125	東邦銀行	52.6	19,777	証券・商品先物取引業 (0.9%)		
ハイデイ日高	7.6	17,913	元気寿司	1.6	8,016	東北銀行	3	4,035	F P G	18.7	23,001
京都きもの友禅	4	1,796	ヤマダ電機	179	98,271	みちのく銀行	3.8	6,904	マーキュラインバストメント	2.3	1,987
コロナイ	19.5	51,519	アークランドサカモト	9.9	15,364	ふくおかフィナンシャルG	47.8	123,754	S B Iホールディングス	70.1	180,577
ピーシーデポコーポ	7.7	4,265	ニトリホールディングス	25.4	386,207	静岡銀行	148.3	151,117	日本アジア投資	5	1,275
壱番屋	4.1	19,536	グルメ軒屋	4.1	4,899	十六銀行	7.8	21,028	ジャフコ	9.6	39,840
トップカルチャー	2.2	842	愛眼	4.7	1,569	スルガ銀行	59.5	32,011	大和証券G本社	471.9	295,645
P L A N T	1.4	1,533	ケーユーホールディングス	3	2,712	八十二銀行	106.4	55,434	野村ホールディングス	1,079.2	551,902
スギホールディングス	12.8	68,352	吉野家ホールディングス	20.5	39,954	山梨中央銀行	7.3	12,139	岡三証券グループ	49.9	27,844
ヴィア・ホールディングス	7.2	5,263	松屋フーズHLDGS	2.8	10,906	大垣共立銀行	9.2	22,908	丸三証券	17.8	15,913
スクロール	9	4,086	サガミホールディングス	7.7	10,641	福井銀行	4.9	9,437	東洋証券	21.3	4,366
ヨドシホールディングス	6.4	15,776	関西スーパーマーケット	4.4	4,840	北國銀行	6.2	26,350	東海東京HD	70.1	38,905
ユニ・ファミリーマートHD	16.4	264,204	王将フードサービス	4.3	34,099	清水銀行	2.4	4,562	光世証券	1.4	1,416
木曾路	7.1	18,587	プレナス	6.6	13,101	富士銀行	1.1	4,158	水戸証券	17.1	5,249
SRSホールディングス	6.7	6,914	ミニストップ	4.3	8,909	滋賀銀行	11.7	33,321	いちよし証券	12.3	11,771
千趣会	11.1	3,529	アークス	1.1	31,284	南都銀行	6.8	17,503	松井証券	29	37,294
タカキユー	4.8	945	パロ－ホールディングス	12.7	37,185	百五銀行	52.9	23,805	だいご証券ビジ	2.4	1,178
ケーヨー	10.7	6,516	藤久	0.5	397	京都銀行	21.1	115,206	マネックスG	55.4	23,268
上新電機	6.9	19,954	ベルク	2.9	17,487	紀陽銀行	20.8	37,606	カブドットコム証券	43.9	18,394
日本瓦斯	10.7	43,228	大庄	3.1	5,325	はくほくフィナンシャルG	38.9	57,727	極東証券	7.8	10,233
ロイヤルホールディングス	10.3	29,447	ファーストリテイリング	7.9	466,416	広島銀行	86.2	58,960	岩井コスモホールディング	6	8,466
東天紅	0.5	732	サンドラッグ	22.1	84,643	山陰合同銀行	34.9	31,235	藍澤證券	11	8,415
いなげや	6.7	10,599	サックスパーホールディング	4.9	5,507	中国銀行	37.6	39,743	マネーパートナーズGP	6.8	2,312
島忠	13.3	40,764	ヤマザウ	1.2	2,145	鳥取銀行	2	3,106	小林洋行	2	566
チヨダ	6.1	12,498	やまや	1	2,540	伊予銀行	77.4	53,947	保険業 (2.4%)		
ライフコーポレーション	4.4	11,915	ペルナ	14.4	18,417	百十四銀行	6.2	17,874	かんぽ生命保険	22	63,030
リンガーハット	7.2	17,834	銀行業 (6.7%)			四国銀行	8.4	11,751	S O M P Oホールディングス	114.5	502,197
M r M a x HD	8.1	4,406	島根銀行	1.4	1,202	阿波銀行	9.4	30,832	アニコムホールディングス	4.5	16,942
テンアライド	5.2	2,158	じもとホールディングス	39.6	5,940	大分銀行	3.6	13,752	MS & A D	152.7	526,051
A O K Iホールディングス	11.7	17,140	めぶきフィナンシャルG	305.7	104,855	宮崎銀行	3.9	12,811	S O N Y F H	48	114,240
オークワ	8.3	10,358	東京きらぼしFG	8	16,792	佐賀銀行	3.5	7,227	第一生命H L D G S	330.6	653,926
コメリ	9	24,453	九州フィナンシャルG	97.2	51,613	十八銀行	3.7	10,556	東京海上HD	211.8	1,187,139
青山商事	11.3	32,182	ゆうちょ銀行	168	222,768	沖縄銀行	5.3	19,795	T & Dホールディングス	180.8	291,630
しまむら	6.8	65,552	富山第一銀行	13.7	5,932	琉球銀行	13.4	17,393	アドバンスクリエイト	1.3	2,674
はせがわ	2.9	1,348	富山メディア・フィナンシャル	375.3	200,034	セブン銀行	198.6	69,907	その他金融業 (1.2%)		
高島屋	45.9	75,735	西日本フィナンシャルHD	37.8	46,569	みずほフィナンシャルG	7,992.9	1,505,063	全国保証	16.5	64,020
松屋	11.9	16,826	関西みらいFG	27.7	25,345	高知銀行	2	1,818	ジェイリース	1.2	576
イチ・ツー・オーリテイリング	30.1	58,604	33 F G	5.1	9,786	山口フィナンシャルG	73.3	86,200	イントラスト	1.7	731

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30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
日本モーゲージサービス	0.8	802	三井不動産	313.3	850,609	学情	2.3	3,532	オリエンタルランド	67.4	761,283
C a s a	1.8	2,106	三菱地所	414.3	754,440	スタジオアリス	2.9	7,534	ダスキン	15.2	39,778
アルヒ	5.3	9,524	平和不動産	11.7	22,709	ミックホールディングス	3.2	6,966	明光ネットワークジャパン	7.2	7,480
クレディセゾン	40.9	59,591	東京建物	65.3	84,498	N J S	1.2	2,062	ファルコホールディングス	3.1	5,164
アクリーティブ	0.9	370	ダイビル	18.2	22,604	総合警備保障	22.7	121,218	秀英予備校	1.5	744
芙蓉総合リース	6.7	46,096	京阪神ビルディング	11.7	10,670	カカゴコム	42.9	97,983	田谷	1.4	908
興銀リース	11	30,800	住友不動産	133.1	560,084	アイロムグループ	2.2	4,824	ラウンドワン	17.6	22,176
東京センチュリー	11.9	64,498	大京	9	26,721	セントレア・ホールディング	3.1	1,813	リゾートトラスト	24.2	45,181
日本証券金融	26	17,160	テオオーシー	14.3	12,169	サイネックス	0.9	686	ビー・エム・エル	7.3	21,060
アイフル	89.8	27,927	東栄楽天地	0.9	4,360	ルネサンス	3.1	7,353	ワタベウエディング	1	1,095
リコーリース	4.6	16,997	レオパレス 2 1	73.7	36,334	ディップ	9.1	23,205	りらいあコミュニケーション	10.2	10,822
イオンフィナンシャルサービス	37.6	82,720	スターツコーポレーション	8.4	22,293	オプトホールディング	3.5	7,409	リソー教育	28.8	11,232
アコム	118.7	49,497	フジ住宅	8.5	7,709	新日本科学	7.9	5,616	早稲田アカデミー	0.8	1,836
ジャックス	6.5	13,377	空港施設	8.1	4,851	ツクイ	13.3	13,579	ユー・エス・エス	69.6	140,174
オリコ	163.6	28,793	明和地所	4.2	2,633	キャリアデザインセンター	1.4	1,822	東京個別指導学院	2	2,666
日立キャピタル	14	39,270	ゴールドクレスト	4.9	8,643	エムスリー	120.1	220,263	サイバーエージェント	35.1	180,414
アプラスフィナンシャル	31.7	3,265	日本エスリード	2.4	3,890	ツカダ・グローバルHOLD	3.8	2,386	楽天	265.8	242,941
オリックス	391.8	720,716	日神不動産	9	4,617	プラス	0.5	316	クリーク・アンド・リバー社	3.3	3,913
三菱UFJリース	133	82,327	日本エスコ	10.9	8,033	アウトソーシング	30	42,690	テー・オー・ダブリュー	5.4	4,838
九州リースサービス	3	2,112	タカラレーベン	27.9	9,569	ウエルネット	5.7	6,526	セントラルスポーツ	2.1	7,959
日本取引所グループ	159.1	325,359	サンヨーハウジング名古屋	4	4,176	ワールドホールディングス	1.6	4,377	フルキャストホールディングス	5.7	13,172
イー・ギャランティ	5.5	6,160	イオンモール	30.2	61,638	ディー・エヌ・エー	30.8	64,864	エン・ジャパン	6.2	28,396
アックス	2.6	1,580	ファースト住建	2.6	3,159	博報堂D Y H L D G S	79.4	137,997	リソルホールディングス	0.6	2,421
NECキャピタルソリューション	2.5	4,215	ランド	258.5	2,585	ぐるなび	8.1	6,820	テクノロ・ホールディング	10.7	60,776
不動産業 (2.4%)			カチタス	6.6	21,549	エスアールジータカミヤ	6.1	4,239	アトラ	1.2	606
いちご	74	28,786	トーセイ	8.4	8,643	ジャパンベストレスキュー	4.4	7,145	インターワークス	1.1	834
日本駐車場開発	75.6	12,096	穴吹興産	0.9	2,736	ファンコミュニケーションズ	15.6	10,998	アイ・アールジャパンHD	1.8	2,620
ヒューリック	124	128,712	エヌ・ティ・ティ都市開発	9.5	15,950	ライク	2.2	3,656	Keep E r 技研	1.9	2,122
三栄建築設計	2.6	4,095	サンフロンティア不動産	8.4	10,096	WJNB・ブレイクスルー	2.3	867	ファーストロジック	1.1	962
野村不動産H L D G S	40.3	90,352	インテリックス	2	1,528	ビズホーディングス	2.6	7,482	三機サービス	0.9	1,675
三重交通グループHD	12.5	7,675	ランドビジネス	4.2	2,452	ティア	2.6	1,794	G u n o s y	3.5	11,830
サムティ	8.3	12,582	グランディアハウス	6.1	2,464	C D G	0.5	730	デザインワン・ジャパン	1.2	523
イー・ディー・ワークス	96.1	3,940	日本空港ビルディング	18.9	83,349	パリュココマース	3.9	5,795	イー・ガーディアン	2.7	7,222
日本商業開発	4.2	7,274	サービス業 (4.8%)			インフォーマット	31.3	43,632	リブセンス	3.1	1,050
プレサンスコーポレーション	9.6	13,593	日本工営	3.8	10,377	J P ホールディングス	16.1	4,974	ジャパンマテリアル	15.6	20,498
ユニゾホールディングス	9.1	21,039	L I F U L L	19.8	17,760	エコナックホールディングス	10.4	1,206	ベクトル	6.9	12,696
日本管理センター	4.1	4,177	ジェイエイチリアルメント	4.6	10,649	E P S ホールディングス	8.5	18,572	ウチヤマホールディングス	3	1,464
サンセイラディック	1.9	1,932	日本M&Aセンター	42.5	112,497	レブス	1.5	1,657	ライクキッズネクスト	1.2	1,432
エストラスト	1.3	1,036	メンバーズ	1.9	1,957	プレステージ・インター	10.7	15,418	キャリアリンク	2.1	932
フージャースHD	13.5	8,856	中広	0.5	310	アミュージズ	3.4	9,305	I B J	3.8	3,074
オーブハウス	9.6	38,784	タケエイ	5.8	5,022	ドリームインキュベータ	1.7	3,221	アサンテ	2.2	5,011
東急不動産HD	160.2	102,047	E・Jホールディングス	0.7	830	クイック	3.5	5,309	N・フィールド	3.6	4,154
飯田GHD	49.6	99,348	トラスト・テック	2.7	8,802	T A C	3.1	824	パリュコH R	1.2	2,488
イーグルランド	1.1	814	コジダカホールディングス	15.3	23,485	ケネディクス	53.8	28,783	M&Aキャピタルパートナー	1.4	5,971
ピーロッド	1	1,369	アルトナー	1	781	電通	69.5	351,670	ライドオンエクスプレスHD	2.4	3,772
ファーストブラザーズ	1.6	2,176	パソナグループ	5.4	7,543	ティクアンドギヴニーズ	2.2	4,243	ERIホールディングス	1.6	1,480
ハウスドゥ	2.3	2,870	C D S	1.4	1,860	ぴあ	1.6	8,176	アピスト	0.9	3,177
シーアールイー	2.6	2,623	リンクアンドモチベーション	10.5	10,930	イオンファンタジー	1.8	5,706	シグマシス	2.7	2,905
プロパティエージェント	0.8	826	G C A	5.7	4,571	シーティーエス	6.4	4,844	ウィルグループ	3.7	4,369
クイアイスター不動産	1.8	3,385	エス・エム・エス	20.9	39,083	ネクシィーズグループ	1.7	3,065	エスクローA J	7.7	3,580
アグレ都市デザイン	1	635	パソナルホールディングス	56.9	120,969	みちかホールディングス	15.8	41,475	日本ビューホテル	1.8	2,158
ジェイ・エス・ビー	0.2	899	リニカル	3.2	5,171	アルプス技研	5	10,490	リクルートホールディングス	408.4	1,275,433
テンポイノベーション	0.5	768	クックパッド	17.8	7,351	サニックス	10	2,310	エラン	2	6,000
パーク 2 4	34.3	105,129	エスクリ	1.6	1,070	ダイオーズ	1.2	1,668	土木管理総合試験	2.5	1,520
パラカ	1.5	2,904	アイ・ケイ・ケイ	2.8	2,027	日本空調サービス	6.3	4,794	日本郵政	464	641,248

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在		銘柄	2018年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円
ベルシステム24HLDGS	9.6	14,467	メイテック	7.2	36,864
鎌倉新書	4.2	5,266	応用地質	6.1	8,161
一蔵	0.7	499	船井総研ホールディング	11.8	24,721
LITALICO	1.3	2,483	進学会ホールディングス	2.8	1,761
グローバルグループ	0.7	827	オオバ	4.4	3,220
エボラブルアジア	1.6	3,614	いであ	1.1	1,233
アトラエ	1.1	2,640	学究社	1.9	3,133
ストライク	1.4	4,100	ベネッセホールディングス	20.8	70,096
ソラスト	13.9	19,960	イオンディライト	7	27,965
セラク	1.3	932	ナック	3.8	4,168
インソース	1.9	4,694	ニチイ学館	8.1	9,274
アイモバイル	1.3	911	ダイセキ	9.6	25,228
キャリアインデックス	2	4,234	ステップ	2.1	3,160
MS-Japan	2.3	3,592			
船場	0.9	870	合計	株数、金額	68,705.2
グレイステクノロジー	1.5	3,226		銘柄数<比率>	2,099銘柄<98.7%>
ジャパンエレベーターSHD	3.4	7,225			
フルテック	0.7	820			
グリーンズ	1.2	1,850			
ツナグ・ソリューションズ	0.5	366			
日総工産	1.4	2,751			
キュービーネットHLDGS	2.9	6,435			
スプリックス	1.6	3,115			
アドバンテッジリスクマネ	2.2	2,692			
リロググループ	31.5	98,280			
東祥	3.6	15,228			
エイチ・アイ・エス	10.1	38,632			
ラックランド	1.1	3,250			
共立メンテナンス	8.7	49,590			
イチネンホールディングス	5.9	8,590			
建設技術研究所	3.9	5,725			
スペース	3.6	4,474			
長大	2.2	1,764			
燦ホールディングス	1.2	3,091			
スバル興業	0.4	2,232			
東京テアトル	2.4	3,240			
タナベ経営	1.1	1,772			
ナガワ	1.7	10,795			
よみうりランド	1.2	5,070			
東京都競馬	3.7	12,598			
常磐興産	2.2	3,865			
カナモト	8.5	28,390			
東京ドーム	21.1	21,922			
西尾レントオール	5.8	24,041			
アゴーラ・ホスピタリティG	33.4	1,002			
トランス・コスモス	6.3	16,531			
乃村工務社	13.4	40,803			
藤田観光	2.2	6,974			
KNT-CTホールディングス	3	3,864			
日本管財	6.2	12,951			
トーカイ	5.5	15,361			
白洋舎	0.7	2,100			
セコム	60.5	581,163			
セントラル警備保障	2.8	17,752			
丹青社	10.7	13,803			

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

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2018年11月30日現在	
	買建額	売建額
国内	1,868	-
TOPIX	1,868	-

(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	2018年11月30日現在	
	貸付	借入
株式	7,218,800 (406,700)	株 (-)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ406,700株を貸付けています。

トピックス・インデックス・マザーファンド 運用報告書 第30期（決算日 2018年9月19日）

（計算期間 2017年9月20日～2018年9月19日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの第30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いません。
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いません。 イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行いません。 ロ. ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。 ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。
株式組入制限	無制限

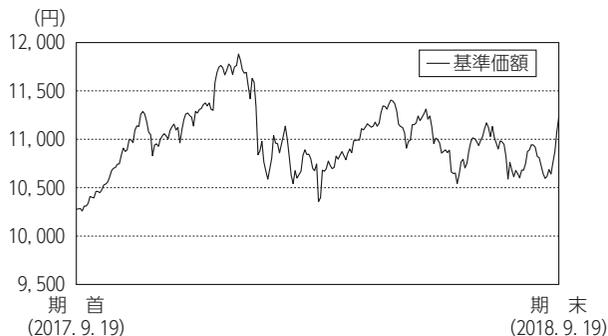
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		TOPIX (ベンチマーク)		株式組入率	株式先比率
	円	%	騰落率	騰落率		
(期首)2017年9月19日	10,279	—	1,667.88	—	99.2	0.7
9月末	10,401	1.2	1,674.75	0.4	98.7	1.2
10月末	10,965	6.7	1,765.96	5.9	98.3	1.7
11月末	11,130	8.3	1,792.08	7.4	98.7	1.3
12月末	11,300	9.9	1,817.56	9.0	98.8	1.1
2018年1月末	11,419	11.1	1,836.71	10.1	99.0	1.0
2月末	10,999	7.0	1,768.24	6.0	98.9	1.0
3月末	10,775	4.8	1,716.30	2.9	98.0	2.0
4月末	11,160	8.6	1,777.23	6.6	98.5	1.5
5月末	10,979	6.8	1,747.45	4.8	98.3	1.7
6月末	10,887	5.9	1,730.89	3.8	99.4	0.6
7月末	11,028	7.3	1,753.29	5.1	99.3	0.7
8月末	10,917	6.2	1,735.35	4.0	98.7	1.3
(期末)2018年9月19日	11,233	9.3	1,785.66	7.1	99.4	0.5

(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。

(注3) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,279円 期末：11,233円 騰落率：9.3%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、米国の2017年内の利上げ観測が高まり円安米ドル高となったことや、北朝鮮に関わる地政学リスクが後退したこと、2017年10月に行なわれた衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどを受け、上昇しました。その後も、堅調な国内企業業績や、米国税制改革法案の議会審議の進展および同法の成立が好感され、株価は上昇しました。しかし、2018年2月に米国の長期金利が急上昇したこと、また3月に米国が新たな関税を課す方針を示し貿易摩擦激化への懸念が高まったことにより、株価は下落しました。4月以降は、米国の保護主義的な政策への警戒感が強まる一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったことや、通商問題でも一部で妥協を探る動きなどがあり、株価は横ばい圏で推移しました。

◆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、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おります。

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（TOPIX）の騰落率は7.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は9.3%となりました。

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

・その他、ファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、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》

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おります。

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1)株 式

(2017年9月20日から2018年9月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 6,468.2 (△14,470.792)	千円 12,332,268 (4,050)	千株 4,564.308	千円 8,568,987

(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

(2017年9月20日から2018年9月19日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 21,688	百万円 22,128	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。

(3)新株予約権証券

(2017年9月20日から2018年9月19日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証 券 (8,100)	千円 (—)	証 券 (8,100)	千円 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2017年9月20日から2018年9月19日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	当 期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
トヨタ自動車	千株 46.9	千円 331,369	円 7,065	日本電信電話	千株 54.8	千円 295,545	円 5,393
日本郵政	185	245,470	1,326	三菱UFJフィナンシャルG	357.1	266,264	745
キーエンス	3.8	238,821	62,847	KDDI	55.5	168,217	3,030
シャープ	58	216,609	3,734	三井住友フィナンシャルG	31.7	141,402	4,460
リクルートホールディングス	53.8	153,491	2,853	ブリヂストン	29.1	134,397	4,618
東海旅客鉄道	7.1	150,925	21,257	ソニー	27.7	118,646	4,283
ソフトバンクグループ	15.7	138,763	8,838	野村ホールディングス	174.8	113,838	651
ソニー	24.2	135,990	5,619	ファナック	4.5	112,698	25,044
S Gホールディングス	52.9	129,706	2,451	トヨタ自動車	15.8	109,729	6,944
三菱UFJフィナンシャルG	187	126,788	678	信越化学	9.6	106,932	11,138

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円
東洋紡	231	22.1	41,680		大阪ソーダ	25	6.9	20,769		関西ペイント	61.6	64	134,080	
ユニチカ	186	19.4	13,696		関東電化	12.6	16.1	18,740		中国塗料	15.8	18.8	22,842	
富士紡ホールディングス	3.3	3.9	12,850		デンカ	111	22.2	84,582		日本特殊塗料	5	4.9	12,245	
倉敷紡績	60	63	18,900		信越化学	105.3	100.9	992,149		藤倉化成	9.8	15	9,945	
シキボウ	69	6.8	8,996		日本カーバイド	36	3.6	6,271		太陽ホールディングス	4.8	4.5	19,507	
日本毛織	15.5	18.9	17,406		堺化学	20	4.7	13,004		D I C	23	25.5	99,832	
ダイドーリミテツド	20.8	—	—		エア・ウォーター	46.8	49	99,764		サカダイニング	12.4	13.1	18,733	
帝国繊維	6.6	7.2	20,095		太陽日酸	44.5	47.8	79,778		東洋インキSCホールディン	47	11.2	33,308	
帝人	46.8	48.5	107,330		日本化学工業	31	2.8	10,136		T & K T O K A	5.3	6.4	7,545	
東レ	423.5	442.2	383,210		日本パーカライジング	29.6	30.2	45,481		富士フィルム HLDGS	114.8	121.1	618,699	
サカイ オーベックス	3.8	3.4	8,003		高圧ガス	9.2	11	10,197		資生堂	105.1	116.6	924,404	
住江織物	22	2.8	8,988		四国化成	9	9.8	15,523		ライオン	78.9	81.7	200,736	
アツギ	76	8.9	10,475		戸田工業	17	2.4	6,818		高砂香料	4	3.8	15,371	
ダイニック	—	8.3	7,810		ステラケミファ	3.1	3.6	13,986		マダモ	5.8	11.1	38,850	
セーレン	15.5	14.4	27,273		保土谷化学	2.3	2.5	8,000		ミルボン	4.1	7.4	36,889	
ソトー	6.8	12.8	12,940		日本触媒	9.1	9.6	81,216		ファンケル	13.2	14.5	75,400	
東海染工	51	6.3	8,719		大日精化	24	4.8	16,608		コーセー	9.6	10	201,600	
小松精練	10.6	11.5	11,891		カネカ	76	80	84,880		シーエーホールディングス	8.1	7.4	29,489	
ワコールホールディングス	33	16.1	52,888		三菱瓦斯化学	54.9	49.9	117,514		ポーラ・オルビス HD	24.8	25.2	95,886	
ホギメディカル	3.6	8	31,400		三井化学	265	54.7	155,238		ノビアホールディングス	4.2	3.7	22,940	
T S I ホールディングス	25.4	21.2	16,408		J S R	58.4	61.5	130,810		エステー	—	4.7	9,771	
三陽商会	4.4	4.4	9,130		東京応化工業	10.9	9.5	31,872		コニシ	9.5	10.8	19,256	
オワードホールディングス	37	36.5	26,608		大阪有機化学	6.6	7	9,429		長谷川香料	7.3	7.4	17,345	
ゴールドウイン	2.6	3.7	27,454		三菱ケミカル HLDGS	395.1	407.7	411,980		星光 P M C	4.4	—	—	
デサント	13.5	14.4	32,774		K H ネオケム	—	9.2	40,066		小林製薬	15.9	16.5	135,300	
パルプ・紙 (0.3%)					ダイセル	78.8	80.7	107,411		荒川化学工業	5.6	6.2	11,792	
特種東海製紙	3.1	3.3	15,097		住友ベークライト	51	50	52,550		メック	6.3	5.2	9,427	
王子ホールディングス	223	258	210,528		積水化学	129.3	123.8	249,333		日本高純度化学	4.3	5.3	12,820	
日本製紙	25.6	25	50,800		日本ゼオン	50	51	60,129		タカラバイオ	17.1	15.8	46,673	
三菱製紙	11.2	14.1	9,122		アイカ工業	18.2	17.1	77,634		J C U	4.3	7.6	19,744	
北越コーポレーション	32.9	31.7	20,256		宇部興産	295	30.3	86,445		新田ゼラチン	8.2	12.7	10,718	
中越パルプ	26	4.9	7,879		積水樹脂	8.4	9.6	20,275		デクセラリアルズ	16	15.9	18,380	
巴川製紙	24	—	—		タキロンシーアイ	13	15.1	9,845		アース製薬	4.3	4.3	22,102	
大王製紙	23	23.1	38,115		旭有機材	31	5	13,295		北興化学	12.9	12.8	7,539	
レンゴー	53.4	59.7	55,640		日立化成	32.4	29	62,988		大成ラミック	3.3	—	—	
トーモク	19	4.3	8,845		ニチパン	7	3.5	9,019		クミアイ化学	26.3	25	19,500	
ザ・バック	4.4	4.4	15,730		リケンテクノス	13.6	16.1	9,450		日本農薬	15.6	14.8	12,002	
化学 (7.4%)					大倉工業	18	3.4	7,422		アキレス	5.1	5.4	12,722	
クラレ	98	93.3	153,198		積水化成成品	8.9	9.1	10,028		有沢製作所	12.7	11.6	11,368	
旭化成	365	382.6	646,594		群栄化学	1.9	2.5	8,525		日東電工	42.2	43.9	373,852	
共和レザー	6.2	9.8	9,770		タイガース ポリマー	6.2	—	—		レック	4.5	3.7	20,535	
昭和電工	39.8	38.5	207,900		ダイキョーニシカワ	10.4	11.9	16,160		きもと	22.5	—	—	
住友化学	430	445	287,025		竹本容器	—	2.4	7,668		藤森工業	4.9	4.9	18,081	
住友精化	2.6	2.6	15,548		日本化薬	37	38.1	50,177		前澤化成工業	8.7	—	—	
日産化学	31.7	35.6	213,600		カーリットホールディングス	16.1	8	8,024		ジェイ エス ピー	3	3.8	10,731	
ラサ工業	57	3.7	8,513		日本精化	8.3	7.7	10,456		エフビコ	5.3	4.9	34,545	
フレハ	4.3	5.4	42,930		扶桑化学工業	4.8	6.2	17,031		天馬	3.7	5.2	10,634	
テイカ	11	5.5	13,915		A D E K A	22.8	25.2	48,157		信越ポリマー	12.5	12.1	11,083	
石原産業	11.6	12.3	19,741		日油	45	23.9	87,474		東リ	23.6	24.6	8,905	
日東エフシー	6	—	—		ハリマ化成グループ	—	7.1	6,972		ニフコ	10.1	20.8	64,272	
日本曹達	35	42	28,770		花王	137.6	143.2	1,296,676		日本バルカー	5.4	5.2	16,172	
東ソー	171	87.2	150,158		第一工業製薬	19	14	9,842		ユニ・チャーム	118.7	124.2	476,307	
トクヤマ	94	18.1	55,657		三洋化成	3.2	3.7	20,535		医薬品 (5.1%)				
セントラル硝子	57	12.7	36,703		大日本塗料	37	8.8	11,528		協和発酵キリン	70	72.7	152,451	
東亜合成	33.2	34.2	43,878		日本ペイント HOLD	45.7	47.4	204,057		武田薬品	219.7	215.2	1,008,427	

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円
アステラス製薬	572.7	574.7	1,153	135	三ツ星ベルト	14	16	22,480		シンニッタン	8.8	17.3	8,753	
大日本住友製薬	40.3	44	106,788		バンドー化学	9.2	11.3	14,565		非鉄金属 (0.8%)				
塩野義製薬	74.3	82.2	593,155		ガラス・土石製品 (1.0%)					大紀アルミニウム	15	12.7	9,588	
田辺三菱製薬	68.5	70.6	132,022		日東紡績	48	9	24,291		日本軽金属HD	146.2	166.6	41,150	
あすか製薬	6.7	7.9	11,368		AGC	57.1	58.2	275,286		三井金属	163	15.5	47,740	
日本新薬	13.7	15.5	107,415		日本板硝子	25.9	30	36,390		東邦亜鉛	37	3.5	14,175	
中外製薬	59	61.3	427,874		日本山村硝子	41	59	11,033		三菱マテリアル	36.4	37.2	120,714	
科研製薬	10.9	10.4	61,048		日本電気硝子	24.3	25.2	87,318		住友鉱山	152	73.9	279,785	
エーザイ	72.2	70.2	740,259		住友大阪セメント	109	110	53,570		DOWAホールディングス	64	14.2	49,416	
ロート製薬	28.9	32.4	123,606		太平洋セメント	356	36.7	126,548		古河機金	92	9.9	16,186	
小野薬品	133.4	138.2	425,656		日本ヒューム	10.3	10.3	10,547		大阪チタニウム	7.4	7.1	12,602	
久光製薬	16.4	17.3	149,472		日本コンクリート	17.5	25	8,975		東邦チタニウム	11.5	12.1	15,088	
持田製薬	3.6	3.8	33,630		アジアパイルHD	10.8	10.8	8,683		UACJ	83	8.7	23,542	
参天製薬	105.8	110.4	195,960		東海カーボン	53	54.7	112,900		古河電工	19.9	19.1	71,434	
扶桑薬品	2.7	4	11,688		日本カーボン	3.3	3.1	22,382		住友電工	219.6	213.7	384,446	
日本ケミファ	1.6	2.2	10,395		東洋炭素	4	4	12,960		フジクラ	78	67.3	40,649	
ツムラ	20.1	20.8	83,824		ノリタケ	3.6	3.5	24,605		昭和電線 HLDGS	96	11.2	8,680	
日医工	13.6	14.3	23,637		TOYO	42.9	45.3	221,743		タツタ電線	15	13.8	8,376	
キッセイ薬品工業	10.2	9.8	33,369		日本碍子	73.1	68.7	124,072		リョービ	34	7.5	32,137	
生化学工業	10.9	12.2	20,752		日本特殊陶業	50.2	49.4	162,773		アーレステイ	8	9.6	8,131	
栄研化学	5.2	9.9	25,245		MARUWA	2.4	2.2	16,742		アサヒHD	8.7	10.5	22,018	
日水製薬	4.2	—	—		品川リフラクトリーズ	16	2.3	10,465		金属製品 (0.6%)				
鳥居薬品	3.9	3.4	9,050		黒崎播磨	16	1.4	12,208		稲葉製作所	4.3	—	—	
JCRファーマ	4.8	4.4	25,036		ニッカトール	—	4.6	5,819		宮地エンジニアリング	24	2.8	8,089	
東和薬品	2.8	3	23,700		フジインコーポレーテッド	5.4	5.7	16,929		トーカロ	4.3	17.1	20,417	
富士製薬工業	2.7	4.5	7,911		ニチアス	32	33	49,632		アルファCO	—	3.4	4,875	
沢井製薬	9.6	11.6	69,136		ニチハ	8.4	9	27,675		SUMCO	52	64.1	107,303	
ゼリア新薬工業	12.5	13	31,928		鉄鋼 (1.1%)					川田テクノロジーズ	1.4	1.4	8,666	
第一三共	171.8	167.7	768,066		新日鐵住金	263.1	256.5	592,643		東洋製罐グループHD	39.3	36.6	84,875	
キョーリン製薬HD	13.6	15.2	35,796		神戸製鋼所	101.1	104	99,424		ホッカンホールディングス	18	20	8,960	
大幸薬品	4.5	4.4	8,544		中山製鋼所	6.4	9	6,417		横河ブリッジHLDGS	10.5	11.3	27,538	
ダイト	3.9	4.1	13,694		合同製鐵	3.9	3.9	9,161		駒井ハルテック	2.5	4.3	10,148	
大塚ホールディングス	116.3	111.4	603,008		JFEホールディングス	159.8	155.5	388,283		三和ホールディングス	57.5	55.7	78,258	
大正製薬HD	12.1	13.2	177,540		日新製鋼	18.2	16.2	26,114		文化シャッター	15.9	18.6	15,624	
ペプチドリーム	22.5	27.2	114,784		東京製鐵	31.7	31.6	27,049		三協立山	8.4	8.4	12,129	
石油・石炭製品 (0.9%)					共英製鋼	6.6	6.8	14,470		アルインコ	6.4	8.7	9,274	
日本コークス工業	65.3	58.3	6,646		大和工業	11.3	12.2	40,199		LIXILグループ	82	84.8	192,241	
昭和シエル石油	51.5	55.9	135,669		東京製鋼	18	5	8,315		日本フィルコン	—	13.5	7,843	
ニチレキ	9.2	8.6	10,689		大阪製鐵	3.6	3.9	8,821		ノーリツ	11.9	12.2	21,411	
ユシロ化学	4.7	4.8	7,444		淀川製鋼所	7.6	7.1	19,283		長府製作所	5.7	5.9	15,133	
ピーピー・カストロール	—	2.9	4,587		東洋鋼板	16	—	—		リンナイ	10	10.2	85,170	
富士石油	18.9	18.2	8,208		丸一鋼管	18.7	20.5	71,442		岡部	11.6	13.4	14,579	
MORESCO	4.2	5.2	8,684		大同特殊鋼	99	9.8	52,626		ジーテクト	6.1	7	12,873	
出光興産	36.5	49.3	302,209		日本高周波	64	8	6,176		東プレ	10.9	10.5	29,830	
JXTGホールディングス	889.3	932.5	778,637		日本冶金工	56.8	54.3	17,864		高周波熱錬	11.2	12.3	13,542	
コスモエネルギーHLDGS	17.7	17.3	76,293		山陽特殊製鋼	36	6.9	17,857		東京製鋼	4.8	5.4	7,927	
ゴム製品 (0.7%)					愛知製鋼	3	2.7	11,286		パイオラックス	9.5	8.9	20,923	
横浜ゴム	32.5	32.3	77,003		日立金属	59.8	61.4	83,565		エイチワン	—	6.6	8,976	
東洋ゴム	33.8	29.8	59,480		日本金属	—	2.8	4,564		日本発条	52.9	56.4	67,116	
ブリヂストン	197.7	179.3	761,128		大平洋金属	43	4	15,020		立川プラインド	—	4.8	5,697	
住友ゴム	54.4	50.9	85,461		新日本電工	37.5	39.6	11,206		三益半導体	5.8	5.3	9,216	
藤倉ゴム	10.7	12.1	6,957		栗本鉄工所	3.1	4.3	7,963		機械 (5.2%)				
オカモト	19	21	25,788		日本製鋼所	25	—	—		日本製鋼所	19	19.4	54,145	
ニッタ	5	5.7	23,626		三菱製鋼	46	5.2	11,128		三浦工業	23.9	25.3	86,273	
住友理工	9.4	9.8	10,897		日本精線	—	1.7	7,012		タクマ	19.7	19.8	28,195	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
ツガミ	18	17	19,295		小森コーポレーション	14.3	13.7	19,234		三菱重工業	932	96.8	402,978	
オークマ	38	6.5	40,300		鶴見製作所	4.9	5.5	10,202		IHI	432	44.8	198,688	
東芝機械	31	34	17,510		住友精密	19	24	9,456		スター精密	10.1	10.2	20,236	
アマダホールディングス	77.2	85.2	99,428		酒井重工業	—	1.6	5,592		電気機器 (13.4%)				
アイダエンジニア	16.1	14.1	14,029		荏原製作所	26.1	26	101,400		日清紡ホールディングス	28.1	36.9	48,634	
滝澤鉄工所	56	4.3	7,456		西島製作所	6.4	7.4	8,251		イビデン	39.1	34.6	55,740	
FUJI	18.5	17.4	32,016		北越工業	10	8.4	10,861		コニカミノルタ	129.2	135.3	160,195	
牧野フライス	30	29	28,304		ダイキン工業	76.3	80	1,248,400		ブラザー工業	68.8	70.1	158,005	
オーエスジー	24.4	27.8	69,805		オルガノ	16	2.8	9,422		ミネベアミツミ	103.3	108.3	232,086	
旭ダイヤモンド	16.7	19.1	15,108		トーヨーカネツ	31	3	9,030		日立	1,342	1,399	1,045,332	
DMG森精機	30.9	35.6	66,429		栗田工業	31.3	31	100,130		三菱電機	595	582.7	889,491	
ソデイツク	16.6	13.2	13,186		椿本チエイン	31	33	33,528		富士電機	167	177	163,902	
ディスコ	7	7.9	153,734		アネスト岩田	10.8	11.1	12,975		東洋電機製造	3.8	4.3	7,086	
日東工器	3.4	4	10,352		ダイフク	28.3	30	165,300		安川電機	65.2	68.2	238,700	
パンチ工業	—	7.4	5,920		加藤製作所	3.6	3.4	11,815		シンフォニアテクノロジー	42	41	15,375	
豊和工業	—	4.9	4,552		油研工業	36	3.1	6,993		明電舎	51	49	18,620	
OKK	59	5.6	6,081		タダノ	29.8	27.7	35,040		オリジン電気	—	3.6	6,321	
石川製作所	—	2.4	3,645		フジテック	16.2	17.4	25,752		山洋電気	16	2.9	15,892	
東洋機械金属	—	9.7	7,236		CKD	17.4	16.7	24,048		デンヨー	5.6	5.9	10,791	
島精機製作所	8	7.4	37,518		キトー	8.1	5.2	10,498		東芝テック	35	41	28,331	
オプトロン	—	5.9	18,939		平和	17.1	18	48,654		芝浦メカトロニクス	19	—	—	
フリユー	4.5	—	—		理想科学工業	5.5	6.2	16,622		マブチモーター	15.4	15.5	66,650	
ヤマシンフィルタ	—	10.4	9,661		SANKYO	14.3	14	63,070		日本産産	72.6	70.4	1,161,600	
日阪製作所	9.3	10.1	11,705		日本金銭機械	6.5	6.5	8,268		東光高岳	3.8	4.2	7,345	
やまびこ	11.3	11.4	15,481		マースエンジニアリング	3.5	3.8	8,994		ダブル・スコープ	8.4	9.6	9,350	
平田機工	—	2.3	19,918		福島工業	3.7	3.8	20,368		ダイヘン	32	33	19,965	
ペガサスマシン製造	9.6	—	—		ダイコク電機	3.3	3.8	6,916		田淵電機	16	—	—	
ナブテスコ	30	31.5	92,767		竹内製作所	10.7	9.8	29,596		ヤーマン	—	9.2	19,761	
三井海洋開発	6.1	6.3	22,680		アマノ	17.1	18.1	43,983		JVCケンウッド	43.9	49.1	15,417	
レオン自動機	6.9	6.2	12,226		JUKI	8.9	9.2	12,052		第一精工	—	3.6	5,749	
SMC	17.6	18.4	665,344		サンデンホールディングス	41	8.3	12,740		日新電工	11.4	13.4	13,681	
新川	8.2	—	—		蛇の目マシン	7.5	—	—		大崎電気	12	14.4	12,600	
ホソカワミクロン	2.6	2.3	14,329		マックス	10	9	14,850		オムロン	59.4	61.5	307,192	
ユニオンツール	2.9	2.9	11,817		グローリー	17.1	16.8	46,687		日東工業	7.6	10.6	21,327	
オイレス工業	6.6	7.8	18,392		新晃工業	6.2	6.9	12,081		IDEC	9.6	8.1	19,116	
日精エーエスピー	—	1.9	9,424		大和冷機工業	10.2	9	11,349		ジーエス・ユアサコーポ	106	104	57,928	
サトーホールディングス	7.7	8.1	29,524		セガサミーホールディングス	55.3	57.5	101,717		サクサホールディングス	28	—	—	
技研製作所	—	4.9	14,116		日本ピストンリング	4	4.5	10,345		メルコホールディングス	3.3	3.1	12,989	
日精樹脂工業	6.5	6.8	7,854		リケン	2.8	2.8	17,388		日本電通	762	74.6	228,276	
小松製作所	270.6	282.1	925,852		TPR	6.4	6.4	18,220		富士通	541	601	489,574	
住友重機械	170	32.8	127,920		ツバキ・ナカシマ	6.3	9.2	20,102		沖電気	23.9	22.3	32,112	
日立建機	26.2	27.2	95,880		ホシザキ	17.7	17.2	187,824		電気興業	17	4.1	13,714	
巴工業	4.8	4.3	9,546		大豊工業	5.2	5.9	7,487		サンケン電気	34	36	20,664	
井関農機	5.5	6.1	12,261		日本精工	115.6	118.3	150,004		アイホン	4.2	5.7	9,621	
TOWA	5.6	5.9	6,165		NTN	129	128	58,880		ルネサスエレクトロニクス	31	61.9	47,786	
丸山製作所	4.6	3.8	6,623		ジェイテクト	57.6	60.2	98,186		セイコーエプソン	83.7	85.6	167,262	
北川鉄工所	3.4	3.9	11,380		不二越	53	5.5	30,360		ワコム	44.7	47.6	24,038	
ローツェ	3.3	3.4	7,680		日本トムソン	20.1	21	15,897		アルバック	9.7	13.5	57,037	
クボタ	301.6	312.7	577,869		THK	39.6	36.5	106,397		アクセル	4.9	—	—	
三菱化工機	36	4.3	7,942		ユーシン精機	3.3	6.5	7,839		EIZO	5.8	5.5	27,445	
月島機械	10.8	11.7	17,409		イーグル工業	6.3	6.7	9,976		ジャパンディスプレイ	108.2	124.6	17,070	
帝国電機製作所	6.6	6.5	11,342		日本ビラー工業	7	7.3	11,526		日本信号	15.4	16.2	18,419	
新東工業	14.2	13.3	14,882		キッツ	28.8	25.3	24,389		京三製作所	20	16.7	10,187	
渋谷工業	5.3	5.6	23,744		マキタ	73.1	76	405,840		能美防災	6.5	8.6	21,310	
アイチコーポレーション	9.7	9.9	6,385		日立造船	42.6	42	19,362		ホーチキ	5.1	5.4	8,969	

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
エレクトロコム	5.2	5.8	16,622		ウシオ電機	32.7	32.3	49,515		日産車体	23.9	22.2	23,998	
日本無線	3.5	—	—		ヘリオステクノH	—	8.3	7,868		新明和工業	22.7	25.6	35,916	
パナソニック	642.1	665.8	897,165		日本セラミック	6.2	6.1	18,068		極東開発工業	11.8	11.5	19,849	
シャープ	—	58	140,128		速藤照明	4.2	—	—		日信工業	12	11.6	21,599	
アンリツ	42.1	43.3	79,628		古河電池	8	7.5	6,495		トビー工業	4.7	4.9	15,680	
富士通ゼネラル	19.5	18.2	34,798		山一電機	6.3	5.2	8,216		ティラド	25	2.6	7,813	
日立国際電気	14.7	—	—		図研	5.6	4.8	8,856		曙ブレーキ	29.2	34.9	8,794	
ソニー	395.2	391.7	2,617,339		日本電子	21	23	27,968		日本電子	9.8	10.4	18,824	
TDK	31.1	30.7	374,233		カシオ	44.5	46.9	87,234		NOK	26.7	28.7	57,199	
帝国通信工業	30	6.9	8,907		ファナック	56.7	55.5	1,230,435		フタバ産業	18.9	18.7	13,912	
タムラ製作所	25	24.7	18,302		日本シイエムケイ	13.5	11.7	9,792		K Y B	64	6	27,360	
アルプス電気	51.8	50.3	156,684		エンプラス	2.6	2.9	9,091		大同メタル工業	7.4	9.4	8,883	
池上通信機	—	48	6,672		大真空	—	4.1	5,592		プレス工業	30.1	33.1	19,363	
パイオニア	83.3	118.6	12,690		ローム	27.2	26.2	211,696		太平洋工業	13.4	12.9	24,316	
日本電波工業	7.4	12.8	6,464		浜松ホトニクス	39.8	41.7	176,808		ケーシン	11.6	13.3	30,869	
日本トリム	1.4	1.7	9,979		三井ハイテック	8.6	8.5	12,826		河西工業	8.5	8.1	9,784	
ローランドディー・ジー	3.5	3.6	9,558		新光電気工業	22.4	22.1	20,928		アイシン精機	51.4	48.2	257,388	
フォスター電機	6.9	7.7	10,980		京セラ	91.3	95.7	633,438		マツダ	175.6	179.4	237,256	
クラリオン	31	35	11,375		太陽誘電	27	28.8	80,956		今仙電機製作所	8.1	8.3	9,669	
S MK	17	20	6,460		村田製作所	58.7	61.3	1,099,722		本田技研	502	524.5	1,774,383	
YOCO	6.3	5.2	7,420		ユーシン	13.5	15.5	11,888		ズブキ	111.3	116.2	825,136	
ホシデン	17.2	15.1	16,610		双葉電子工業	8.4	9.2	18,694		SUBARU	173.8	181	591,689	
ヒロセ電機	9	9.4	119,850		北陸電気工業	45	5.4	6,755		安永	—	3.5	6,968	
日本航空電子	16	15	29,820		ニチコン	18.6	18.9	20,997		ヤマハ発動機	79.2	82	240,014	
TOA	7	8.5	11,203		日本ケミコン	51	5	15,725		ショーワ	15.9	15.9	26,664	
マクセルホールディングス	8.5	11.5	20,987		K O A	8.9	8.5	16,966		T B K	20	20.8	10,400	
古野電気	8.8	8.3	11,927		市光工業	15	10.4	9,412		エッセディ	7.6	6.7	24,924	
ユニデンホールディングス	30	23	6,578		小糸製作所	33.6	35.2	254,848		豊田合成	17.1	20.8	57,907	
アルパイン	14.1	13.9	32,178		ミツバ	10.6	11.4	11,058		愛三工業	10	11.1	10,567	
スミダコーポレーション	6.4	6	8,352		SCREENホールディングス	11.5	11.2	81,872		ヨロズ	5.2	6.9	11,874	
アイコム	3.5	3.8	9,659		キヤノン電子	6.1	4.6	10,842		エフ・シー・シー	9.2	9.8	32,830	
リオン	3.4	3.7	8,635		キヤノン	299.5	312.6	1,110,667		シマノ	22.6	23.6	438,488	
本多通信工業	—	7.3	6,146		リコー	166.8	175.8	209,377		テイ・エス・テック	12.5	13.5	52,852	
船井電機	6.3	10	6,780		象印マホービン	—	11.5	18,526		ジャムコ	3.5	3.2	9,856	
横河電機	60.3	58.2	136,711		東京エレクトロン	37.5	39.1	640,067		精密機器 (1.8%)				
新電元工業	25	2.2	11,286		輸送用機器 (8.5%)					テルモ	85.3	89.9	587,047	
アズビル	16.6	17.3	83,213		トヨタ紡織	19.2	16.6	33,847		日機装	20	19.3	25,456	
日本光電工業	23	24.4	84,424		ユニプレス	10.5	10.9	23,980		島津製作所	71.9	70.2	233,766	
共和電業	16.8	20.1	8,562		豊田自動織機	51	46.6	302,434		J M S	22	—	—	
堀場製作所	10.8	11.7	75,582		モリタホールディングス	10.4	9.7	22,843		長野計器	—	7.5	8,565	
アドバンテスト	38.6	33.1	79,638		三桜工業	10.3	11.7	8,377		ブイ・テクノロジー	1.2	1.4	24,010	
エスベック	5.6	6.1	13,291		デンソー	137.6	129.6	739,627		東京計器	29	5.2	6,011	
キーエンス	25.4	28.7	1,818,719		東海理化電機	13.7	14.8	35,653		東京精密	10.7	10.2	29,804	
日置電機	3.2	3.5	12,407		三井 E&SHD	197	21.1	42,727		マニー	7	7.4	38,258	
シスメックス	43.5	45.6	452,808		川崎重工業	429	44.2	139,893		ニコン	96.1	101.1	216,556	
日本マイクロニクス	10.7	11.2	8,971		名村造船所	18.4	19.2	10,464		トプコン	28.4	30.8	58,212	
メガチップス	5.6	5.2	11,611		日本車輻	26	27	8,100		オリンパス	89	86.7	387,982	
OBARA GROUP	3.5	3.3	17,985		三菱ロジスネクスト	—	7.9	10,530		理研計器	5.9	6.1	15,109	
コーセル	8.6	8.8	11,184		日産自動車	658.9	688.4	747,946		タムロン	4.2	5.9	13,770	
イリソ電子工業	4.8	4.9	29,547		いすゞ自動車	161.7	169.6	297,139		HOYA	115	117.7	777,761	
オプテックスグループ	4.8	10.9	23,958		トヨタ自動車	679.3	710.4	4,986,297		ノーリツ鋼機	6.7	6.7	18,451	
千代田インテグレ	2.9	3.2	7,532		日野自動車	80.6	82.4	101,846		エー・アンド・デイ	13.1	8.2	7,412	
レーザータック	13.4	12.6	47,880		三菱自動車工業	206	215.7	169,540		シチズン時計	58	66.7	49,558	
スタンレー電気	39.7	44.3	169,004		エフテック	5	6	7,476		リズム時計	39	5	10,185	
岩崎電気	33	4.7	7,322		武蔵精密工業	6.9	6.6	24,816		大研医器	7.1	—	—	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
メニコン	3.9	8.6	22,557	—	沖繩電力	9.8	12.4	29,338	—	NS ユナイテッド海運	29	2.9	7,189	—
松風	4.4	—	—	—	電源開発	44.2	46	138,000	—	飯野海運	29	30.1	17,999	—
セイコーHD	38	9.4	29,422	—	イーレックス	8.2	10.8	10,929	—	空運業 (0.6%)	—	—	—	—
ニプロ	38.6	40.4	62,498	—	東京瓦斯	602	123.2	341,387	—	日本航空	97.9	101.3	413,405	—
その他製品 (2.1%)	—	—	—	—	大阪瓦斯	544	112	244,272	—	ANA ホールディングス	1,039	107.4	423,693	—
パラマウントベッドHD	5.2	6	31,020	—	東邦瓦斯	137	29.1	118,582	—	倉庫・運輸関連業 (0.2%)	—	—	—	—
SHO - B I	—	14	5,586	—	北海道瓦斯	26	34	10,540	—	トラコンコム	1.8	1.8	13,860	—
ニホンフラッシュ	4.5	3.6	8,244	—	広島ガス	20.6	—	—	—	日新	28	5.2	13,072	—
前田工織	7.7	8.1	17,188	—	西部瓦斯	58	7.2	18,957	—	三菱倉庫	34	18.9	53,052	—
永大産業	15	—	—	—	静岡ガス	13.9	20.2	19,149	—	三井倉庫 HOLD	38	38	15,048	—
アートネイチャー	8	10.7	7,607	—	メタウォーター	3.3	3.4	10,472	—	住友倉庫	35	37	29,230	—
ダンロップスポーツ	4.1	—	—	—	陸運業 (4.3%)	—	—	—	—	渋沢倉庫	30	5.7	9,712	—
パンダダイナムコHLDGS	61.9	60.5	274,670	—	SBS ホールディングス	6.8	—	—	—	東陽倉庫	26.2	33.2	11,620	—
共立印刷	27.1	—	—	—	東武鉄道	294	61.5	209,407	—	日本トランスシティ	20	18.4	9,439	—
SHOE I	3.2	3.2	15,856	—	相鉄ホールディングス	85	18.3	67,801	—	東洋埠頭	50	8	13,584	—
フランスベッドHLDGS	4.3	—	—	—	東京急行	149.6	158.9	326,539	—	上組	66	32.9	80,177	—
パイロットコーポレーション	9.7	10.1	63,529	—	京浜急行	155	79.8	162,472	—	キューソー流通システム	2.1	2.6	7,573	—
萩原工業	2.6	5.4	9,487	—	小田急電鉄	88.6	87.5	236,775	—	郵船ロジスティクス	4.7	—	—	—
トッパン・フォームズ	8.9	12.4	13,702	—	京王電鉄	152	32.9	205,625	—	近鉄エクスプレス	10.2	10.3	22,690	—
フジールインターナショナル	12.8	13	51,155	—	京成電鉄	41.5	41.2	161,916	—	東海運	11.5	—	—	—
タカラトミー	22.5	25.6	29,312	—	富士急行	16	8.6	30,358	—	内外トランスライン	6.2	6.3	10,810	—
大建工業	4.6	5.4	12,366	—	新京成電鉄	14	—	—	—	情報・通信業 (8.0%)	—	—	—	—
凸版印刷	153	157	143,027	—	東日本旅客鉄道	108.3	104.2	1,111,814	—	NEC ネットエスアイ	5.8	6.1	15,878	—
大日本印刷	154	75.3	199,921	—	西日本旅客鉄道	53.9	52.4	409,401	—	システナ	5.3	19.9	30,685	—
共同印刷	19	3.3	9,438	—	東海旅客鉄道	46.4	52.5	1,221,675	—	デジタルアーツ	2.9	3.2	16,480	—
N I S S H A	10.1	12.4	26,746	—	西武ホールディングス	77.4	74.4	154,082	—	新日鉄住金 S O L	9.2	9.5	34,200	—
光村印刷	29	—	—	—	鴻池運輸	8.7	8.6	16,365	—	キューブシステム	—	9.2	8,675	—
宝印刷	5.7	7.2	13,485	—	西日本鉄道	61	16	49,840	—	コア	—	4.8	6,614	—
アシックス	55.1	57.6	94,752	—	ハマキョウレックス	4.1	4.6	18,791	—	ソフトクリエイトHD	5.3	5.7	9,900	—
ツツミ	2	—	—	—	サカイ引越センター	2.9	3.4	21,862	—	T I S	18.5	19.5	114,075	—
ヤマハ	37.8	38.6	225,038	—	近鉄グループHLDGS	547	54.2	244,171	—	電算システム	3.3	6.3	14,187	—
河合楽器	3.4	2.6	12,168	—	阪急阪神HLDGS	70	73.2	298,656	—	グリー	38.1	33.4	18,503	—
クリナップ	7.1	9.7	7,789	—	南海電鉄	116	26.2	77,080	—	コーエーテックモHD	13.1	9.6	21,763	—
ビジョン	34	35.5	215,485	—	京阪ホールディングス	123	24.6	105,534	—	三菱総合研究所	2.6	2.8	11,788	—
キングジム	8.2	9.5	9,338	—	神戸電鉄	22	—	—	—	ファインデックス	5.6	—	—	—
リントック	11.9	13.2	38,200	—	名古屋鉄道	199	44.1	120,348	—	K L a b	11.1	10.9	11,401	—
イトーキ	13.5	15.4	9,517	—	山陽電鉄	22	5.1	13,010	—	ポルトゥーグィン・ピットクル	5.8	5	14,925	—
任天堂	34.5	36.1	1,444,000	—	日本通運	205	21.5	159,745	—	ネクソン	61.3	146.2	203,656	—
三菱鉛筆	9.6	9.3	18,590	—	ヤマトホールディングス	100.2	97.7	329,542	—	アイスタイル	14.5	16.3	21,516	—
タカラスタンダード	10.6	12	23,784	—	山丸	74	14.2	86,052	—	エイチーム	5	5.2	10,103	—
コクヨ	26.5	27.9	55,716	—	丸全昭和運輸	21	22	12,364	—	テクノスジャパン	6.1	10	10,200	—
ナカバヤシ	21	12.6	8,416	—	センコーグループHLDGS	26.5	34.3	31,384	—	コロプラ	17.9	16.5	11,962	—
グローバルライド	3.6	3.5	10,832	—	トナミホールディングス	15	1.7	11,730	—	ブロードリーフ	15.3	31.2	20,966	—
オムロン	19.2	20.9	31,663	—	ニッコンホールディングス	17.8	19.7	58,607	—	デジタルハーツHLDGS	4.2	5.1	8,103	—
美津濃	30	6.1	17,641	—	福山通運	30	8.6	42,957	—	メディアドゥHLDGS	—	3	7,485	—
電気・ガス業 (1.7%)	—	—	—	—	セイノーホールディングス	38.8	41.8	71,687	—	ティアーガイア	5.7	6.1	18,544	—
東京電力HD	472.5	467.3	250,005	—	神奈川中央交通	8	—	—	—	豆蔵ホールディングス	7.2	7.9	7,378	—
中部電力	184.3	179.5	306,675	—	日立物流	11.3	12.3	39,052	—	テクマトリックス	4.6	—	—	—
関西電力	229.4	239.2	390,494	—	丸和運輸機関	1.7	3.4	13,821	—	ガンホー・オンライン・エンター	150.5	138	31,602	—
中国電力	74.4	78.9	114,720	—	九州旅客鉄道	56.1	46.1	159,045	—	GMO ペイメントゲートウェイ	4.2	5	69,500	—
北陸電力	51.8	56.7	67,019	—	SG ホールディングス	—	52.9	149,971	—	インターネットイニシアティブ	9.1	10.6	23,913	—
東北電力	139.9	136.4	206,236	—	海運業 (0.2%)	—	—	—	—	さくらインターネット	6	13.9	9,730	—
四国電力	50.5	52.6	81,004	—	日本郵船	469	45.2	95,598	—	SRA ホールディングス	3.5	3.7	12,691	—
九州電力	123.1	129	169,377	—	商船三井	292	34.2	108,072	—	システムインテグレータ	—	5.8	10,962	—
北海道電力	51.5	58.4	42,690	—	川崎汽船	208	24.9	55,950	—	朝日ネット	17.6	23	12,029	—

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
コムチュア	1.7	3.9	15,814		松竹	3.6	3.8	53,656		ドウシシャ	6.8	6.5	14,885	
gumi	7	9.5	5,956		東宝	36.1	37.8	134,001		小津産業	4	5.5	10,983	
アカツキ	—	1.8	6,282		東映	20	2.2	28,292		黒田電気	7.3	—	—	
LINE	15.8	18.2	89,726		NTTデータ	170.3	181.1	282,334		丸文	5.8	7	6,006	
AOI TYO HOLDINGS	—	7.9	11,486		DT S	6.3	6.3	27,909		ハビネット	5.8	5.3	10,070	
マクロミル	—	8.2	19,967		スクウェア・エニックス・HD	21.4	27	123,930		日本ライフライン	6.7	16.8	36,456	
野村総合研究所	41.5	37	213,860		シーイーシー	4.4	8	20,864		エクセル	4.2	3.5	6,520	
インテージホールディングス	3.9	9.6	9,561		カブコン	12.9	25.4	69,900		マルカキカイ	4	3.9	8,084	
クレスコ	—	2.1	6,741		ジャステック	5.8	8.1	9,655		I DOM	17	21	8,022	
フジ・メディア・HD	56.4	59.3	117,117		SCSK	15.5	13.7	73,295		進和	5.4	4.4	9,319	
オービック	19.2	18.5	194,435		アイネス	8.8	11.1	14,352		ダイトロン	—	4.1	9,110	
ジャストシステム	10.1	10	24,250		T K C	5.2	5.3	23,876		シーグス	3.6	7.4	14,866	
TDCソフト	5.4	—	—		富士ソフト	7.5	9.3	52,731		伊藤忠	405	422.7	884,499	
ヤフー	405.4	423.2	172,665		NSD	11.7	9.9	23,166		丸紅	546.1	472.9	471,670	
トレンドマイクロ	27	30.9	220,008		コナミホールディングス	25.3	23.1	98,868		高島	32	4.2	8,660	
日本オラクル	8.9	9.7	89,240		福井コンピュータHLDS	2.1	—	—		長瀬産業	30	32.3	62,532	
フューチャー	10.3	9.7	18,187		JBCCホールディングス	11.5	9.6	13,065		蝶理	4.8	4.3	8,819	
CAC HOLDINGS	6	8.8	9,706		ミロク情報サービス	6.4	5.7	14,004		豊田通商	61.9	62.8	256,852	
ソフトバンク・テクノ	4	—	—		ソフトバンクグループ	248.8	259.9	2,836,808		兼松	121	24.5	41,821	
オービックビジネスC	2.9	3.2	30,368		卸売業 (4.8%)					ツカモトコーポレーション	—	6.1	7,405	
伊藤忠テクノソリューションズ	12.9	26.8	66,785		エレマテック	2.3	2.9	7,531		三井物産	499	474	931,647	
アイティフォー	14.2	10.3	9,764		JALUX	—	2.5	7,040		日本紙パルプ	27	2.7	12,177	
大塚商会	16.8	31.6	129,402		あらた	3	3.1	16,988		日立ハイテクノロジーズ	19.3	19.8	79,299	
サイボウズ	14.2	15.4	9,979		東京エレクトロニクス	—	3.6	7,077		カメイ	7.6	7.2	10,627	
ソフトブレーン	8	—	—		フィールズ	4.4	5.7	5,266		OUGホールディングス	27	—	—	
電通国際情報S	4.2	4.1	16,523		双日	309.3	340.9	137,382		スターゼン	2.5	2.6	12,454	
デジタルガレージ	11.3	10.7	38,787		アルフレッサホールディングス	64.3	63.4	185,381		山善	20.6	22.1	29,591	
イーエムシステムズ	—	6.5	7,761		横浜冷凍	12.8	16.4	15,153		住友商事	344.9	361.5	678,354	
ウェザーニューズ	2.6	3.3	11,253		山下医科器械	4	—	—		内田洋行	3.2	3.3	9,824	
C I J	16.4	13.2	9,886		アルコニック	8.6	7.4	11,692		三菱商事	414.6	404.1	1,403,439	
WOWOW	3.4	3.2	11,536		神戸物産	3.9	4.5	24,570		第一実業	17	3.2	12,256	
ネットワンシステムズ	25.8	24.4	63,806		ペッパーフードサービス	—	4.8	19,032		キャノンマーケティングJPN	16	16.6	39,093	
アルゴグラフィックス	3.8	3.3	16,021		あいホールディングス	8.2	9.6	24,192		西華産業	22	4.2	8,404	
マーベラス	10.8	10	8,990		ディーブイエックス	5.4	5.7	8,082		菱洋エレクトロ	5.2	6	10,542	
エイベックス	10.5	11	17,050		ダイワボウHD	52	5.1	36,363		ユアサ商事	5.6	5.4	21,600	
日本ユニシス	15.7	17	46,954		マクニカ・富士エレクトロニクス	10.3	11	21,967		神鋼商事	2.6	2	6,300	
兼松エレクトロニクス	3.9	3.9	14,332		パイタルKSKHD	9.5	10.7	13,621		阪和興業	56	10.5	39,742	
東京放送HD	36.6	31.3	73,304		UKCホールディングス	4.6	4.1	11,057		正栄食品	—	3.4	11,798	
日本テレビHLDS	49.5	52	98,852		TOKAIホールディングス	25.1	31.6	34,602		カナデン	8.9	7.1	8,612	
テレビ朝日HD	14.9	15.3	32,787		三洋貿易	4.7	3.9	8,338		菱電商事	10	5.3	8,957	
スカパーJSATHD	33.2	44.2	24,398		ウイン・パートナーズ	6.3	5.4	7,014		岩谷産業	59	12.5	49,812	
テレビ東京HD	5.3	5.4	14,995		シップヘルスケアHD	10.2	11.6	47,502		すてきなイスグループ	45	8.1	10,481	
日本BS放送	—	5.9	7,864		コメダホールディングス	10.4	11.8	26,432		極東貿易	—	19	7,885	
ワイヤレスゲート	4.7	6.6	4,303		小野建	5.5	6	10,674		イワキ	—	13.3	6,889	
コネクシオ	5.5	4.7	9,874		佐島電機	8.5	7.5	7,342		三菱石油	15.1	14.6	20,483	
日本通信	56.9	65.2	11,540		伯東	5.3	4.3	6,819		稲畑産業	12.7	13.7	23,536	
日本電信電話	442.9	411	2,118,294		コンドーテック	7.7	10.4	11,263		ワキタ	12.8	12.9	17,969	
KDDI	537.9	505.4	1,561,686		ナガイレーベン	7.4	8.4	21,646		東邦ホールディングス	16.8	15.7	46,833	
光通信	6.7	7	150,990		三菱食品	5.5	5.8	17,603		サンゲツ	17.7	16.7	36,957	
NTTドコモ	405.7	411.6	1,254,968		松田産業	4.6	5.5	8,591		ミツウロコグループ	9.5	8.7	7,360	
エムティーアイ	10.3	12.4	7,898		第一興商	8.9	8.4	44,604		シナノンホールディングス	2.7	2.4	6,715	
GMOインターネット	21.9	22.1	41,702		メディアパルHD	55.1	56.2	128,417		伊藤忠エネクス	10.2	10.4	12,032	
カドカワ	16.3	17.4	21,001		萩原電気HLDS	3.5	2.9	9,657		サンリオ	16.4	16	35,856	
学研ホールディングス	3.2	—	—		アズワン	4.2	4.7	39,433		サンワテクノス	—	5.4	7,619	
ゼンリン	8	11	37,565		シモジマ	4.9	—	—		リョーサン	7.3	6.2	26,071	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
新光商事	6.9	7.3	12,278		スタートトゥデイ	49.4	57.1	190,428		ヴィア・ホールディングス	—	13.4	9,875	
トーヨー	3.2	4.5	9,418		物語コーポレーション	2	1.9	20,045		スクロール	12.7	16.6	11,321	
三信電気	6.9	5.9	11,853		ココカラファイン	5.8	6.1	44,408		ヨンドシーホールディングス	5.7	6	13,974	
東陽テクニカ	7.4	11.5	10,603		三越伊勢丹HD	110.4	107.5	145,232		ユニ・ファミリーマートHD	24.4	18.7	206,822	
モスフード サービス	7.2	7.2	21,348		ウエルシアHD	15.3	15.7	89,804		木曾路	6.7	7.4	20,283	
加賀電子	5.4	5.2	12,220		クリエイトSDH	8.1	8.7	24,142		SRSホールディングス	10.1	—	—	
PALTAC	9.3	8.3	49,966		丸善CHIHD	16.7	—	—		千趣会	13.6	14.4	6,292	
ヤマシタヘルスケアHLDGS	—	8.1	11,372		チムニー	1.3	—	—		タカキユー	—	35.6	7,298	
ヤマタネ	5.8	5.9	11,894		ジョイフル本田	9.2	16.5	28,908		ケーヨー	14.5	12.9	7,030	
丸紅建材リース	34	—	—		鳥貴族	3	2.9	6,556		上新電機	14	7	21,805	
日鉄住金物産	4.7	4.3	24,252		ホットランド	—	5.8	7,609		日本瓦斯	10.5	11.1	65,601	
トラスコ中山	11.7	12.5	38,062		すかいらーくHD	34	53	87,768		ロイヤルホールディングス	9.6	10.4	29,588	
オートバックスセブン	18.9	20.7	39,847		綿半ホールディングス	3.6	3.1	9,207		いなげや	6.9	6.7	11,678	
加藤産業	8	9	33,030		ユナイテッド・スーパーマーケット	18.9	20.2	27,896		島忠	13.5	13	47,190	
イノテック	9.9	6.5	8,599		ブックオフコーポレーション	11.7	—	—		チヨダ	6.3	6.9	15,055	
イエローハット	5.2	5.4	16,470		あさひ	4.9	6.4	9,625		ライフコーポレーション	4.2	4	11,200	
日伝	2.7	4.5	9,180		日本調剤	2.1	2.3	8,142		リンガーハット	6.7	7.9	19,220	
北沢産業	—	17.1	4,001		コスモス薬品	2.8	3	75,660		MrMaxHD	—	10.7	6,484	
因幡電機産業	6.5	7.1	34,222		一六堂	17.1	—	—		AOKIホールディングス	9.4	11.1	17,271	
パイテックホールディングス	—	3.4	8,884		セブン&アイ・HLDGS	231	241.3	1,230,630		オークワ	9	10	11,220	
ミスミグループ本社	64.2	67.1	199,622		薬王堂	3.6	2.8	10,626		コメリ	8.1	8.2	22,049	
スズケン	25	26	134,160		クリエイト・レストランツ・ホールディングス	17	16.5	22,308		青山商事	11.2	10.2	35,394	
ジェコス	5.5	6	7,062		ツルハホールディングス	11.2	12.6	164,808		しまむら	6.4	6.8	71,740	
小売業 (4.9%)					サンマルクホールディングス	3.6	4.1	11,037		高島屋	91	43.9	81,654	
ローソン	17.2	14.3	97,812		トリドールホールディングス	7.2	7.6	19,045		松屋	13.6	12.8	15,552	
サンエー	4.2	4.4	23,232		TOKYO BASE	—	7.2	4,312		エイチ・ツー・オーリテイリング	28.1	25.9	47,008	
カワチ薬品	4.6	4.8	10,704		ダイユー・リックHLDGS	9.4	6.2	7,260		近鉄百貨店	1.5	—	—	
エービーシー・マート	9.9	10.4	64,688		クスリのアオキHLDGS	4.6	4.7	39,151		丸井グループ	58.8	53.7	144,453	
ハードオフコーポレーション	5.3	8.3	8,175		スシローグローバルHLDGS	—	6.7	46,632		アクシアルリテイリング	4.4	5	20,075	
アスクル	6.1	5.1	17,034		LEXILEビバ	—	7.7	13,598		イオン	226	223.1	594,226	
ゲオホールディングス	8.8	10.9	17,450		総合メディカル	3	5.5	13,645		イズミ	10.3	10.5	78,855	
アダストリア	8.8	9.3	14,070		ノジマ	9.2	10.6	26,044		平和堂	10.6	11.7	35,568	
くらコーポレーション	3.3	3.6	26,676		カッパ・クリエイト	7.5	—	—		フジ	5.9	7.2	16,250	
キャンドウ	4.5	—	—		ライトオン	5.7	7.8	7,924		ヤオコー	6	6.7	46,029	
パルグループHLDGS	3.1	3.4	8,908		良品計画	7.4	7.7	257,950		ゼビオホールディングス	7	7	11,564	
エディオン	21	22.6	28,340		アドヴァン	6.9	7.4	7,518		ケーズホールディングス	22.8	51.2	70,707	
サーラコーポレーション	11.3	13.7	9,233		アルビス	2.2	2.5	7,662		GENKY DRUGSTORES	—	2.5	10,875	
ワッツ	5.2	7.2	6,760		コナカ	12	—	—		アインホールディングス	7.4	7.8	66,300	
ハローズ	2.1	3.6	9,633		コジマ	—	13.1	6,694		元氣寿司	3.2	2.4	15,576	
あみやき亭	1.8	2.2	9,680		コーナン商事	7.6	8.8	23,883		ヤマダ電機	186.5	193.6	108,803	
ひらまつ	14.7	16.2	7,338		ワタミ	7.2	8.2	10,979		アーケランドサカモト	9.7	10	15,150	
ゲンキー	2.5	—	—		ドンキホーテホールディング	36	37.6	207,928		ニトリホールディングス	24	23	387,665	
大黒天物産	1.6	1.9	8,521		西松屋チェーン	9.7	12.9	15,376		吉野家ホールディングス	20.3	20.2	39,046	
ハニーズホールディングス	6.9	10	10,400		ゼンショーホールディングス	29.2	30.5	72,224		松屋フーズ	3.1	3	10,815	
アルペン	3.8	4.4	8,866		幸楽苑ホールディングス	6.9	5.9	9,693		サガミチェーン	8.5	10.6	15,020	
クオール	6.9	6.9	16,435		サイゼリヤ	8.6	9.4	20,896		関西スーパーマーケット	6.1	5.8	7,029	
ジンス	4	4.1	22,919		V Tホールディングス	19.5	21.2	10,642		王将フードサービス	3.4	4.5	35,100	
ビックカメラ	31.7	31.7	48,374		ポプラ	10.5	10.4	7,030		プレナス	6.5	6.3	11,888	
DCMホールディングス	32.8	27.6	28,455		ユナイテッドアローズ	7.6	7.4	32,264		ミニストップ	4.3	4.3	9,270	
MonotaRO	20.1	18.7	117,623		ハイデイ日高	6.5	8	18,640		アークス	9.5	10.6	30,803	
アーケランドサービスHD	5.6	4.8	9,859		京都きもの友禅	11.3	—	—		パローホールディングス	11.2	13.2	33,528	
J. フロントリテイリング	69.8	67.4	111,479		コロナイ	17.6	19.8	62,667		ベルク	2.8	2.8	17,192	
ドトール・日レスHD	9.4	9.4	20,003		ピーシーデポコーポ	—	11.2	5,812		大庄	4.3	—	—	
マツモトキヨシHLDGS	10.5	24	106,800		香番屋	3.9	4.3	19,565		ファーストリテイリング	9.3	7.7	432,971	
ブロンコビリー	3.5	3.8	13,452		スギホールディングス	12.1	12.5	69,125		サンドラッグ	21.1	21.4	84,744	

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
サクスパーホールディング	6.9	7.1	6.326		伊予銀行	78.1	75.8	54,424		保険業 (2.4%)				
ペルーナ	14.1	14.5	17,429		百十四銀行	52	57	19,380		かんぽ生命保険	20.1	21.5	56,437	
銀行業 (6.8%)					四国銀行	45	9.3	12,759		SOMPOホールディングス	115.2	113	536,298	
じもとホールディングス	59.2	67.9	12,154		阿波銀行	45	43	31,046		アコムホールディングス	4.2	4.4	16,060	
じぶきフィナンシャルG	266.8	294	116,130		大分銀行	29	3.3	13,365		M&S&AD	154.2	149.6	547,386	
東京きらぼしFG	8.1	7.8	18,899		宮崎銀行	38	4.1	13,099		SONY FH	53.1	47.7	114,384	
九州フィナンシャルG	88.9	90.1	49,284		佐賀銀行	32	4.2	9,903		第一生命HLDGS	333.2	325.6	749,368	
ゆうちょ銀行	155.4	161.8	216,326		十八銀行	39	42	15,288		東京海上HD	221.9	216.9	1,181,454	
富山第一銀行	14.4	21.3	9,989		沖縄銀行	5.2	5.4	22,167		T&Dホールディングス	200.8	176.7	315,762	
コンコルディア・フィナンシャル	357.4	344.9	188,660		琉球銀行	11.5	13.4	18,277		アドバンスクリエイト	3.5	4.6	11,716	
西日本フィナンシャルHD	35.8	35.1	44,190		セブン銀行	208.5	214	74,044		その他金融業 (1.2%)				
関西みらいFG	—	26.5	25,731		みずほフィナンシャルG	7,486.6	7,834.1	1,553,502		全国保証	16	16.4	73,964	
33FG	—	5	11,985		高知銀行	85	11.9	13,566		アルヒ	—	7.3	17,863	
新生銀行	523	46.3	81,812		山口フィナンシャルG	49	68.7	85,531		クレディセゾン	41.2	42.6	76,722	
あおぞら銀行	346	34.1	136,741		長野銀行	4.6	—	—		芙蓉総合リース	6.5	6.6	45,474	
三菱UFJフィナンシャルG	4,183	4,012.9	2,819,864		名古屋銀行	4	4.3	16,297		興銀リース	9.9	10.8	32,043	
りそなホールディングス	647.2	634.4	396,055		北洋銀行	84.8	82.7	31,508		東京証券シュリー	11	12.1	79,860	
三井住友トラストHD	114.9	113	517,201		愛知銀行	2	2	9,870		日本証券金融	23.8	24.5	16,023	
三井住友フィナンシャルG	442.4	431.8	1,959,508		第二銀行	3.5	—	—		アイフル	99.1	101.7	33,255	
第四銀行	63	6.5	30,517		中京銀行	2.2	3.2	7,532		リコーリース	4.8	4.2	15,981	
北越銀行	6.4	5.9	13,971		大光銀行	30	5	10,935		イオンフィナンシャルサービス	35.5	39.8	92,734	
千葉銀行	213	202.6	150,126		愛媛銀行	7.1	9.2	11,858		アコム	116.7	118.6	54,081	
群馬銀行	119.2	107.2	61,318		トマト銀行	6.2	9.4	14,081		ジャックス	32	6.9	15,973	
武蔵野銀行	8	8.1	25,717		みなと銀行	5.4	—	—		オリコ	118	114.4	18,418	
千葉興業銀行	17.6	23.7	11,399		京葉銀行	33	40	19,200		日立キャピタル	12.9	15.7	49,769	
筑波銀行	30.7	39.2	10,701		関西アーバン銀行	8.8	—	—		アプラスフィナンシャル	—	56.3	6,080	
七十七銀行	84	16.8	44,587		栃木銀行	31.5	32.2	12,397		オリックス	390.2	384.8	699,181	
青森銀行	40	4.6	15,870		北日本銀行	3.1	4.3	11,317		三菱UFJリース	140	144.9	95,054	
秋田銀行	32	4	11,664		東和銀行	119	12.1	12,584		日本取引所グループ	173.4	165.5	332,986	
山形銀行	27	6.5	16,393		福島銀行	108	18	12,546		イー・ギャランティ	2.7	9.8	11,377	
岩手銀行	2.8	4	19,960		大東銀行	45	10.8	13,500		NECキャピタルソリューション	3.5	4	7,524	
東邦銀行	43	49.8	21,065		トモニホールディングス	44	46.4	22,364		不動産業 (2.3%)				
東北銀行	73	10.4	14,123		フィデアホール	68.8	71.5	12,012		いちご	53.6	85.1	36,848	
みちのく銀行	41	—	—		池田泉州HD	55.2	57.2	22,193		日本駐車場開発	80.7	84.6	15,143	
ふくおかフィナンシャルG	220	236	148,680		証券・商品先物取引業 (0.9%)					ヒューリック	115.6	119.7	130,473	
静岡銀行	143	140.3	135,810		FPG	20.7	20.9	24,662		三栄建築設計	—	3.6	6,026	
十六銀行	62	6.8	19,373		SBIホールディングス	62.5	66.1	218,130		野村不動産HLDGS	39.3	38	89,756	
スルガ銀行	56.4	59.6	31,826		ジャフコ	9.5	8.3	34,611		三重交通グループHD	9.9	15.7	8,729	
八十二銀行	103.5	94.3	47,527		大和証券G本社	497	489	338,388		サムティ	6.2	6.5	11,719	
山梨中央銀行	33	37	14,911		野村ホールディングス	1,128.3	983.7	532,870		日本商業開発	4.7	5.1	9,501	
大垣共立銀行	84	8.1	23,481		岡三証券グループ	44	46	25,254		プレサンスコーポレーション	9.7	9.2	13,800	
福井銀行	51	5.4	13,014		丸三証券	17.4	20.5	19,844		ユニゾホールディングス	5.5	8	17,520	
北國銀行	55	6.4	27,936		東洋証券	32	38	9,652		日本管理センター	4.6	6.7	8,696	
清水銀行	3	4.1	8,901		東海東京HD	57.5	62.5	41,687		フージャースHD	10.9	17.4	12,284	
滋賀銀行	43	46	26,680		光世証券	39	—	—		オープンハウス	9.4	10	55,800	
南都銀行	6.5	6	17,154		水戸証券	28.5	25.6	9,779		東急不動産HD	129.3	138	108,744	
百五銀行	44	50.7	23,829		いちよし証券	12.5	13.7	15,481		飯田GHD	45.4	47.3	94,931	
京都銀行	99	21.6	123,984		松井証券	27.2	29.2	34,923		パーク24	30.9	34	114,410	
紀陽銀行	19.5	20.6	35,967		マネックスG	56.3	63.4	34,299		パラカ	3.5	2.9	6,887	
三重銀行	3.8	—	—		カブドットコム証券	37.9	39.4	15,050		野村不動産	293.2	288.2	759,839	
ほくほくフィナンシャルG	35.1	34.9	54,793		極東証券	8	8.2	11,939		三菱地所	411.4	429.3	828,549	
広島銀行	160	77.8	59,361		岩井コスモホールディング	8	8	12,504		平和不動産	11.3	10.6	21,486	
山陰合同銀行	30.6	32.9	31,748		藍澤證券	14.8	14	10,752		東京建物	59	61.3	83,429	
中国銀行	37.5	35.2	40,620		マネーパートナーズGP	10	—	—		ダイビル	14.4	14.7	17,934	
鳥取銀行	6	—	—							京阪神ビルディング	12.7	12.3	10,762	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
住友不動産	133	139	554,749		エスアールジータカミヤ	10.4	—	—		建設技術研究所	7.2	7.6	12,950	
大京	105	9	20,367		ジャパンベストレスキュー	16.5	—	—		スバル興業	—	1.2	6,756	
テーオーシー	19.5	20.6	17,345		ファンコミュニケーションズ	16.3	19	12,901		東京テアトル	60	7	9,688	
東京楽天地	1.4	—	—		WDBホールディングス	—	3.1	12,136		タナベ経営	4.3	—	—	
レオパレス21	68.7	69.3	41,926		ティア	10.1	7.8	7,402		ナガワ	1.1	—	—	
スタートコーポレーション	7.8	7.8	18,868		バリューコマース	—	4.6	10,635		よみうりランド	15	1.9	8,654	
FJ住宅	10.5	11.7	10,576		インフォマート	29.3	32.2	45,080		東京都競馬	4.3	4	16,600	
空港施設	7.6	12.2	7,771		JPホールディングス	23.7	25.8	8,101		常盤興産	5.8	6.4	11,923	
ゴールドクレスト	5.4	4.7	8,807		EPSホールディングス	8.3	9.2	21,804		カナモト	8.4	8	31,720	
日本エスリード	—	4.1	6,318		プレステージ・インター	13.2	13.3	17,396		東京ドーム	22.6	22.9	23,060	
日神不動産	11.1	11.8	6,619		アミューズ	3.9	4.2	13,125		西尾レントオール	4.9	5.8	20,851	
日本エスコン	—	13.3	10,852		ドリームインキュベータ	2.7	3.1	6,559		トランス・コスモス	6.8	6.7	18,927	
タカラレーベン	25.2	29.8	10,310		クイック	5.1	5	9,965		乃村工藝社	13.5	13.6	30,695	
サンヨーハウジング名古屋	8.2	10.1	11,322		TAC	—	17.1	4,565		藤田観光	2.2	3	10,305	
イオンモール	36	36.3	71,111		ケネディクス	76.4	55.9	37,117		KNT-CTホールディングス	40	4.5	5,562	
ファースト住建	4	—	—		電通	65.1	68.3	354,477		日本管財	5.2	6.9	14,876	
カチタス	—	8.3	28,510		ぴあ	—	2	11,420		トーカイ	2.7	5.8	14,865	
トーセイ	10.1	10.2	11,291		イオンファンタジー	2.1	2.2	8,118		セコム	60.3	59.7	554,792	
エヌ・ティ・ティ都市開発	34	35.6	44,179		シーティーエス	9.8	—	—		セントラル警備保障	3.5	3.2	14,384	
サンフロンティア不動産	7.1	8.7	11,536		ネクシーズグループ	—	3.6	7,182		丹青社	12.1	12.8	15,270	
エフ・ジェー・ネクスト	8.9	7	6,335		みらかホールディングス	14.6	16.5	54,532		メイトテック	6.9	6.7	36,247	
グランディハウス	16	19	9,063		アルプス技研	3.1	6	15,132		アサツー ディ・ケイ	10	—	—	
日本空港ビルデング	17.7	17	85,850		オリエンタルランド	63.3	66.3	776,041		応用地質	7	7.3	10,811	
サービス業 (4.7%)					ダスキン	14.4	14.9	41,749		船井総研ホールディング	8.3	12.2	29,548	
日本工営	4.5	4.2	12,343		明光ネットワークジャパン	7.9	9.7	10,078		オオバ	—	16.3	10,220	
LIFULL	16.4	21.8	13,494		ファルコホールディングス	6.6	8.2	15,219		学芸社	5.1	7	12,523	
ジェイエイリクルメント	4.9	5.3	13,191		ラウンドワン	19.5	18.4	25,962		ベネッセホールディングス	19.8	19.8	66,825	
日本M&Aセンター	17.2	39.8	129,549		リゾートトラスト	22.7	23.4	43,734		イオンディライト	6.5	7.8	32,292	
タケエイ	6.7	9.1	7,507		ビー・エム・エル	7.5	7.9	26,504		ニチイ学館	11.6	11.9	11,328	
トラスト・テック	3.8	3.2	14,624		りらいあコミュニケーション	10.7	9.9	14,394		ダイセキ	10.2	9.6	27,504	
コジカホールディングス	—	16.2	19,602		リソー教育	12.9	11.7	10,471						
パソナグループ	5.8	6.2	10,509		ユー・エス・エス	70.8	67.8	143,803						
CDS	6.3	7	10,241		サイバーエージェント	36	35	221,200						
リンクアンドモチベーション	13	12.2	15,286		楽天	276.3	262.4	220,573						
GCA	7.5	9.6	8,496		デー・オー・ダブリュー	8.9	13.1	10,427						
エス・エム・エス	8.8	22.9	48,799		セントラルスポーツ	3.2	2.5	10,850						
パーソルホールディングス	46.1	52.5	133,612		フルキャストホールディングス	6	6.6	16,995						
リニカル	4.1	4.8	8,395		テクノプロ・ホールディング	10	10.8	72,576						
クックパッド	17.9	21.9	9,789		イー・ガーディアン	—	3.8	10,111						
スタジオアリス	2.9	3.9	9,083		ジャパンマテリアル	4.5	17.1	24,367						
シミックホールディングス	3.4	4.3	9,804		ベクトル	6.2	7.6	19,471						
総合警備保障	21.6	22.6	114,356		アサンテ	4.2	4.7	11,186						
カカココム	42.3	43.3	93,181		N・フィールド	4.5	4.8	8,740						
ルネサンス	5.2	—	—		M&Aキャピタルパートナー	—	1.7	10,676						
ディップ	8.4	8.5	22,380		エスクローAJ	—	12.7	5,435						
オプトホールディング	6.7	4.4	12,865		日本ビューホテル	—	8.2	11,045						
新日本科学	8.6	—	—		リクルートホールディングス	385.7	432.5	1,585,112						
ツクイ	16.3	15.6	16,005		日本郵政	149.8	315.7	423,985						
エムスリー	51.6	59.8	308,568		ベルシステム24HLDGS	10.1	10.6	18,899						
アウトソーシング	3.4	25.3	40,201		ソラスト	—	12.1	15,790						
ウェルネット	5.7	9.7	9,903		リログループ	30.4	31.1	99,053						
ワールドホールディングス	—	2	6,470		東祥	2.1	4.2	18,858						
ディー・エヌ・エー	27	30.5	58,529		エイチ・アイ・エス	8.7	10	38,000						
博報堂DY HLDGS	81.5	78	153,036		共立メンテナンス	9.5	10.3	48,152						
ぐるなび	8.7	11	10,252		イチネンホールディングス	7.1	8.6	12,667						

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
株数、金額	83,168.1	70,601.2	148,894.152	
銘柄数<比率>	1,488銘柄	1,498銘柄	<99.4%>	

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円 708	百万円 —
TOPIX		

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	株 4,046,400 (837,100)	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837,100株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2018年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 148,894,152	% 92.1
コール・ローン等、その他	12,835,335	7.9
投資信託財産総額	161,729,488	100.0

(注) 評価額の単位未満は四捨捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年9月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	162,304,424,316円
コール・ローン等	12,734,389,759
株式(評価額)	148,894,152,440
未収入金	39,049,440
未収配当金	57,194,385
未収利息	474,420
その他未収収益	4,227,872
差入委託証拠金	574,936,000
(B) 負債	12,536,765,839
未払金	596,940,475
未払解約金	143,365,900
差入委託証拠金代用有価証券	601,800,000
受入担保金	11,194,645,612
その他未払費用	13,852
(C) 純資産総額(A-B)	149,767,658,477
元本	133,322,724,900
次期繰越損益金	16,444,933,577
(D) 受益権総口数	133,322,724,900口
1万口当り基準価額(C/D)	11,233円

*期首における元本額は132,992,880,740円、当期中における追加設定元本額は17,323,849,993円、同解約元本額は16,994,005,833円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド4,246,087,218円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A9,335,647,683円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A2 50,961,008円、ダイワ国内重視バランスファンド30V A (一般投資家私募) 72,288,859円、ダイワ国内重視バランスファンド50V A (一般投資家私募) 1,120,195,925円、ダイワ国際分散バランスファンド30V A (一般投資家私募) 59,077,590円、ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一般投資家私募) 1,527,630,494円、日本株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) 919,561円、D-1's T O P I Xインデックス 30,019,052円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド21,906,513円、D

Cダイワ・ターゲットイヤー2050 675,429円、iFree T O P I Xインデックス 626,644,015円、iFree 8資産バランス1,109,565,785円、iFree 年金バランス 7,355,261円、DCダイワ日本株式インデックス64,305,310,317円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,491,555,747円、ダイワ・ライフ・バランス50 2,765,694,997円、ダイワ・ライフ・バランス70 2,681,824,381円、年金ダイワ日本株式インデックス4,471,005,264円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 15,185,267円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 49,889,188円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 16,774,873円、ダイワつみたてインデックス日本株式936,048円、ダイワ世界分散バランスファンド15V A337,828円、ダイワ世界分散バランスファンド20V A347,186円、ダイワ世界分散バランスファンド20V A (国内株式型) 686,510円、ダイワ世界分散バランスファンド25V A4,016,770円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A8,380,481円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A (国内株式型) 9,446,810円、ダイワ世界分散バランスファンド40V A212,247,455円、ダイワ世界分散バランスファンド60V A168,882,290円、ダイワ・バランスファンド35V A9,877,017,535円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50V A21,077,804円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75V A25,269,263円、ダイワ・バランスファンド25V A (適格機関投資家専用) 856,720,435円、ダイワ国内バランスファンド25V A (適格機関投資家専用) 129,305,829円、ダイワ国内バランスファンド30V A (適格機関投資家専用) 223,180,217円、ダイワ・ノロード T O P I Xファンド123,940,950円、ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス8,293,640,110円、ダイワT O P I Xインデックス(ダイワSMA専用) 225,887,747円、ダイワファンドラップオンライン T O P I Xインデックス1,843,135,534円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,389,161,216円、ダイワライフスタイル25 179,686,588円、ダイワライフスタイル50 634,139,972円、ダイワライフスタイル75 542,537,590円、DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド) 13,546,528,305円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,233円です。

■損益の状況

当期 自 2017年9月20日 至 2018年9月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,926,174,471円
受取配当金	2,856,794,998
受取利息	6,598,190
その他収益金	67,436,566
支払利息	△ 4,655,283
(B) 有価証券売買損益	9,540,946,202
売買益	16,201,631,737
売買損	△ 6,660,685,535
(C) 先物取引等損益	156,581,600
取引益	383,035,059
取引損	△ 226,453,459
(D) その他費用	△ 788,366
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	12,622,913,907
(F) 前期繰越損益金	3,715,498,201
(G) 解約差損益金	△ 1,623,726,298
(H) 追加信託差損益金	1,730,247,767
(I) 合計(E+F+G+H)	16,444,933,577
次期繰越損益金(I)	16,444,933,577

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

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

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書 (全体版) 第2期

(決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日~2018年11月30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。

当ファンドは、外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないました。ここに、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/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式組入 比率	株式先物 比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
1期末(2017年11月30日)	円 11,363	円 0	% 13.6	11,186	% 11.9	% 92.8	% 3.6	% 0.0	% 2.5	百万円 1,294
2期末(2018年11月30日)	11,423	0	0.5	11,049	△ 1.2	91.5	6.8	—	2.5	2,198

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) 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。MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

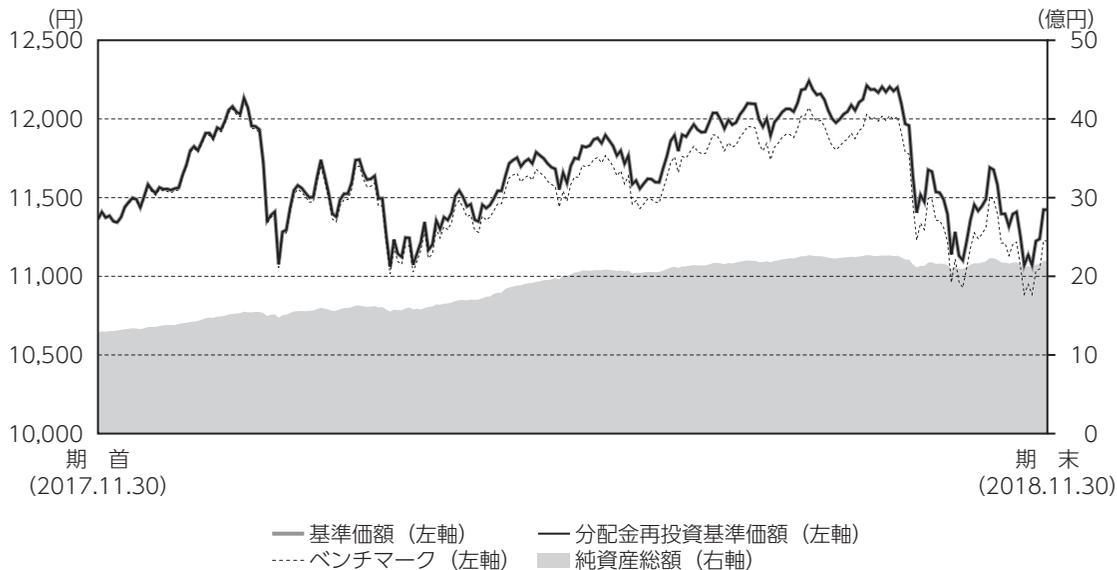
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

■ 基準価額・騰落率

期首：11,363円

期末：11,423円（分配金0円）

騰落率：0.5%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドの受益証券を通じてベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））の動きに連動させることをめざして運用を行なった結果、米中貿易摩擦の動向や米国長期金利の上昇などを背景に海外株式市況が上値の重い展開となったことから、基準価額は横ばい圏で推移しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 資 信 託 組 入 証 比	投 信 託 証 組 入 証 比	資 券 率 比
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率					
(期首) 2017年11月30日	円 11,363	% -	11,186	% -	% 92.8	% 3.6	% 0.0	% 2.5	
12月末	11,563	1.8	11,369	1.6	94.5	4.2	0.0	2.5	
2018年 1 月末	11,955	5.2	11,755	5.1	92.1	3.4	0.0	2.3	
2 月末	11,639	2.4	11,422	2.1	91.8	3.6	0.0	2.2	
3 月末	11,246	△1.0	11,020	△1.5	92.3	4.7	0.0	2.3	
4 月末	11,455	0.8	11,205	0.2	96.0	4.1	0.0	2.4	
5 月末	11,658	2.6	11,363	1.6	94.4	1.8	-	2.3	
6 月末	11,590	2.0	11,282	0.9	97.0	2.0	-	2.5	
7 月末	11,938	5.1	11,613	3.8	95.5	2.5	-	2.4	
8 月末	12,187	7.3	11,831	5.8	93.3	3.6	-	2.3	
9 月末	12,204	7.4	11,830	5.8	95.5	5.0	-	2.3	
10月末	11,222	△1.2	10,880	△2.7	93.0	3.6	-	2.5	
(期末) 2018年11月30日	11,423	0.5	11,049	△1.2	91.5	6.8	-	2.5	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は、横ばい圏で推移しました。

当作成期首より、米国の税制改革法への期待や英国のEU（欧州連合）離脱条件を巡る交渉が合意に近づいたことなどを好感し、上昇して始まりました。2018年2月以降は、米国の利上げ加速への警戒感や米中貿易摩擦が激化したことへの懸念などを嫌気し、下落しました。4月以降は、貿易摩擦問題について米中両国が歩み寄りの姿勢を示したことや好調な4～6月期の企業業績を好感し、上昇基調となりました。8月以降は、米中貿易摩擦への懸念が再燃したことや新興国通貨の急落などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落しました。当作成期末にかけては、米中貿易摩擦が深刻化したこと、米国長期金利の上昇や中東情勢の緊迫化懸念などを背景に、上値の重い展開となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

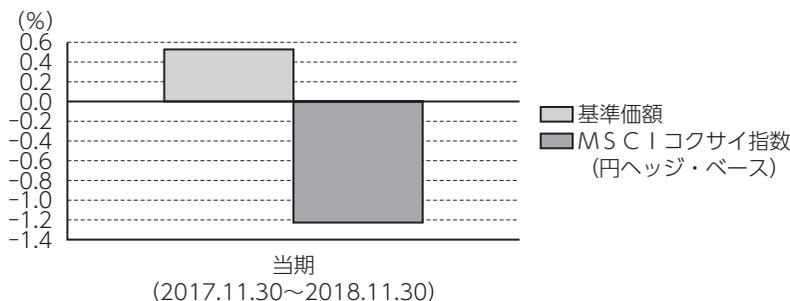
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（投資信託証券、株式先物を含む。）等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.5%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、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（1万口当たり）

項目	当 期	
	2017年12月1日 ～2018年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（%）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,423

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2017.12.1~2018.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	38円	0.329%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,678円です。
(投 信 会 社)	(30)	(0.254)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.008	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(1)	(0.006)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0.014	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(2)	(0.014)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	7	0.063	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(5)	(0.046)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(1)	(0.011)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	48	0.415	

(注1) 当作成期中の費用(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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	532,889	986,065	42,907	80,170

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	11,303,026千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	32,788,591千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.34

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	716,933	1,206,916	2,197,794

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	2,197,794	99.8
コール・ローン等、その他	5,245	0.2
投資信託財産総額	2,203,040	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1香港ドル=14.51円、1シンガポール・ドル=82.89円、1ニュージーランド・ドル=77.87円、1イギリス・ポンド=145.01円、1イスラエル・シケル=30.60円、1スイス・フラン=113.90円、1デンマーク・クローネ=17.31円、1ノルウェー・クローネ=13.28円、1スウェーデン・クローネ=12.51円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(37,468,332千円)の投資信託財産総額(38,953,477千円)に対する比率は、96.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,203,040,265円
コール・ローン等	5,245,944
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	2,197,794,321
(B) 負債	4,855,965
未払解約金	1,228,009
未払信託報酬	3,569,491
その他未払費用	58,465
(C) 純資産総額(A-B)	2,198,184,300
元本	1,924,332,921
次期繰越損益金	273,851,379
(D) 受益権総口数	1,924,332,921口
1万口当り基準価額(C/D)	11,423円

* 期首における元本額は1,139,363,470円、当作成期間中における追加設定元本額は1,148,408,392円、同解約元本額は363,438,941円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,423円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,784円
受取利息	238
支払利息	△ 3,022
(B) 有価証券売買損益	△ 12,608,974
売買益	4,033,827
売買損	△ 16,642,801
(C) 信託報酬等	△ 6,256,030
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	△ 18,867,788
(E) 前期繰越損益金	58,139,423
(F) 追加信託差損益金	234,579,744
(配当等相当額)	(65,343,613)
(売買損益相当額)	(169,236,131)
(G) 合計(D + E + F)	273,851,379
次期繰越損益金(G)	273,851,379
追加信託差損益金	234,579,744
(配当等相当額)	(65,343,613)
(売買損益相当額)	(169,236,131)
分配準備積立金	58,139,791
繰越損益金	△ 18,868,156

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	215,714,740
(d) 分配準備積立金	58,139,791
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	273,854,531
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	273,854,531
(h) 受益権総口数	1,924,332,921口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2018年1月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年11月30日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を46～60ページに併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

買				売			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC (アメリカ)	12.642	246,521	19,500	APPLE INC (アメリカ)	1.1	25,253	22,958
MICROSOFT CORP (アメリカ)	21.382	223,246	10,440	KEURIG DR PEPPER INC (アメリカ)	1.476	20,138	13,644
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.203	202,055	167,959	RELX PLC (イギリス)	8.2	19,315	2,355
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	7.196	139,277	19,354	LINDE PLC (アイルランド)	0.75	13,050	17,400
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.899	110,229	122,613	OLD MUTUAL PLC (イギリス)	41.479	12,644	304
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	7.445	109,296	14,680	MICROSOFT CORP (アメリカ)	1	10,945	10,945
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	8.878	109,017	12,279	GKN PLC (イギリス)	15.154	10,601	699
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	12.388	108,147	8,730	THOMSON REUTERS CORP (カナダ)	1.8	9,751	5,417
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.821	99,374	121,041	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.05	9,434	188,691
BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	26.848	88,899	3,311	WYNDHAM DESTINATIONS INC (アメリカ)	0.75	8,989	11,985

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年11月30日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（21,183,891千円）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2018年11月30日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	11	111	12,702	情報技術	
PALO ALTO NETWORKS INC	8	140	15,981	情報技術	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16.59	102	11,580	情報技術	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	81	9,206	ヘルスケア	
SYNCHRONY FINANCIAL	62	161	18,270	金融	
ABBOTT LABORATORIES	159.08	1,165	132,240	ヘルスケア	
ARCONIC INC	39.5	84	9,564	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	15.96	197	22,425	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	34	185	21,014	一般消費財・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	24	208	23,695	情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33.53	354	40,272	情報技術	
QORVO INC	11.79	76	8,734	情報技術	
AFLAC INC	70.68	320	36,411	金融	
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	138	15,755	一般消費財・サービス	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	10	55	6,344	コミュニケーション・サービス	
ADOBE INC	46.22	1,151	130,637	情報技術	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17.5	76	8,637	素材	
LULULEMON ATHLETICA INC	10.08	130	14,807	一般消費財・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	72	8,189	金融	

銘柄	2018年11月30日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
GARMIN LTD	7.5	49	5,615	一般消費財・サービス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19.42	309	35,083	素材	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	70.31	1,024	116,272	資本財・サービス	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	17.1	149	16,919	情報技術	
VR BERKLEY CORP	6	47	5,341	金融	
AUTOZONE INC	2.4	198	22,489	一般消費財・サービス	
DOLLAR TREE INC	19.11	168	19,175	一般消費財・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	96.83	212	24,062	ヘルスケア	
PINNACLE WEST CAPITAL	9	79	9,072	公益事業	
CELANESE CORP	12.97	130	14,798	素材	
DR HORTON INC	33.06	123	14,011	一般消費財・サービス	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	12.49	57	6,570	エネルギー	
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	90	10,283	ヘルスケア	
AUTODESK INC	19.13	278	31,594	情報技術	
MOODY'S CORP	14.9	233	26,483	金融	
DEVON ENERGY CORP	48.68	130	14,864	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	8	77	8,752	素材	
ATMOS ENERGY CORP	10.5	98	11,133	公益事業	
ALLIANT ENERGY CORP	22	98	11,151	公益事業	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CITIGROUP INC	233.28	1,513	171,792	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	40.52	590	67,058	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	44.53	339	38,578	公益事業
ALLEGHANY CORP	1.38	87	9,896	金融
DOMINO'S PIZZA INC	3	84	9,537	一般消費財・サービス
HESS CORP	28.96	157	17,889	エネルギー
DAVITA INC	10	65	7,450	ヘルスケア
DANAHER CORP	54.31	586	66,518	ヘルスケア
FORTIVE CORP	30.44	225	25,604	資本財・サービス
AVNET INC	11	47	5,417	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53.14	430	48,895	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12	27	3,150	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	36	4,198	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45.84	211	23,947	生活必需品
BUNGE LTD	9.5	55	6,247	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	32.46	245	27,882	情報技術
APPLE INC	446.42	8,015	909,515	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	239	27,145	金融
BOEING CO/THE	50.77	1,739	197,344	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14.5	118	13,406	金融
BECTON DICKINSON AND CO	24.93	623	70,748	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	27	3,084	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	86	9,861	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	55	6,263	情報技術
NISOURCE INC	40.26	104	11,900	公益事業
CH. ROBINSON WORLDWIDE INC	10.5	96	10,931	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	95.84	485	55,114	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	379.19	2,254	255,793	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	116.72	2,540	288,326	金融
ANSYS INC	7.2	114	13,022	情報技術
H&R BLOCK INC	16	45	5,127	一般消費財・サービス
BB&T CORP	69.55	351	39,932	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	151.31	784	88,970	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	309.28	3,403	386,244	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	22.75	222	25,264	金融
CIGNA CORP	24.09	536	60,825	ヘルスケア
LKQ CORP	33	91	10,402	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	5.47	71	8,117	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26.52	128	14,534	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	26.5	116	13,266	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12	153	17,371	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.72	296	33,620	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	16.81	301	34,162	情報技術
CATERPILLAR INC	55.96	728	82,693	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	25	128	14,555	公益事業
MOSAIC CO/THE	30	108	12,312	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	97	11,020	資本財・サービス
CORNING INC	70.47	224	25,475	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	427.58	2,024	229,681	情報技術
MORGAN STANLEY	125.59	559	63,429	金融
WABCO HOLDINGS INC	3.2	38	4,366	資本財・サービス
MSCI INC	7.3	114	13,008	金融

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	100	11,362	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	4	47	5,358	資本財・サービス
COTY INC-CL A	47.57	40	4,598	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17.34	84	9,542	情報技術
BROADCOM INC	38.42	905	102,788	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	3	35	3,992	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC	3.5	45	5,125	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7	56	6,402	ヘルスケア
ARAMARK	17	64	7,299	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14	34	3,914	素材
DTE ENERGY COMPANY	13.5	158	18,025	公益事業
CENTENE CORP	19.54	277	31,470	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9	96	10,909	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40.5	145	16,557	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17.97	140	15,910	金融
GARTNER INC	8	122	13,902	情報技術
SPUNK INC	17.12	173	19,742	情報技術
AGCO CORP	5	29	3,318	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	63.01	464	52,729	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	44.36	260	29,597	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	14	65	7,440	資本財・サービス
DEERE & CO	26.86	402	45,707	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	16.1	178	20,232	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	8.33	134	15,263	情報技術
CHEMOURS CO/THE	14	39	4,527	素材
NASDAQ INC	8.5	76	8,718	金融
VAIL RESORTS INC	3.9	108	12,292	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	14.61	77	8,766	金融
TARGA RESOURCES CORP	20.29	91	10,408	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4.5	66	7,530	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	89	10,194	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4.05	29	3,300	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	29.94	237	26,920	公益事業
COGNEX CORP	14	59	6,729	情報技術
TELEFLEX INC	4.85	131	14,941	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8.06	85	9,716	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12.25	120	13,717	ヘルスケア
IDEX CORP	7	94	10,672	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	76.33	481	54,599	生活必需品
ROLLINS INC	7	44	5,063	資本財・サービス
AMETEK INC	19.82	145	16,466	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	21.55	142	16,129	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	34	3,897	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	10.6	80	9,182	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	28.2	262	29,765	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	40.83	943	107,021	生活必需品
SCANA CORP	7	32	3,662	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4	44	5,064	金融
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2.4	115	13,141	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	28	61	6,980	金融
UGI CORP	20.85	118	13,430	公益事業
CUMMINS INC	13	192	21,861	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ACTIVISION BLIZZARD INC	65.65	345	39,153	コミュニケーション・サービス	
SABRE CORP	16	41	4,727	情報技術	
CDW CORP/DE	13	120	13,628	情報技術	
SIGNATURE BANK	3.5	42	4,868	金融	
COSTAR GROUP INC	3.82	141	16,056	資本財・サービス	
SVB FINANCIAL GROUP	4.5	109	12,444	金融	
AMERCO	0.7	24	2,769	資本財・サービス	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4.4	59	6,740	資本財・サービス	
MERCADOLIBRE INC	3.83	137	15,557	一般消費財・サービス	
HANESBRANDS INC	29	45	5,153	一般消費財・サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	116	13,213	情報技術	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	23.13	176	20,067	一般消費財・サービス	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22.45	39	4,503	情報技術	
IPG PHOTONICS CORP	2.5	35	4,008	情報技術	
COPART INC	17.78	91	10,432	資本財・サービス	
DIAMONDBACK ENERGY INC	9.79	109	12,441	エネルギー	
KINDER GENETICS INC	10	62	7,134	ヘルスケア	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6.5	148	16,867	ヘルスケア	
TRANSDIGM GROUP INC	5	183	20,842	資本財・サービス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	25	67	7,701	資本財・サービス	
KINDER MORGAN INC	171.69	289	32,865	エネルギー	
HCA HEALTHCARE INC	26.89	388	44,089	ヘルスケア	
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	113	12,909	エネルギー	
T-MOBILE US INC	34.49	236	26,878	コミュニケーション・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	7	25	2,922	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA CO/THE	363.83	1,782	202,208	生活必需品	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16	77	8,847	生活必需品	
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	147	16,753	資本財・サービス	
EATON VANCE CORP	12.5	50	5,772	金融	
FRANKLIN RESOURCES INC	22	73	8,362	金融	
CSX CORP	80.73	579	65,744	資本財・サービス	
FLUOR CORP	12.9	52	6,013	資本財・サービス	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.5	169	19,278	ヘルスケア	
EXPEDIA GROUP INC	11.5	137	15,624	一般消費財・サービス	
AUTOLIV INC	8	69	7,836	一般消費財・サービス	
AMAZON.COM INC	37.53	6,280	712,694	一般消費財・サービス	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16	33	3,788	エネルギー	
FLOWERVE CORP	9	42	4,875	資本財・サービス	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19.45	316	35,929	ヘルスケア	
EXXON MOBIL CORP	385.14	3,044	345,506	エネルギー	
FLIR SYSTEMS INC	16.13	73	8,358	情報技術	
AES CORP	40	61	7,007	公益事業	
L3 TECHNOLOGIES INC	6.5	118	13,492	資本財・サービス	
EVEREST RE GROUP LTD	3.5	77	8,741	金融	
EOG RESOURCES INC	50.99	537	61,023	エネルギー	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	12.5	85	9,660	情報技術	
ABIOMED INC	3.55	117	13,373	ヘルスケア	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13.6	123	13,965	ヘルスケア	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25	178	20,302	ヘルスケア	
FORD MOTOR CO	321.29	301	34,159	一般消費財・サービス	
MACY'S INC	22	74	8,422	一般消費財・サービス	
DISCOVERY INC - A	11	34	3,947	コミュニケーション・サービス	

銘柄	2018年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	60	6,831	コミュニケーション・サービス	
DISCOVERY INC-C	21.49	61	6,988	コミュニケーション・サービス	
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	95	10,892	資本財・サービス	
FORTINET INC	10.5	77	8,804	情報技術	
MARKEL CORP	1.1	122	13,931	金融	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	8	17	1,980	エネルギー	
NEXTERA ENERGY INC	43.99	779	88,410	公益事業	
FREEMONT-MCMORAN INC	114.5	135	15,356	素材	
US BANCORP	142.81	771	87,569	金融	
UNITED RENTALS INC	11.15	129	14,666	資本財・サービス	
F5 NETWORKS INC	5.5	95	10,829	情報技術	
FASTENAL CO	29.07	172	19,547	資本財・サービス	
FISERV INC	35	274	31,152	情報技術	
GENERAL ELECTRIC CO	770.45	611	69,413	資本財・サービス	
NEKTAR THERAPEUTICS	14.01	55	6,241	ヘルスケア	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	21.49	110	12,572	一般消費財・サービス	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	22.5	51	5,889	一般消費財・サービス	
GENERAL MOTORS CO	122.63	450	51,150	一般消費財・サービス	
TRIPADVISOR INC	7	44	5,046	コミュニケーション・サービス	
GENERAL DYNAMICS CORP	23.16	421	47,873	資本財・サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33.29	648	73,602	金融	
ALPHABET INC-CL A	27.21	2,978	337,953	コミュニケーション・サービス	
ALPHABET INC-CL C	28.9	3,145	356,884	コミュニケーション・サービス	
OWENS CORNING	8	41	4,683	資本財・サービス	
GENERAL MILLS INC	55.56	234	26,610	生活必需品	
FIRSTENERGY CORP	44.88	166	18,918	公益事業	
GENUINE PARTS CO	12	123	14,037	一般消費財・サービス	
IHS MARKIT LTD	33.55	177	20,100	資本財・サービス	
FIFTH THIRD BANCORP	58.5	161	18,281	金融	
HARRIS CORP	9.82	140	15,948	資本財・サービス	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	36	4,141	資本財・サービス	
HALLIBURTON CO	78.26	249	28,318	エネルギー	
HOME DEPOT INC	106.05	1,862	211,380	一般消費財・サービス	
ASSURANT INC	2.86	27	3,173	金融	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107.45	155	17,678	金融	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3.5	75	8,532	資本財・サービス	
HERSHEY CO/THE	13.58	145	16,557	生活必需品	
HARLEY-DAVIDSON INC	14	59	6,749	一般消費財・サービス	
HUMANA INC	12.88	425	48,271	ヘルスケア	
NXP SEMICONDUCTORS NV	34.19	283	32,165	情報技術	
HELMERICH & PAYNE	13.36	81	9,270	エネルギー	
HENRY SCHEIN INC	11	98	11,126	ヘルスケア	
HP INC	141.5	323	36,704	情報技術	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	132.5	200	22,732	情報技術	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	43	4,978	コミュニケーション・サービス	
HOLLYFRONTIER CORP	17.83	109	12,478	エネルギー	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13.5	41	4,653	コミュニケーション・サービス	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	8.5	33	3,821	コミュニケーション・サービス	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	36	102	11,593	金融	
KRAFT HEINZ CO/THE	59.73	305	34,694	生活必需品	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	84.62	1,027	116,643	情報技術	
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	185	21,004	素材	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	65	7,390	資本財・サービス
ZOETIS INC	46.63	432	49,085	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	25.48	263	29,886	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	17.5	107	12,241	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	101	11,556	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	15.72	60	6,917	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	124	14,119	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	26.65	208	23,677	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	28.5	81	9,245	情報技術
JIM SMUCKER CO/THE	9	93	10,563	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	244.09	3,560	403,959	ヘルスケア
ABBVIE INC	140.59	1,264	143,431	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	135	15,329	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	31.41	361	40,969	生活必需品
KROGER CO	71.6	217	24,665	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	15.2	146	16,676	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	22.88	691	78,514	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7.3	139	15,877	情報技術
L BRANDS INC	19.5	65	7,432	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	76.06	708	80,436	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	86.98	1,017	115,474	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	14.77	225	25,600	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	3	42	4,806	不動産
LOEWS CORP	25.5	122	13,882	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	18	112	12,763	金融
MCDONALD'S CORP	72.43	1,370	155,545	一般消費財・サービス
3M CO	55.13	1,127	127,964	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	216.96	3,008	341,408	コミュニケーション・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	17.17	182	20,651	情報技術
MANPOWERGROUP INC	6.5	52	5,911	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	23.87	430	48,848	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5.4	106	12,059	素材
CONCHIO RESOURCES INC	18	236	26,858	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	58.32	110	12,553	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	19	49	5,605	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	38.47	356	40,456	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	45.61	108	12,260	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	154	17,542	一般消費財・サービス
MATTEL INC	36	49	5,620	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	24.29	151	17,173	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10.29	153	17,403	生活必需品
MYLAN NV	48.88	166	18,879	ヘルスケア
METLIFE INC	75.19	333	37,872	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	61.24	98	11,166	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	4.23	99	11,342	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13.49	58	6,598	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14.35	190	21,587	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.1	132	15,034	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	37.84	87	9,922	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	11	188	21,439	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	5.36	21	2,435	金融
MERCK & CO. INC.	248.03	1,932	219,269	ヘルスケア

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DOWDUPONT INC	215.58	1,233	140,019	素材
MASCO CORP	35.43	110	12,575	資本財・サービス
M & T BANK CORP	13.23	223	25,323	金融
MARSH & MCLENNAN COS	45.04	392	44,549	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	27.83	339	38,475	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	6.17	174	19,784	情報技術
SQUARE INC - A	27.91	195	22,136	情報技術
TRANSUNION	20.29	129	14,695	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	25	58	6,581	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11	48	5,466	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	28.76	246	27,928	情報技術
NETAPP INC	23	155	17,590	情報技術
NIKE INC -CL B	115.89	861	97,757	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	25.53	430	48,795	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20.5	152	17,311	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10.5	80	9,087	金融
ALLY FINANCIAL INC	33	87	9,915	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	14.4	375	42,592	資本財・サービス
APTIV PLC	26.8	191	21,743	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	41.5	134	15,228	素材
MCKESSON CORP	17.69	224	25,494	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23.87	132	14,988	情報技術
XYLEM INC	19.72	140	15,954	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146.09	1,270	144,152	生活必需品
NUCOR CORP	27	161	18,376	素材
WESTERN UNION CO	36	67	7,630	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	13	85	9,715	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	96	10,958	一般消費財・サービス
EVERGY INC	24	141	16,018	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	67.97	481	54,689	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	8	67	7,682	コミュニケーション・サービス
LINDE PLC	47.33	754	85,557	素材
PAYCHEX INC	26.75	187	21,222	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7	248	28,185	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	174.46	975	110,738	生活必需品
P G & E CORP	44.79	119	13,600	公益事業
PFIZER INC	530.06	2,412	273,724	ヘルスケア
ALKERMES PLC	10.5	37	4,259	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	40.5	208	23,680	公益事業
STRYKER CORP	31.26	534	60,623	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	12.39	209	23,745	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16.5	246	27,928	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	4	38	4,374	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	225.8	2,095	237,819	生活必需品
EXELON CORP	90.42	412	46,857	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	22.07	272	30,887	ヘルスケア
NVR INC	0.3	74	8,420	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	106.05	709	80,467	エネルギー
PEPSICO INC	126.93	1,501	170,341	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35.5	329	37,425	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13.5	124	14,166	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	57.87	932	105,766	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6	33	3,765	金融
PENTAIR PLC	15.75	66	7,590	資本財・サービス
QUALCOMM INC	125.36	728	82,659	情報技術
INVESCO LTD	37	74	8,501	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	145	16,511	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23	114	12,965	金融
RAYTHEON COMPANY	25.67	445	50,559	資本財・サービス
RED HAT INC	15.3	272	30,883	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	7.45	267	30,396	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	20.5	157	17,862	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.5	839	95,237	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	36.18	310	35,281	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	8.44	81	9,241	素材
RESMED INC	13.83	152	17,340	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	12	105	11,974	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	8	49	5,611	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	4	44	5,051	一般消費財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	149	17,013	金融
CHEVRON CORP	174.78	2,077	235,706	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	31.03	169	19,266	公益事業
TESLA INC	11.94	407	46,222	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	54	121	13,835	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	15.81	201	22,865	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	11	98	11,173	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16.05	530	60,159	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	28	120	13,706	不動産
TWITTER INC	57	178	20,244	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	89.27	415	47,142	公益事業
SYSCO CORP	43.92	296	33,659	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	24.82	324	36,789	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	53	6,068	金融
STERICYCLE INC	5	24	2,735	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	23	80	9,129	素材
SCHLUMBERGER LTD	120.94	555	62,988	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	92	10,531	資本財・サービス
AT&T INC	662.94	2,026	229,959	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	93	10,618	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	36.27	67	7,613	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7.61	319	36,246	素材
SEMPRA ENERGY	20.68	233	26,438	公益事業
TIFFANY & CO	10.86	97	11,062	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	23.49	100	11,367	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	90.23	879	99,752	情報技術
SALESFORCE.COM INC	63.51	887	100,688	情報技術
WESTROCK CO	23.21	107	12,206	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	83.88	287	32,617	資本財・サービス
UNION PACIFIC CORP	69.85	1,051	119,268	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	61	100	11,455	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	60.83	394	44,796	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	78.79	954	108,356	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	64.48	730	82,867	資本財・サービス
UNUM GROUP	19	69	7,845	金融

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SPRINT CORP	41.14	26	2,950	コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	10	13	1,529	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	14.32	178	20,303	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	80	9,123	金融
AMEREN CORPORATION	18.5	125	14,236	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	87.73	2,478	281,270	ヘルスケア
VERISIGN INC	10.85	169	19,287	情報技術
VALERO ENERGY CORP	38.82	308	35,005	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	4.8	144	16,359	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	99	11,324	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	136	15,517	ヘルスケア
ANTHEM INC	23.46	685	77,775	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	133.83	1,560	177,080	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	420.06	2,270	257,577	金融
WASTE MANAGEMENT INC	42.25	391	44,450	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	107.9	275	31,294	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10.5	99	11,279	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	5	63	7,171	一般消費財・サービス
WALMART INC	132.09	1,285	145,820	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	73	8,296	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19.56	224	25,515	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	7.17	77	8,796	一般消費財・サービス
XEROX CORP	19.88	53	6,063	情報技術
WABTEC CORP	6.44	59	6,771	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	112.06	532	60,385	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.5	132	15,008	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3.5	33	3,775	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	31.29	485	55,117	ヘルスケア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	80.64	684	77,639	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15.36	243	27,623	金融
WESTERN DIGITAL CORP	25.45	115	13,145	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	28.69	203	23,113	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42.5	231	26,292	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	162.27	2,257	256,121	情報技術
PPL CORP	59	180	20,532	公益事業
PULTEGROUP INC	19	50	5,762	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	20.12	218	24,763	素材
NORTHERN TRUST CORP	20.62	200	22,695	金融
NVIDIA CORP	52.59	827	93,902	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	8.59	154	17,572	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41.75	557	63,314	金融
QURATE RETAIL INC	42.88	96	10,918	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12	47	5,348	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	24.5	141	16,046	生活必需品
NETFLIX INC	39.86	1,150	130,599	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35.75	888	100,833	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	12.15	106	12,038	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13	125	14,189	金融
TEXTRON INC	22.1	123	14,033	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	103.5	512	58,168	コミュニケーション・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	32	157	17,901	コミュニケーション・サービス
NEWS CORP - CLASS A	29	38	4,346	コミュニケーション・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
OGE ENERGY CORP	12	46	5,295	公益事業	
OMNICOM GROUP	18.5	142	16,201	コミュニケーション・サービス	
ORACLE CORP	275.01	1,317	149,473	情報技術	
MASTERCARD INC - A	84.98	1,671	189,632	情報技術	
ONEOK INC	37.36	229	26,003	エネルギー	
CENTURYLINK INC	97.47	181	20,593	コミュニケーション・サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9	264	30,010	資本財・サービス	
YUM! BRANDS INC	25.24	231	26,308	一般消費財・サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	11.91	133	15,123	コミュニケーション・サービス	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	78	8,927	情報技術	
MOLSON COORS BREWING CO-B	17.75	114	12,952	生活必需品	
NOBLE ENERGY INC	37.5	91	10,327	エネルギー	
BANK OF AMERICA CORP	880.46	2,468	280,135	金融	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14.97	144	16,434	ヘルスケア	
NORDSTROM INC	8	41	4,747	一般消費財・サービス	
AMERICAN EXPRESS CO	65.84	732	83,158	金融	
ANALOG DEVICES INC	33.36	298	33,886	情報技術	
ADVANCED MICRO DEVICES	95.45	204	23,210	情報技術	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23.94	127	14,429	金融	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	84.69	367	41,744	金融	
ANADARKO PETROLEUM CORP	51.05	274	31,106	エネルギー	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15.69	111	12,681	情報技術	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17.84	199	22,597	一般消費財・サービス	
NEWFIELD EXPLORATION CO	12	21	2,389	エネルギー	
AVERY DENNISON CORP	6.5	61	7,031	素材	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	53.53	376	42,700	情報技術	
EMERSON ELECTRIC CO	56.56	380	43,211	資本財・サービス	
AON PLC	22.96	375	42,643	金融	
AMGEN INC	60.83	1,231	139,683	ヘルスケア	
TAPESTRY INC	25.5	96	10,998	一般消費財・サービス	
EATON CORP PLC	41.02	311	35,379	資本財・サービス	
CELGENE CORP	70.24	492	55,918	ヘルスケア	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15.06	295	33,529	生活必需品	
APPLIED MATERIALS INC	91.64	334	37,995	情報技術	
CIT GROUP INC	9	41	4,727	金融	
CIMAREX ENERGY CO	8	66	7,588	エネルギー	
CME GROUP INC	30.41	574	65,185	金融	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33.89	110	12,586	エネルギー	
ECOLAB INC	23.64	374	42,487	素材	
EQUIFAX INC	12.56	129	14,650	資本財・サービス	
GAP INC/THE	28.2	75	8,527	一般消費財・サービス	
GILEAD SCIENCES INC	117.75	820	93,113	ヘルスケア	
HORMEL FOODS CORP	22	99	11,290	生活必需品	
STATE STREET CORP	30	217	24,635	金融	
SUNTRUST BANKS INC	46.15	288	32,723	金融	
SCHWAB (CHARLES) CORP	115.1	508	57,674	金融	
BAXTER INTERNATIONAL INC	45.41	308	35,048	ヘルスケア	
CAMPBELL SOUP CO	13	51	5,845	生活必需品	
CROWN HOLDINGS INC	8	40	4,623	素材	
CARDINAL HEALTH INC	24.5	134	15,295	ヘルスケア	
FEDEX CORP	22.83	519	58,934	資本財・サービス	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45.69	406	46,074	金融	

銘柄	2018年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
FMC CORP	11.42	94	10,761	素材	
FLEX LTD	45	38	4,365	情報技術	
CERNER CORP	23.68	135	15,409	ヘルスケア	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7.54	106	12,113	素材	
CITRIX SYSTEMS INC	13.5	149	16,920	情報技術	
INTEL CORP	427.71	2,040	231,498	情報技術	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28	68	7,736	コミュニケーション・サービス	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28.5	126	14,319	金融	
ILLINOIS TOOL WORKS	28.56	388	44,041	資本財・サービス	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15.3	96	10,972	コミュニケーション・サービス	
ILLUMINA INC	13.07	441	50,121	ヘルスケア	
SEALED AIR CORP	14.5	52	5,990	素材	
INTUITIVE SURGICAL INC	10.28	535	60,769	ヘルスケア	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12.36	136	15,480	情報技術	
SNAP-ON INC	5	82	9,304	資本財・サービス	
CARMAX INC	19.9	131	14,923	一般消費財・サービス	
COMERICA INC	14.76	116	13,229	金融	
INGREDION INC	5.3	55	6,243	生活必需品	
DUKE ENERGY CORP	60.64	531	60,275	公益事業	
TARGET CORP	49.32	351	39,829	一般消費財・サービス	
DOVER CORP	12	100	11,443	資本財・サービス	
VWV GRAINGER INC	4	124	14,124	資本財・サービス	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11.16	72	8,243	資本財・サービス	
CINTAS CORP	7.63	143	16,280	資本財・サービス	
CONAGRA BRANDS INC	34.42	111	12,603	生活必需品	
CLOROX COMPANY	12.78	212	24,079	生活必需品	
ENTERGY CORP	16	137	15,589	公益事業	
MICROSOFT CORP	666.32	7,342	833,117	情報技術	
INCYTE CORP	14.47	93	10,637	ヘルスケア	
CVS HEALTH CORP	121.21	969	110,029	ヘルスケア	
MEDTRONIC PLC	121.79	1,176	133,496	ヘルスケア	
MICRON TECHNOLOGY INC	113.72	431	48,918	情報技術	
BLACKROCK INC	10.57	447	50,726	金融	
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	156	17,740	公益事業	
HASBRO INC	10	96	10,989	一般消費財・サービス	
KELLOGG CO	26.2	165	18,803	生活必需品	
KEYCORP	87.73	159	18,057	金融	
KANSAS CITY SOUTHERN	7.5	75	8,610	資本財・サービス	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	133.02	592	67,212	生活必需品	
KOHL'S CORP	16.5	110	12,562	一般消費財・サービス	
COOPER COS INC/THE	3.5	97	11,017	ヘルスケア	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	48.28	50	5,785	金融	
APACHE CORP	36.73	130	14,812	エネルギー	
CHUBB LTD	42.88	575	65,301	金融	
ARROW ELECTRONICS INC	10	76	8,677	情報技術	
ALLSTATE CORP	34.1	301	34,235	金融	
EBAY INC	90.53	267	30,324	一般消費財・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	102.54	864	98,038	情報技術	
EASTMAN CHEMICAL CO	12.83	101	11,506	素材	
XILINX INC	22	200	22,766	情報技術	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	54.12	547	62,159	ヘルスケア	
DISH NETWORK CORP-A	15	49	5,609	コミュニケーション・サービス	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ZIONS BANCORP NA	19	91	10,393	金融	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20.44	289	32,818	生活必需品	
TOLL BROTHERS INC	12	40	4,576	一般消費財・サービス	
TRIMBLE INC	22	82	9,336	情報技術	
LENNAR CORP-A	22.6	97	11,037	一般消費財・サービス	
LEAR CORP	6	80	9,182	一般消費財・サービス	
E*TRADE FINANCIAL CORP	23	118	13,430	金融	
PROGRESSIVE CORP	50.67	330	37,481	金融	
PACCAR INC	35.25	216	24,522	資本財・サービス	
PVH CORP	5.5	60	6,850	一般消費財・サービス	
BIOMGEN INC	18.99	620	70,377	ヘルスケア	
IDEXX LABORATORIES INC	7.42	149	16,933	ヘルスケア	
STARBUCKS CORP	124.84	834	94,739	一般消費財・サービス	
PERRIGO CO PLC	9	57	6,547	ヘルスケア	
EVERSOURCE ENERGY	24	160	18,265	公益事業	
INTUIT INC	20.97	438	49,776	情報技術	
BORGWARNER INC	15.5	61	6,924	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	23	147	16,721	一般消費財・サービス	
BALL CORP	28.92	143	16,266	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131.42	486	55,234	ヘルスケア	
ELECTRONIC ARTS INC	30.24	261	29,643	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	10.5	112	12,738	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23.03	413	46,894	ヘルスケア	
VF CORP	32.04	254	28,888	一般消費財・サービス	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	28.41	157	17,843	コミュニケーション・サービス	
VIACOM INC-CLASS B	30.71	98	11,161	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4.8	61	6,937	一般消費財・サービス	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	121	13,792	ヘルスケア	
CARNIVAL CORP	38.14	231	26,282	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	411.24	1,621	183,947	コミュニケーション・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	77	8,814	資本財・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	22	142	16,201	資本財・サービス	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	49	5,623	生活必需品	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	110	70	7,963	不動産	
アメリカ・ドル 通貨計	27,605.12 592銘柄	214,062	24,289,667 <63.0%>		
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円		
IMPERIAL OIL LTD	23	93	7,968	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1.5	140	12,018	情報技術	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24.38	43	3,690	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	21.21	165	14,148	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42	87	7,490	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	10	103	8,844	金融	
BCE INC	9	51	4,391	コミュニケーション・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	16	145	12,387	素材	
SUNCOR ENERGY INC	152.12	662	56,589	エネルギー	
METRO INC	16	73	6,259	生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	33	199	17,042	金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	99	720	61,563	金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38	427	36,504	金融	
TORONTO-DOMINION BANK	166	1,219	104,192	金融	
GREAT-WEST LIFECO INC	17	52	4,449	金融	
ROYAL BANK OF CANADA	120	1,173	100,269	金融	
TOURMALINE OIL CORP	13	23	2,032	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	14	47	4,031	エネルギー	

銘柄	2018年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千カナダ・ドル	千円		
TRANSCANADA CORP	76	413	35,316	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	37.71	167	14,276	エネルギー	
BOMBARDIER INC-B	192	41	3,558	資本財・サービス	
BARRICK GOLD CORP	83	143	12,293	素材	
CAE INC	23	61	5,224	資本財・サービス	
THOMSON REUTERS CORP	18.33	121	10,399	金融	
EMPIRE CO LTD 'A'	18	45	3,893	生活必需品	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	42	3,592	素材	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	53	4,538	素材	
LINAMAR CORP	6	28	2,460	一般消費財・サービス	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	11	11	957	エネルギー	
HYDRO ONE LTD	15	29	2,519	公益事業	
LOBLAW COMPANIES LTD	14.89	91	7,800	生活必需品	
WSP GLOBAL INC	12	77	6,610	資本財・サービス	
EMERA INC	12	53	4,592	公益事業	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	31	2,677	公益事業	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	30	211	18,025	コミュニケーション・サービス	
AGNICO EAGLE MINES LTD	18	83	7,134	素材	
KINROSS GOLD CORP	105.34	38	3,257	素材	
BANK OF MONTREAL	58	576	49,226	金融	
POWER CORP OF CANADA	31	82	7,049	金融	
METHANEX CORP	6	44	3,798	素材	
SHOPIFY INC - CLASS A	8	158	13,520	情報技術	
NUTRIEN LTD	51.27	349	29,850	素材	
AURORA CANNABIS INC	70	52	4,490	ヘルスケア	
CANOPY GROWTH CORP	20	88	7,551	ヘルスケア	
CAMECO CORP	28	44	3,790	エネルギー	
TELUS CORP	3	14	1,218	コミュニケーション・サービス	
POWER FINANCIAL CORP	20	56	4,804	金融	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	117	10,008	素材	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5	75	6,468	一般消費財・サービス	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80	19	1,653	素材	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	117	391	33,430	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2	122	10,492	金融	
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	203	17,413	一般消費財・サービス	
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	87	7,484	生活必需品	
BLACKBERRY LTD	64	74	6,396	情報技術	
SUN LIFE FINANCIAL INC	52	252	21,578	金融	
ENBRIDGE INC	143	628	53,685	エネルギー	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	78	458	39,183	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	160	348	29,753	金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	20	63	5,391	ヘルスケア	
GOLDCORP INC	63	78	6,732	素材	
ENCANA CORP	69	63	5,451	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12	335	28,643	資本財・サービス	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	11	53	4,537	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	14	60	5,130	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64	722	61,704	資本財・サービス	
CGI GROUP INC - CLASS A	19	160	13,684	情報技術	
HUSKY ENERGY INC	30.12	48	4,119	エネルギー	
ONEX CORPORATION	7	57	4,898	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	39	97	8,315	コミュニケーション・サービス	
FINNING INTERNATIONAL INC	25	67	5,782	資本財・サービス	
SNC-LAVALIN GROUP INC	19	92	7,928	資本財・サービス	
IGM FINANCIAL INC	3	10	869	金融	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30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		
OPEN TEXT CORP	27	121	10,413	情報技術	
CI FINANCIAL CORP	20	39	3,399	金融	
SAPUTO INC	13	53	4,536	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	76	6,533	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	45	314	26,845	生活必需品	
FORTIS INC	42	193	16,521	公益事業	
LUNDIN MINING CORP	66	37	3,213	素材	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	25	10	860	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	80	78	6,662	エネルギー	
DOLLARAMA INC	27	96	8,265	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	8	32	2,759	公益事業	
ALTAGAS LTD	8	11	956	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	20	39	3,406	不動産	
KEYERA CORP	22	63	5,384	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	48	103	8,852	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	28	25	2,188	エネルギー	
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 89銘柄数<比率>	3,530.88 14,631	1,249,841 < 3.2%>		
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
HEALTHSCOPE LTD	160	35	2,924	ヘルスケア	
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	56	4,702	金融	
BHP BILLITON LIMITED	273.32	846	70,347	素材	
SOUTH32 LTD	563.87	177	14,709	素材	
ALUMINA LTD	121	27	2,322	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	77.28	240	20,012	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	105	42	3,515	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	36	38	3,236	金融	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	223.99	557	46,355	金融	
WESTPAC BANKING CORP	294.81	778	64,710	金融	
SANTOS LTD	182.7	103	8,560	エネルギー	
AUSNET SERVICES	285	45	3,752	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	248.74	675	56,106	金融	
RIO TINTO LTD	33.49	245	20,380	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	120.5	79	6,597	エネルギー	
AMCOR LIMITED	109.96	147	12,268	素材	
AURIZON HOLDINGS LTD	153.1	65	5,405	資本財・サービス	
COLES GROUP LTD	95.67	118	9,847	生活必需品	
OIL SEARCH LTD	154.18	112	9,376	エネルギー	
SEEK LTD	26	48	4,052	資本財・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	55.92	83	6,899	生活必需品	
NEWCREST MINING LTD	58.04	120	10,020	素材	
INCITEC PIVOT LTD	204	77	6,457	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	154.92	1,122	93,222	金融	
CALTEX AUSTRALIA LTD	20	54	4,567	エネルギー	
ORICA LTD	20	35	2,944	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	98.22	112	9,367	金融	
CIMIC GROUP LTD	10	42	3,567	資本財・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	117.6	350	29,144	生活必需品	
COCA-COLA AMATIL LTD	26	26	2,181	生活必需品	
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	77	6,429	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	30	35	2,941	一般消費財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	351.14	103	8,635	コミュニケーション・サービス	
AMP LTD	249.35	60	5,054	金融	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	32	52	4,373	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	25.42	296	24,669	金融	

銘柄	2018年11月30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	千オーストラリア・ドル	千円		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	156	13,025	一般消費財・サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	30	30	2,522	金融	
CSL LTD	40.37	729	60,639	ヘルスケア	
VOESFARMERS LTD	95.67	301	25,044	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	4.44	76	6,370	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	79	6,575	素材	
SUNCORP GROUP LTD	99.38	134	11,187	金融	
BORAL LTD	86	45	3,758	素材	
ASX LTD	13	79	6,644	金融	
COMPUTERSHARE LTD	37	68	5,671	情報技術	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	170.97	127	10,553	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	25	58	4,835	ヘルスケア	
CHALLENGER LTD	63	61	5,150	金融	
AGL ENERGY LTD	47.39	88	7,358	公益事業	
BRAMBLES LTD	113.37	118	9,870	資本財・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	8	38	3,208	一般消費財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9	50	4,154	ヘルスケア	
REA GROUP LTD	6.08	46	3,861	コミュニケーション・サービス	
DOMINOS PIZZA ENTERPRISES L	6.21	28	2,398	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 55銘柄数<比率>	6,106.41 9,418	782,493 < 2.0%>		
(香港)	百株	千香港ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	145	775	11,245	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	220	1,067	15,482	一般消費財・サービス	
MTR CORP	165	662	9,612	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	160	1,812	26,303	不動産	
SINO LAND CO	340	459	6,660	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	270.52	2,204	31,990	資本財・サービス	
WHARF HOLDINGS LTD	80	170	2,472	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	35	302	4,385	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	135	1,185	17,208	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	105.14	421	6,117	不動産	
HANG LUNG GROUP LTD	80	170	2,478	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	793.05	1,237	17,951	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	64	1,152	16,724	金融	
WHEELLOCK & CO LTD	60	270	3,926	不動産	
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	622	9,038	不動産	
WH GROUP LTD	915	532	7,727	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	119	2,715	39,403	金融	
MINTH GROUP LTD	60	163	2,372	一般消費財・サービス	
LI & FUNG LTD	700	114	1,665	一般消費財・サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	186	2,712	不動産	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	160	2,321	情報技術	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	80	190	2,762	一般消費財・サービス	
NWS HOLDINGS LTD	150	253	3,678	資本財・サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	75	202	2,943	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	86	226	3,288	金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO	60	238	3,464	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	100	70	1,021	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	80	220	3,203	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	230.52	1,290	18,731	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	324	4,708	公益事業	
PCCW LTD	600	271	3,943	コミュニケーション・サービス	
AIA GROUP LTD	1,156	7,444	108,021	金融	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	671	9,740	不動産	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30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	千香港ドル	千円		
SANDS CHINA LTD	230	783	11,363	一般消費財・サービス	
SHANGRI-LA ASIA LTD	40	44	647	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	120	511	7,417	一般消費財・サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	140	185	2,685	一般消費財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	390	1,181	17,146	金融	
WYNN MACAU LTD	168	299	4,343	一般消費財・サービス	
香港ドル 通貨計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,067.23 39銘柄	30,800 446,914 < 1.2%>		
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	133	333	27,682	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	171	413	34,273	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	68	5,679	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	173	106	8,819	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	52	32	2,685	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	45	3,749	不動産	
CAPITALAND LTD	190	60	4,976	不動産	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	270	34	2,819	資本財・サービス	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	31	2,645	コミュニケーション・サービス	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	31	2,632	一般消費財・サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	348	391	32,422	金融	
GENTING SINGAPORE LTD	450	43	3,618	一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	32	49	4,063	情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	654	201	16,696	コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	48	4,043	資本財・サービス	
SEMPACORP INDUSTRIES LTD	40	10	878	資本財・サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	90	2	171	生活必需品	
SATS LTD	77	36	2,987	資本財・サービス	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	69	50	4,163	金融	
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	20	1,732	資本財・サービス	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	48	4,046	生活必需品	
シンガポール・ドル 通貨計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,400 21銘柄	2,060 170,789 < 0.4%>		
(ニュージーランド)	百株	千ニュージーランド・ドル	千円		
MERIDIAN ENERGY LTD	150	48	3,796	公益事業	
A2 MILK CO LTD	70	76	5,941	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	70	5,474	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	57	4,446	資本財・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	145.26	69	5,418	素材	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	37	48	3,811	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	51	3,974	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル 通貨計	株数・金額 銘柄数<比率>	696.05 7銘柄	422 32,863 < 0.1%>		
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円		
MERLIN ENTERTAINMENT	50	17	2,501	一般消費財・サービス	
TUI AG-DI	48.02	57	8,328	一般消費財・サービス	
BP PLC	1,812.02	946	137,187	エネルギー	
UNILEVER PLC	111.99	476	69,091	生活必需品	
BARCLAYS PLC	1,505.91	251	36,520	金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	140.34	118	17,249	資本財・サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	105	31	4,608	一般消費財・サービス	
RANDGOLD RESOURCES LTD	10.12	65	9,465	素材	
PRUDENTIAL PLC	225.06	348	50,536	金融	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	508.36	112	16,321	金融	
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	52	7,670	素材	

銘柄	2018年11月30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	千イギリス・ポンド	千円		
BAE SYSTEMS PLC	293.37	143	20,858	資本財・サービス	
AVIVA PLC	327.89	134	19,560	金融	
GLAXOSMITHKLINE PLC	455.6	727	105,547	ヘルスケア	
INFORMA PLC	110	78	11,318	コミュニケーション・サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	31.33	49	7,146	情報技術	
MELROSE INDUSTRIES PLC	400	73	10,695	資本財・サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	29	10	1,536	ヘルスケア	
AUTO TRADER GROUP PLC	133.52	58	8,466	コミュニケーション・サービス	
DCC PLC	9.38	55	8,072	資本財・サービス	
GVC HOLDINGS PLC	41.61	31	4,534	一般消費財・サービス	
CONVATEC GROUP PLC	65.81	10	1,462	ヘルスケア	
ROYAL MAIL PLC	100.76	32	4,729	資本財・サービス	
NMC HEALTH PLC	9.75	34	5,007	ヘルスケア	
RELX PLC	178.81	295	42,912	資本財・サービス	
DIAGEO PLC	228.95	647	93,922	生活必需品	
RIO TINTO PLC	105.82	382	55,533	素材	
STANDARD CHARTERED PLC	297.45	183	26,539	金融	
TESCO PLC	887.48	177	25,738	生活必需品	
FRESNILLO PLC	24	18	2,704	素材	
SMITH & NEPHEW PLC	83.29	118	17,180	ヘルスケア	
GLENORE PLC	1,067.03	312	45,382	素材	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	54.66	35	5,125	エネルギー	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	62	9,025	金融	
SMITHS GROUP PLC	40.8	57	8,386	資本財・サービス	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6	3	505	資本財・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109.63	35	5,196	金融	
PEARSON PLC	82.71	79	11,526	コミュニケーション・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	176.31	55	7,992	生活必需品	
NEXT PLC	11.59	58	8,504	一般消費財・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	44	6,476	一般消費財・サービス	
WHITBREAD PLC	17.85	83	12,077	一般消費財・サービス	
BUNZL PLC	31.59	77	11,232	資本財・サービス	
VODAFONE GROUP PLC	2,477.53	415	60,270	コミュニケーション・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8.03	39	5,740	素材	
KINGFISHER PLC	172.29	44	6,435	一般消費財・サービス	
WPP PLC	130.21	113	16,389	コミュニケーション・サービス	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	64	9,312	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	13	24	3,538	公益事業	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58.55	387	56,223	生活必需品	
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	50	7,318	金融	
SCHRODERS PLC	12.27	31	4,608	金融	
SSE PLC	82.82	91	13,198	公益事業	
WEIR GROUP PLC/THE	13	19	2,762	資本財・サービス	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	58	8,477	一般消費財・サービス	
ASTRAZENECA PLC	111.53	686	99,528	ヘルスケア	
FERGUSON PLC	19.89	100	14,571	資本財・サービス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	496.81	122	17,823	金融	
3I GROUP PLC	84.39	72	10,502	金融	
ASHTED GROUP PLC	39	70	10,154	資本財・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	97.25	58	8,545	情報技術	
NATIONAL GRID PLC	303.25	252	36,674	公益事業	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,763.72	379	55,062	金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	125.86	67	9,851	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	82.23	198	28,832	生活必需品	
CENTRICA PLC	380.02	51	7,502	公益事業	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30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		
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7	23	3,355	一般消費財・サービス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	203.98	567	82,259	生活必需品	
BHP GROUP PLC	178.2	272	39,562	素材	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29.6	72	10,503	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	1,828.42	1,223	177,431	金融	
SHIRE PLC	82.23	370	53,718	ヘルスケア	
ANGLO AMERICAN PLC	107.45	173	25,101	素材	
MONDI PLC	34	58	8,549	素材	
WM MORRISON SUPERMARKETS	145	35	5,119	生活必需品	
CARNIVAL PLC	13.83	64	9,281	一般消費財・サービス	
EASYJET PLC	16.44	18	2,726	資本財・サービス	
COMPASS GROUP PLC	142.39	237	34,492	一般消費財・サービス	
PERSIMMON PLC	25.69	50	7,322	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	856.24	224	32,524	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	12	28	4,141	生活必需品	
BURBERRY GROUP PLC	33	60	8,749	一般消費財・サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	13.72	59	8,592	一般消費財・サービス	
TRAVIS PERKINS PLC	17	18	2,706	資本財・サービス	
INTERTEK GROUP PLC	15.92	76	11,090	資本財・サービス	
ITV PLC	275.87	41	6,016	コミュニケーション・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27.35	111	16,193	金融	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	402.7	955	138,514	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	340.53	822	119,228	エネルギー	
MEGGITT PLC	99.25	51	7,437	資本財・サービス	
G4S PLC	113.2	22	3,224	資本財・サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	33	4,794	金融	
INVESTEC PLC	46	22	3,263	金融	
ANTOFAGASTA PLC	34.6	28	4,196	素材	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	178.99	48	7,022	金融	
EXPERIAN PLC	75.55	143	20,782	資本財・サービス	
イギリス・ポンド 通貨計	27,399.2 96銘柄	15,968	2,315,614 < 6.0%>		
(イスラエル)	百株	千円	千円		
AZRIELI GROUP LTD	5.3	98	3,027	不動産	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM.CO	50	21	654	コミュニケーション・サービス	
ISRAEL CHEMICALS LTD	110.96	241	7,381	素材	
ELBIT SYSTEMS LTD	3	136	4,176	資本財・サービス	
BANK HAPOALIM BM	79	201	6,164	金融	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	114	278	8,518	金融	
NICE LTD	8	342	10,477	情報技術	
イスラエル・シェケル 通貨計	370.26 7銘柄	1,320	40,401 < 0.1%>		
(スイス)	百株	千円	千円		
DUFREY AG-REG	1.89	20	2,339	一般消費財・サービス	
UBS GROUP AG-REG	324.02	442	50,358	金融	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.5	27	3,086	素材	
ADOCCO GROUP AG-REG	17.54	86	9,893	資本財・サービス	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	60.91	1,548	176,355	ヘルスケア	
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	27	3,103	金融	
SIKA AG-REG	11.4	141	16,126	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	80	9,146	生活必需品	
ABB LTD-REG	176.76	358	40,890	資本財・サービス	
SWISS RE AG	25	228	26,048	金融	
NESTLE SA-REG	276.66	2,357	268,478	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1.63	108	12,411	金融	

銘柄	2018年11月30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		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3	61	7,025	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	215.08	256	29,213	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD	21.98	90	10,269	金融	
SGS SA-REG	0.46	109	12,464	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1.53	30	3,473	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG	3.69	46	5,320	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG	5.08	64	7,313	情報技術	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	2.67	80	9,150	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	13.47	422	48,113	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG	3.2	47	5,427	金融	
CLARIANT AG-REG	15.68	31	3,643	素材	
NOVARTIS AG-REG	192.9	1,743	198,532	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.2	34	3,924	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	44.47	292	33,267	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	2.76	131	14,948	コミュニケーション・サービス	
GEBERIT AG-REG	3.34	130	14,908	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	0.89	220	25,119	ヘルスケア	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	67	7,705	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	5.63	90	10,356	ヘルスケア	
LONZA GROUP AG-REG	6.92	220	25,151	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	26	3,036	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	38.01	172	19,676	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2.31	90	10,311	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4.95	70	8,011	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	77	8,851	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.1	68	7,802	生活必需品	
スイス・フラン 通貨計	1,503.6 38銘柄	10,107	1,151,259 < 3.0%>		
(デンマーク)	百株	千円	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	173.25	5,181	89,698	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	72.36	952	16,496	金融	
ISS A/S	13.2	286	4,951	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	270	4,686	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S	5	132	2,297	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18.57	901	15,599	資本財・サービス	
CARLSBERG AS-B	12.32	883	15,299	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	18.02	561	9,713	素材	
COLOPLAST-B	10.52	677	11,720	ヘルスケア	
DSV A/S	16.5	850	14,720	資本財・サービス	
WILLIAM DEMANT HOLDING	13.14	259	4,496	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	640	11,081	資本財・サービス	
TRYG A/S	17	275	4,776	金融	
PANDORA A/S	7.5	268	4,651	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	7.5	448	7,755	素材	
GENMAB A/S	7.33	736	12,751	ヘルスケア	
ORSTED A/S	15.33	665	11,511	公益事業	
デンマーク・クローネ 通貨計	408.5 17銘柄	13,992	242,209 < 0.6%>		
(ノルウェー)	百株	千円	千円		
NORSK HYDRO ASA	130.5	534	7,096	素材	
DNB ASA	85.45	1,271	16,891	金融	
ORKLA ASA	70	497	6,605	生活必需品	
TELENOR ASA	62.5	1,035	13,753	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	111.21	2,221	29,507	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	14.5	504	6,701	素材	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30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		
MARINE HARVEST	百株	千円			生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	46.77	930	12,360		金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	20	274	3,641		コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	17	481	6,389		エネルギー
通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	570.99 10銘柄	8,073 < 0.3%>	107,216	
(スウェーデン)					
ICA GRUPPEN AB	百株	千円			生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	7	232	2,904		情報技術
VOLVO AB-B SHS	323.35	2,453	30,694		資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	145.68	1,850	23,145		コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES	7.77	412	5,156		資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	40	569	7,125		一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	26	535	6,703		生活必需品
TELE2 AB-B SHS	12	429	5,369		コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	32.58	372	4,656		金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	196.97	1,872	23,418		金融
SWEDBANK AB - A SHARES	165.26	1,660	20,777		金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	90.75	1,912	23,920		一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS	90.39	1,532	19,173		資本財・サービス
SANDVIK AB	37.09	536	6,707		資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	101.22	1,363	17,056		金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	45.5	1,790	22,403		資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	76.68	1,680	21,017		資本財・サービス
TELIA CO AB	25	380	4,760		コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	241.07	1,013	12,681		資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	20	387	4,851		資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	25	506	6,336		資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	108.82	1,835	22,958		金融
LUNDIN PETROLEUM AB	9.48	259	3,244		エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	19	454	5,680		生活必需品
BOLIDEN AB	50.5	1,176	14,719		素材
EPIROC AB-A	31.71	642	8,033		資本財・サービス
EPIROC AB-B	69.82	525	6,576		資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	25	181	2,266		一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP	24	173	2,170		金融
KINNEVIK AB - B	265.29	2,166	27,107		金融
HEXAGON AB-B SHS	15	355	4,452		情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	24	1,102	13,793		金融
通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,364.93 32銘柄	30,605 < 1.0%>	382,877	
ユーロ (アイルランド)					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	百株	千円			素材
AIB GROUP PLC	19.95	47	6,139		金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	90	34	4,448		金融
KERRY GROUP PLC-A	102.34	59	7,694		生活必需品
CRH PLC	17.12	155	20,137		素材
PADDY POWER BETFAIR PLC	65	160	20,783		一般消費財・サービス
8.89	70	9,159			
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	303.3 6銘柄	529 < 0.2%>	68,363	
ユーロ (オランダ)					
QIAGEN N.V.	百株	千円			ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	25.21	78	10,154		ヘルスケア
NN GROUP NV	81.13	266	34,483		金融
31	117	15,194			

銘柄	2018年11月30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		
UNILEVER NV-CVA	百株	千ユーロ	千円		生活必需品
HEINEKEN NV	127.32	623	80,539		生活必需品
AEGON NV	29.1	231	29,970		金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	143.61	71	9,220		生活必需品
AKZO NOBEL	106.52	239	30,969		生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV	21.18	156	20,198		素材
WOLTERS KLUWER	19.38	151	19,528		資本財・サービス
ING GROEP NV	23.76	127	16,483		金融
KONINKLIJKE KPN NV	308.53	333	43,063		コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	360	91	11,799		情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	34.89	527	68,170		金融
VOPAK	34.53	78	10,179		エネルギー
RANDSTAD NV	6.3	24	3,158		資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	7.5	31	4,113		生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	11	84	10,899		情報技術
AIRBUS SE	74.98	97	12,563		資本財・サービス
EXOR NV	51.12	484	62,647		金融
CNH INDUSTRIAL NV	10.88	56	7,289		資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	116.91	98	12,765		一般消費財・サービス
FERRARI NV	107.87	158	20,527		一般消費財・サービス
11.3	108	14,023			
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,744.02 23銘柄	4,241 < 1.4%>	547,946	
ユーロ (ベルギー)					
UCB SA	百株	千ユーロ	千円		ヘルスケア
KBC GROUP NV	11.1	81	10,517		金融
COLRUYT SA	22.11	140	18,206		生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3.5	19	2,560		金融
SOLVAY SA	9	72	9,308		素材
UMICORE	8.73	84	10,876		素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	16	60	7,846		生活必需品
AGEAS	65.89	443	57,356		金融
PROXIMUS	16.54	71	9,196		コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	22.69	54	7,070		コミュニケーション・サービス
4.62	19	2,573			
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	180.18 10銘柄	1,048 < 0.4%>	135,512	
ユーロ (ルクセンブルグ)					
RTL GROUP	百株	千ユーロ	千円		コミュニケーション・サービス
ARCELORMITTAL	3.5	18	2,428		素材
EUROFINS SCIENTIFIC	53.27	106	13,801		ヘルスケア
SES	1.31	51	6,698		コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	44.02	80	10,418		エネルギー
4.7	50	6,575			
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	149.1 5銘柄	309 < 0.1%>	39,922	
ユーロ (フランス)					
JCDECAUX SA	百株	千ユーロ	千円		コミュニケーション・サービス
TOTAL SA	8.45	25	3,268		エネルギー
MICHELIN (CGDE)	199.22	965	124,671		一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	18.61	171	22,104		素材
KERING	39.38	410	52,986		一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7.08	275	35,553		資本財・サービス
BOUYGUES SA	42.86	275	35,625		資本財・サービス
BNP PARIBAS	18.92	65	8,491		金融
PEUGEOT SA	95.82	429	55,426		一般消費財・サービス
NATIXIS	64.97	126	16,342		一般消費財・サービス
THALES SA	76.74	37	4,902		金融
9.18	98	12,719			

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
DANONE	49.32	323	41,759	生活必需品
CARREFOUR SA	51.56	84	10,934	生活必需品
SUEZ	29.5	38	5,007	公益事業
VIVENDI	88.01	196	25,343	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	20.56	428	55,354	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	40.13	131	17,046	資本財・サービス
LEGRAND SA	22.5	121	15,708	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	8	1,046	生活必需品
PERNOD RICARD SA	21.54	302	39,055	生活必需品
SOCIETE BIC SA	1.5	14	1,831	資本財・サービス
EURAZEO SE	5.34	35	4,632	金融
REXEL SA	38.7	41	5,302	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	61.29	201	25,994	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	23.11	592	76,580	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	73	9,528	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	16.45	169	21,857	情報技術
VALEO SA	19.65	50	6,483	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	18.06	95	12,295	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	62	8,110	資本財・サービス
EIFFAGE	7.5	63	8,259	資本財・サービス
SODEXO SA	6.69	61	7,883	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	31	4,064	ヘルスケア
INGENICO GROUP	4.99	32	4,155	情報技術
AMUNDO SA	4.37	22	2,875	金融
TELEPERFORMANCE	5	72	9,353	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	69	8,916	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	5.6	20	2,656	一般消費財・サービス
SEB SA	1.97	25	3,288	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	18.31	204	26,410	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	0.22	29	3,836	資本財・サービス
AXA SA	157.75	339	43,887	金融
EDENRED	19.13	63	8,261	資本財・サービス
RENAULT SA	16.5	102	13,301	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	2.68	130	16,795	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	25	3,333	生活必需品
ATOS SE	9.46	71	9,180	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	11.49	123	15,942	情報技術
WENDEL	2.01	21	2,804	金融
ORANGE	174.04	261	33,771	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	13.1	51	6,612	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	27	3,523	金融
SANOFI	92.52	729	94,270	ヘルスケア
VINCI SA	44.64	346	44,740	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	69.73	130	16,881	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	99.04	109	14,141	金融
BIOMERIEUX	4.57	29	3,837	ヘルスケア
ENGIE	144.44	180	23,306	公益事業
IMERYS SA	3.4	16	2,137	素材
EDF	67.6	99	12,846	公益事業
SAFRAN SA	25.92	289	37,336	資本財・サービス
ILIAD SA	2.19	27	3,525	コミュニケーション・サービス
ARKEMA	8.38	70	9,163	素材
ADP	3.5	60	7,831	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14	25	3,279	コミュニケーション・サービス
SCOR SE	12.97	55	7,121	金融

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
GETLINK	39.4	45	5,843	資本財・サービス
BOLLORE	73	28	3,740	資本財・サービス
国小計	株数・金額 総額<比率>	2,335.88 68銘柄	9,947 <3.3%>	1,285,084 <3.3%>
ユーロ (ドイツ)	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	75.86	483	62,496	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	18	43	5,608	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	156.95	130	16,829	金融
COMMERZBANK AG	96.89	76	9,879	金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	61	7,905	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	13.72	205	26,597	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	64.88	663	85,746	資本財・サービス
E.ON SE	222.7	199	25,833	公益事業
UNIPER SE	13.8	31	4,120	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.21	212	27,490	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	31	4,040	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	6.45	26	3,438	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	11.8	156	20,252	一般消費財・サービス
BASF SE	79.21	513	66,372	素材
K+S AG-REG	14	22	2,873	素材
ALLIANZ SE-REG	38.42	726	93,889	金融
THYSENKRUPP AG	40.3	67	8,710	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	18.57	190	24,554	生活必需品
RWE AG	53.09	101	13,065	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	36	4,726	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5.6	37	4,867	資本財・サービス
BRENNTAG AG	14.36	58	7,606	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	37.09	190	24,609	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	38	4,999	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	1.66	20	2,704	資本財・サービス
SAP SE	82.41	750	96,990	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12.14	233	30,128	金融
SCHAEFFLER AG	21.02	15	2,052	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	7	20	2,593	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	12.3	73	9,448	素材
KION GROUP AG	6	30	3,959	資本財・サービス
WIRECARD AG	10	136	17,608	情報技術
COVESTRO AG	19.45	99	12,900	素材
INNOGY SE	15	60	7,751	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG	3.05	35	4,562	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12.65	71	9,262	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	10.56	35	4,551	一般消費財・サービス
METRO AG	15	20	2,662	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG	5	22	2,908	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	58	7,518	ヘルスケア
BEIERSDORF AG	8.15	76	9,897	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF	7	26	3,371	素材
MERCK KGAA	11.49	111	14,434	ヘルスケア
ADIDAS AG	15.92	314	40,619	一般消費財・サービス
PUMA SE	0.51	22	2,955	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	6.5	59	7,666	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	289.91	446	57,622	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	22.71	164	21,247	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	80.1	405	52,433	一般消費財・サービス
	97.73	179	23,155	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
HANNOVER RUECK SE	6.44	79	10,225	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	89.74	256	33,111	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	18.97	210	27,252	金融	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	15.6	28	3,661	コミュニケーション・サービス	
LANXESS AG	6	29	3,815	素材	
MTU AERO ENGINES AG	4	70	9,089	資本財・サービス	
AXEL SPRINGER SE	4.7	26	3,415	コミュニケーション・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	32.85	139	18,011	不動産	
SYMRISE AG	14.36	101	13,164	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	22	2,882	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2.5	16	2,073	一般消費財・サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	8.11	50	6,529	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	44.35	191	24,774	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,152.97 63銘柄	9,021 1,165,528 < 3.0%>		
ユーロ (ポルトガル)	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	29	30	3,967	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	84	10,937	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	36.09	52	6,732	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	340.85 3銘柄	167 21,637 < 0.1%>		
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円		
TELEFONICA SA	405.69	316	40,901	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	21.5	42	5,456	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	604.32	301	38,957	金融	
IBERDROLA SA	468.86	309	39,989	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	496.34	55	7,207	金融	
BANKINTER SA	67	49	6,417	金融	
REPSOL SA	102.13	154	19,975	エネルギー	
GRIFOLS SA	30.04	78	10,167	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	1,404.79	591	76,468	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	43.11	275	35,655	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	86	11,146	公益事業	
MAPFRE SA	80.05	20	2,610	金融	
CAIXABANK SA	304.87	110	14,257	金融	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	49	34	4,460	資本財・サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21.95	74	9,598	資本財・サービス	
AENA SME SA	5.69	80	10,441	資本財・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	96.55	263	34,064	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	22	2,930	資本財・サービス	
ENAGAS SA	36.75	88	11,427	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40.56	76	9,932	公益事業	
FERROVIAL SA	38.76	70	9,058	資本財・サービス	
BANKIA SA	159.05	46	5,977	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,534.72 22銘柄	3,151 407,104 < 1.1%>		
ユーロ (イタリア)	百株	千ユーロ	千円		
PRYSMIAN SPA	14.4	23	2,974	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	117.33	173	22,365	金融	
MEDIOBANCA SPA	44.6	34	4,498	金融	
UNICREDIT SPA	211.47	243	31,461	金融	
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	61	7,914	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	23	3,028	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	1,354.57	275	35,568	金融	
ATLANTIA SPA	35.27	64	8,358	資本財・サービス	

銘柄	2018年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
POSTE ITALIANE SPA	29	19	2,512	金融	
MONCLER SPA	15.22	44	5,802	一般消費財・サービス	
RECORDATI SPA	6.92	19	2,496	ヘルスケア	
ENI SPA	211.46	300	38,836	エネルギー	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	44.83	32	4,236	生活必需品	
PIRELLI & C SPA	56.51	35	4,558	一般消費財・サービス	
LEONARDO SPA	25	21	2,796	資本財・サービス	
ENEL SPA	711.57	338	43,739	公益事業	
SNAM SPA	243	93	12,033	エネルギー	
LUXOTTICA GROUP SPA	13.07	67	8,729	一般消費財・サービス	
TERNI SPA	99	48	6,246	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,802.06 19銘柄	1,920 248,156 < 0.6%>		
ユーロ (フィンランド)	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	44.93	107	13,866	素材	
NOKIA OYJ	544.37	263	34,024	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	41.16	60	7,819	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	41.93	46	6,048	素材	
METSO OYJ	11.08	28	3,625	資本財・サービス	
ELISA OYJ	13	45	5,819	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	38.32	151	19,633	金融	
FORTUM OYJ	44	80	10,399	公益事業	
KONE OYJ-B	26.6	118	15,247	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	17.7	50	6,500	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	11	76	9,893	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	17.63	52	6,728	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	851.72 12銘柄	1,080 139,607 < 0.4%>		
ユーロ (オーストリア)	百株	千ユーロ	千円		
OMV AG	12.09	54	7,048	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	27.5	95	12,399	金融	
VOESTALPINE AG	18	52	6,790	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	28	3,736	金融	
ANDRITZ AG	5.5	23	3,008	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	74.09 5銘柄	255 32,982 < 0.1%>		
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	17,468.89 236銘柄	31,673 4,091,846 < 10.6%>		
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	100,492.06 1,239銘柄	- 35,303,993 < 91.5%>		

(注1) 邦貨換算金額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2018年11月30日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千□	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.372	258	29,278
SIMON PROPERTY GROUP INC	2.794	515	58,524
BOSTON PROPERTIES INC	1.556	201	22,920
VORNADO REALTY TRUST	1.156	81	9,258
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.055	177	20,177
EQUITY RESIDENTIAL	3.603	253	28,728
EQUINIX INC	0.706	271	30,770
AMERICAN TOWER CORP	4.045	658	74,686
HOST HOTELS & RESORTS INC	6.228	120	13,639
KIMCO REALTY CORP	3.3	52	5,965
INVITATION HOMES INC	2.2	47	5,339
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	2.403	42	4,768
VENTAS INC	3.702	231	26,233
WEYERHAEUSER CO	7.435	198	22,559
AGNC INVESTMENT CORP	4.334	76	8,719
CROWN CASTLE INTL CORP	4.153	469	53,250
IRON MOUNTAIN INC	1.718	57	6,579
VEREIT INC	7.75	59	6,709
PROLOGIS INC	5.687	382	43,351
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.2	146	16,663
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.65	60	6,912
DUKE REALTY CORP	3.1	87	9,873
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.6	155	17,656
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.45	58	6,683
WELLTOWER INC	3.797	271	30,775
HCP INC	4.55	131	14,869
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	44	5,039
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.1	112	12,758
MACERICH CO/THE	0.7	35	3,976
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	9.6	96	10,958
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1.552	76	8,711
REALTY INCOME CORP	2.55	162	18,477
PUBLIC STORAGE	1.54	326	37,021
REGENCY CENTERS CORP	1.15	72	8,197
SL GREEN REALTY CORP	0.65	60	6,919
UDR INC	1.9	79	9,031
WP CAREY INC	1.6	108	12,307
DIGITAL REALTY TRUST INC	1.8	204	23,220
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.285	121	13,762
アメリカ・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	105,971 6,568	745,278 < 1.9%>

銘柄	2018年11月30日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)	千□	千カナダ・ドル	千円
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2	42	3,625
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	34	2,946
カナダ・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	3.4 2銘柄	76 < 0.0%>
(オーストラリア)	千□	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE GROUP	4.303	56	4,697
TRANSURBAN GROUP	26.027	299	24,845
SYDNEY AIRPORT	9.129	62	5,195
APA GROUP	7.5	68	5,713
SCENTRE GROUP	43.529	174	14,501
DEXUS	6.5	70	5,848
GPT GROUP	14.648	78	6,547
MIRVAC GROUP	31.638	71	5,940
STOCKLAND	14.3	53	4,467
GOODMAN GROUP	14.731	157	13,070
VICINITY CENTRES	19.523	53	4,427
オーストラリア・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	191.828 11銘柄	1,146 < 0.2%>
(香港)	千□	千香港ドル	千円
LINK REIT	24	1,810	26,274
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52	394	5,726
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	381	5,535
香港ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	110 3銘柄	2,586 < 0.1%>
(シンガポール)	千□	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	28	49	4,084
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	78	6,547
CAPITALAND MALL TRUST	9	20	1,685
SUNTEC REIT	26	46	3,879
シンガポール・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	93.5 4銘柄	195 < 0.0%>
(イギリス)	千□	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	4.808	40	5,803
SEGRO PLC	5.92	36	5,279
HAMMERSON PLC	10.958	42	6,182
BRITISH LAND CO PLC	6.3	35	5,207
イギリス・ポンド 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	27.986 4銘柄	154 < 0.1%>
(ユーロ (フランス))	千□	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.249	193	24,955

銘柄	2018年11月30日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千ユーロ	千円
ICADE	0.406	28	3,737
GECINA SA	0.334	41	5,410
KLEPIERRE	2.394	69	9,037
COVIVIO	0.353	30	3,983
通 貨 □ 計	□ 数、金額	4,736	364
	銘柄数<比率>	5銘柄	< 0.1%>
合 計	□ 数、金額	537,421	-
	銘柄数<比率>	68銘柄	< 2.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2018年11月30日現在		
	買 建 額	売 建 額	
外	百万円	百万円	
	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	1,634	-
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	171	-
国	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	131	-
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	184	-
	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	112	-
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	401	-

(注1) 外貨建の評価額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書 第10期 (決算日 2018年1月10日)

(計算期間 2017年1月11日～2018年1月10日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

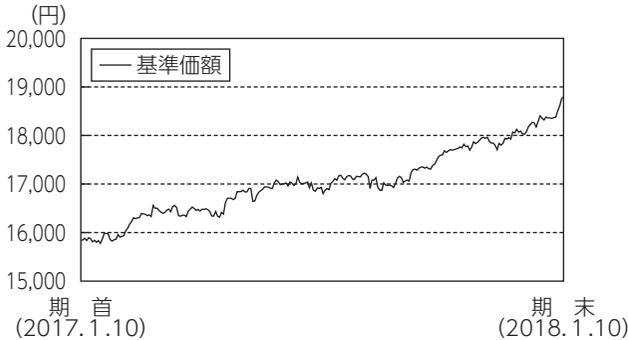
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：15,841円 期末：18,797円 騰落率：18.7%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○外国株式市況

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は16.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.7%となりました。ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。その他、ファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買手数料・保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 12,320.9 (71.17)	千アメリカ・ドル 85,224 (△ 71.7)	百株 1,269.88	千アメリカ・ドル 7,409
	カナダ	百株 1,722.5 (△ 26.7)	千カナダ・ドル 6,638 ()	百株 214.32	千カナダ・ドル 519
	オーストラリア	百株 2,524.19 (△ 364.22)	千オーストラリア・ドル 4,188 (△ 270)	百株 204.3	千オーストラリア・ドル 244
	香港	百株 5,091 (△ 101.42)	千香港ドル 13,906 (△ 331)	百株 343.44	千香港ドル 1,097
	シンガポール	百株 1,540 ()	千シンガポール・ドル 843 ()	百株 122	千シンガポール・ドル 44
	ニュージーランド	百株 206.79 ()	千ニュージーランド・ドル 115 ()	百株 -	千ニュージーランド・ドル -
	イギリス	百株 12,072.36 (△ 39.41)	千イギリス・ポンド 7,367 (△ 6)	百株 401.44	千イギリス・ポンド 237
	イスラエル	百株 120.48 ()	千イスラエル・シェケル 424 ()	百株 -	千イスラエル・シェケル -
	スイス	百株 656.26 (7.33)	千スイス・フラン 4,481 (△ 47)	百株 41.44	千スイス・フラン 714
	デンマーク	百株 254.62 ()	千デンマーク・クローネ 6,673 ()	百株 12.3	千デンマーク・クローネ 427
国	ノルウェー	百株 210.62 ()	千ノルウェー・クローネ 2,600 (△ 29)	百株 -	千ノルウェー・クローネ -

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 売付()内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

	買		付		売		付		
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額	
外	アメリカ	千口 50.39 (1.078)	千アメリカ・ドル 2,772 (2,772.51)	千口 2,778 (-)	千アメリカ・ドル 252 (-)	千口 -	千カナダ・ドル -	千口 -	千カナダ・ドル -
	カナダ	千口 3.4 (-)	千カナダ・ドル 80 (-)	千口 -	千カナダ・ドル -	千口 -	千オーストラリア・ドル -	千口 -	千オーストラリア・ドル -
	オーストラリア	千口 77.443 (25.756)	千オーストラリア・ドル 503 (240)	千口 4,552 (-)	千オーストラリア・ドル 45 (-)	千口 -	千香港ドル -	千口 -	千香港ドル -
	香港	千口 4 (34)	千香港ドル 210 (331)	千口 -	千香港ドル -	千口 -	千シンガポール・ドル -	千口 -	千シンガポール・ドル -
	シンガポール	千口 54 (-)	千シンガポール・ドル 106 (△0)	千口 -	千シンガポール・ドル -	千口 -	千イギリス・ポンド -	千口 -	千イギリス・ポンド -
	イギリス	千口 22,604 (△0.321)	千イギリス・ポンド 113 (△3)	千口 8,425 (-)	千イギリス・ポンド 16 (-)	千口 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -
国	ユーロ (フランス)	千口 1,992 (-)	千ユーロ 171 (△0)	千口 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 外国株式

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

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	18.25	41.25	305	34,348	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2	12	18	2,038	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	2.01	17.01	23	2,697	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	19.5	37.5	150	16,960	生活必需品
BUNGE LTD	3	9.5	66	7,438	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	13	24	237	26,669	情報技術
APPLE INC	171.5	355.5	6,197	696,901	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14	27	211	23,754	金融
BOEING CO/THE	18.5	39.3	1,251	140,723	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6	9.5	69	7,820	金融
SPECTRA ENERGY CORP	23.5	-	-	-	その他
BECTON DICKINSON AND CO	6.73	19.11	432	48,655	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	-	15	41	4,672	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	-	8.5	56	6,331	情報技術
CDK GLOBAL INC	6	11	79	8,910	情報技術
NISOURCE INC	9	20	49	5,555	公益事業
CH. ROBINSON WORLDWIDE INC	3	10.5	96	10,798	資本財・サービス
CR BARD INC	2	-	-	-	その他
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32	72.5	402	45,295	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	127.44	283.44	1,462	164,495	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	37	86.2	1,750	196,791	金融
ANSYS INC	2	4.5	69	7,850	情報技術
H&R BLOCK INC	3	16	42	4,757	一般消費財・サービス
BB&T CORP	24.5	54	281	31,630	金融
BAKER HUGHES INC	13.81	-	-	-	その他
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	52.5	110	680	76,505	ヘルスケア
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1	-	-	-	生活必需品
JPMORGAN CHASE & CO	113	240	2,617	294,304	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	7.5	15.5	173	19,477	金融
CIGNA CORP	8	16.5	342	38,568	ヘルスケア
LKQ CORP	12	20.5	86	9,679	一般消費財・サービス
COMPUTER SCIENCES CORP	5	-	-	-	その他
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	2	2	23	2,656	金融
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	19.21	-	-	-	電気通信サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9	14.5	97	10,997	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	8	17	76	8,615	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5.5	9.5	165	18,596	金融
DOLLAR GENERAL CORP	7.5	18.5	174	19,607	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	6	11.5	155	17,516	情報技術
CATERPILLAR INC	17.5	41	682	76,731	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	11	17	77	8,738	公益事業
MOSAIC CO/THE	7	30	78	8,808	素材
DELTA AIR LINES INC	4	10	54	6,091	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7	-	-	-	その他
CORNING INC	31	59	198	22,325	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	157.5	348.5	1,383	155,540	情報技術
DU PONT (ELI) DE NEMOURS	26	-	-	-	その他
MORGAN STANLEY	43.5	92.5	493	55,440	金融
WABCO HOLDINGS INC	1.2	3.2	47	5,391	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DOW CHEMICAL CO/THE	33.5	—	—	—	その他
MSCI INC	1.5	7.3	97	11,008	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	2.2	46	5,236	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	2	4	53	6,039	資本財・サービス
COTY INC—CL A	11.17	24.17	49	5,596	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	10	42	4,753	情報技術
BROADCOM LTD	11.84	27.24	731	82,245	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	1	3	45	5,073	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	2	—	—	—	一般消費財・サービス
ACUIITY BRANDS INC	1	3.5	55	6,216	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	7	91	10,291	ヘルスケア
ARAMARK	10	17	74	8,329	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5	14	46	5,181	素材
DTE ENERGY COMPANY	5	13.5	142	16,043	公益事業
CENTENE CORP	5	12	127	14,299	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	6	78	8,824	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15.5	30.5	134	15,155	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7.5	12	76	8,586	金融
GARTNER INC	2.5	5	64	7,250	情報技術
SPLUNK INC	6.5	11	98	11,066	情報技術
WHITEWAVE FOODS CO	7.5	—	—	—	その他
AGCO CORP	1	5	36	4,150	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	18.5	44.5	343	38,636	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	10.5	27.5	180	20,248	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	3	8	50	5,689	資本財・サービス
DEERE & CO	8	18.5	306	34,450	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	5.5	12	125	14,143	情報技術
TIME WARNER INC	25.16	51.66	476	53,606	一般消費財・サービス
VMWARE INC—CLASS A	2	5	64	7,268	情報技術
CHEMOURS CO/THE	—	14	70	7,918	素材
TEGNA INC	11.5	—	—	—	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	5	8.5	68	7,662	金融
VAIL RESORTS INC	—	2.4	51	5,757	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	—	8.5	54	6,161	金融
TARGA RESOURCES CORP	6	11	53	6,001	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2.5	4.5	71	8,092	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	4.5	48	5,451	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	11	22.5	184	20,749	公益事業
COGNEX CORP	—	14	94	10,664	情報技術
MEDNAX INC	3	—	—	—	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5	7.5	85	9,561	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC	2	3	78	8,843	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2	5	60	6,764	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC—CLASS A	—	6.5	37	4,241	ヘルスケア
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	3	7	46	5,190	資本財・サービス
IDEX CORP	—	4.5	61	6,869	資本財・サービス
COLGATE—PALMOLIVE CO	25.5	57.5	434	48,907	生活必需品
ROLLINS INC	—	7	33	3,749	資本財・サービス
AMETEK INC	9.75	14.75	109	12,273	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	9	14	70	7,932	生活必需品
KNIGHT—SWIFT TRANSPORTATION	—	10	44	5,049	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU—CL A	11.5	24.5	282	31,724	素材

銘柄	期首		期末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
COSTCO WHOLESALE CORP	13.5	30	558	62,844	生活必需品
SCANA CORP	3	7	31	3,526	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1	4	80	9,008	金融
VR GRACE & CO	1.5	5.5	40	4,508	素材
VALSPAR CORP/THE	2	—	—	—	その他
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.8	1.4	44	5,027	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	14	28	77	8,690	金融
UGI CORP	5	10	47	5,373	公益事業
CUMMINS INC	5	11	200	22,507	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	19.5	48.5	321	36,098	情報技術
SABRE CORP	5	16	33	3,711	情報技術
CDW CORP/DE	3	13	94	10,651	情報技術
SIGNATURE BANK	1.5	3.5	49	5,589	金融
COSTAR GROUP INC	1.5	2.5	78	8,845	情報技術
SVB FINANCIAL GROUP	—	3	74	8,328	金融
AMERCO	—	0.7	26	2,951	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	4.4	61	6,900	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	1.5	2.8	94	10,631	情報技術
HANESBRANDS INC	17	29	63	7,086	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	4.5	54	6,123	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5.83	15.33	125	14,123	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	10.5	40	4,571	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	—	2.5	64	7,202	情報技術
DEXCOM INC	4	—	—	—	ヘルスケア
DIAMONDBACK ENERGY INC	3	6	76	8,601	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	4	10	55	6,233	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	3	5	125	14,137	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	2	3.5	98	11,114	資本財・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	5	—	—	—	不動産
NIELSEN HOLDINGS PLC	11.5	25	90	10,213	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	58.96	146.96	278	31,299	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	11	22	189	21,275	ヘルスケア
COBALT OIL & GAS CORP	18	29.5	85	9,659	エネルギー
T—MOBILE US INC	10.5	19.5	127	14,384	電気通信サービス
ZILLION GROUP INC—C	—	7	29	3,319	情報技術
COCA—COLA CO/THE	128.5	283	1,308	147,119	生活必需品
COCA—COLA EUROPEAN PARTNERS	—	16	63	7,133	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	7.5	12.5	82	9,284	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	6	6	35	3,954	金融
FM TECHNOLOGIES INC	11	—	—	—	その他
FRANKLIN RESOURCES INC	15	22	96	10,801	金融
CSX CORP	31	64.5	382	42,981	資本財・サービス
FLUOR CORP	3	7	37	4,235	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3.5	7.5	127	14,382	ヘルスケア
EXPEDIA INC	4	8	101	11,450	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	3.5	5.5	72	8,206	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	12.7	28.2	3,532	397,242	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC—CLASS A	7	16	48	5,424	エネルギー
FLOWSERVE CORP	3	9	38	4,382	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7.5	13	155	17,470	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	131.76	294.26	2,553	287,117	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	1	8	39	4,443	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
AES CORP	17	40	43	4,839	公益事業		
L3 TECHNOLOGIES INC	2.5	6.5	133	14,983	資本財・サービス		
EVEREST RE GROUP LTD	1	3.5	75	8,538	金融		
EOG RESOURCES INC	19	39.5	441	49,619	エネルギー		
EQT CORP	6	19	111	12,541	エネルギー		
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7	12.5	84	9,486	情報技術		
AMERISOURCEBERGEN CORP	7	10	97	10,966	ヘルスケア		
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9.5	25	179	20,176	ヘルスケア		
FORD MOTOR CO	108.5	247.5	323	36,403	一般消費財・サービス		
TESARO INC	-	2	15	1,717	ヘルスケア		
MACY'S INC	12	22	54	6,108	一般消費財・サービス		
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	2	11	23	2,677	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5.16	12.16	42	4,792	一般消費財・サービス		
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3	12.5	25	2,881	一般消費財・サービス		
MOBILEYE NV	5	-	-	-	情報技術		
AERCAP HOLDINGS NV	8.5	8.5	45	5,111	資本財・サービス		
FORTINET INC	3.5	10.5	46	5,232	情報技術		
MARKEL CORP	0.5	1.1	123	13,886	金融		
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	-	8	18	2,061	エネルギー		
NEXTERA ENERGY INC	14	33.3	505	56,857	公益事業		
FREEMONT-ET-MCMORAN INC	38.5	94.5	178	20,105	素材		
US BANCORP	54	112	624	70,251	金融		
UNITED RENTALS INC	2	6	103	11,633	資本財・サービス		
F5 NETWORKS INC	3	5.5	75	8,525	情報技術		
FASTENAL CO	9.5	20.5	113	12,761	資本財・サービス		
FISERV INC	6.5	15	204	22,988	情報技術		
GENERAL ELECTRIC CO	281.5	607.5	1,127	126,789	資本財・サービス		
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	7.5	12.5	68	7,722	一般消費財・サービス		
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	11.5	22.5	76	8,574	一般消費財・サービス		
GENERAL MOTORS CO	44	89	392	44,085	一般消費財・サービス		
TRIPADVISOR INC	2	7	24	2,722	一般消費財・サービス		
GENERAL DYNAMICS CORP	8.5	17.5	360	40,514	資本財・サービス		
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11.5	26.1	662	74,529	金融		
ALPHABET INC-CL A	9.3	20.7	2,303	259,025	情報技術		
ALPHABET INC-CL C	9.71	21.71	2,401	270,070	情報技術		
OWENS CORNING	-	8	75	8,469	資本財・サービス		
GENERAL MILLS INC	19	37.5	222	25,014	生活必需品		
FIRSTENERGY CORP	13.17	30.17	90	10,198	公益事業		
GENUINE PARTS CO	5.5	12	118	13,352	一般消費財・サービス		
IHS MARKIT LTD	13.55	26.05	121	13,709	資本財・サービス		
FIFTH THIRD BANCORP	23.5	45.5	142	15,988	金融		
HARRIS CORP	5	7.5	109	12,281	資本財・サービス		
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3	9.5	49	5,563	資本財・サービス		
HALLIBURTON CO	25	59.5	310	34,865	エネルギー		
HOME DEPOT INC	39.5	82	1,583	178,055	一般消費財・サービス		
ASSURANT INC	2.5	2.5	24	2,786	金融		
HUNTINGTON BANCSHARES INC	36.5	76.5	116	13,101	金融		
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2	3.5	83	9,414	資本財・サービス		
HERSHEY CO/THE	4.5	9.5	108	12,154	生活必需品		
HARLEY-DAVIDSON INC	4	14	73	8,228	一般消費財・サービス		
HUMANA INC	4.5	9.5	249	28,104	ヘルスケア		
NXP SEMICONDUCTORS NV	10	20.5	242	27,305	情報技術		

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	
			千ドル	千円			
HELMERICH & PAYNE	6	6	40	4,602	エネルギー		
HENRY SCHEIN INC	2.5	11	80	9,085	ヘルスケア		
HP INC	58	107.5	234	26,364	情報技術		
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	50	102.5	152	17,116	情報技術		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4	11	43	4,894	一般消費財・サービス		
HOLLYFRONTIER CORP	2	11	56	6,340	エネルギー		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	-	13.5	45	5,093	一般消費財・サービス		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2	8.5	33	3,800	一般消費財・サービス		
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5	8	69	7,847	金融		
HARMAN INTERNATIONAL	1.5	-	-	-	その他		
KRAFT HEINZ CO/THE	18.5	40	314	35,363	生活必需品		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	29	60	982	110,536	情報技術		
INTERNATIONAL PAPER CO	13.5	30.5	187	21,089	素材		
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4	9	63	7,116	資本財・サービス		
ZOETIS INC	16.5	36.5	274	30,828	ヘルスケア		
INGERSOLL-RAND PLC	9.65	16.65	151	17,017	資本財・サービス		
CHENIERE ENERGY INC	5	17.5	94	10,614	エネルギー		
ALLEGION PLC	-	5.5	45	5,129	資本財・サービス		
LEGGETT & PLATT INC	2	6.5	31	3,504	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18.86	35.86	119	13,480	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC-C	1.35	-	-	-	その他		
WASTE CONNECTIONS INC	7	20	140	15,792	資本財・サービス		
JUNIPER NETWORKS INC	9	28.5	81	9,175	情報技術		
JM SMUCKER CO/THE	4	9	114	12,831	生活必需品		
JOHNSON & JOHNSON	86	183.14	2,639	296,843	ヘルスケア		
ABBVIE INC	51.66	111.66	1,119	125,863	ヘルスケア		
HOLOGIC INC	11	18	79	8,950	ヘルスケア		
KIMBERLY-CLARK CORP	10.5	23	268	30,208	生活必需品		
KROGER CO	30	56	155	17,487	生活必需品		
KLA-TENCOR CORP	5	11	120	13,507	情報技術		
LOCKHEED MARTIN CORP	8.2	17.9	591	66,526	資本財・サービス		
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3.3	7.3	143	16,164	情報技術		
L BRANDS INC	8.5	19.5	92	10,389	一般消費財・サービス		
LOWE'S COS INC	27.5	58	548	61,666	一般消費財・サービス		
ELI LILLY & CO	31.5	71	611	68,709	ヘルスケア		
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	10	-	-	-	その他		
LAM RESEARCH CORP	6	10.5	207	23,327	情報技術		
RANGE RESOURCES CORP	3	10	17	1,918	エネルギー		
JONES LANG LASALLE INC	1	3	46	5,191	不動産		
LOEWS CORP	12	18	92	10,349	金融		
LINCOLN NATIONAL CORP	9	13	106	11,940	金融		
MCDONALD'S CORP	26	57	989	111,233	一般消費財・サービス		
3M CO	19	42	1,013	113,954	資本財・サービス		
FACEBOOK INC-A	72.5	164.5	3,090	347,522	情報技術		
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	8.17	12.17	102	11,533	情報技術		
MANPOWERGROUP INC	1	3.5	45	5,135	資本財・サービス		
S&P GLOBAL INC	9	16.9	299	33,682	金融		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2.3	3.5	79	8,973	素材		
CONCHO RESOURCES INC	4	9.5	147	16,557	エネルギー		
ENVISION HEALTHCARE CORP	5.33	5.33	18	2,092	ヘルスケア		
FIRST DATA CORP-CLASS A	18.5	38.5	66	7,476	情報技術		
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8	8	29	3,266	電気通信サービス		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

銘柄	期首		当期		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			
WABTEC CORP	2	5	41	4,671	資本財・サービス		
TJX COMPANIES INC	20.5	45.5	343	38,629	一般消費財・サービス		
WATERS CORP	2.5	6.5	135	15,273	ヘルスケア		
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3.5	3.5	23	2,695	資本財・サービス		
ALLERGAN PLC	12.59	24.49	430	48,372	ヘルスケア		
WHOLE FOODS MARKET INC	7	—	—	—	その他		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	28.5	61	447	50,362	生活必需品		
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4.13	8.13	123	13,880	金融		
WESTERN DIGITAL CORP	9.95	21.45	172	19,445	情報技術		
WEC ENERGY GROUP INC	8.5	22	142	16,058	公益事業		
WESTAR ENERGY INC	4	9	47	5,287	公益事業		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	15	35	173	19,533	公益事業		
VISA INC-CLASS A SHARES	59	127.5	1,518	170,772	情報技術		
PPL CORP	18	46	144	16,206	公益事業		
PULTEGROUP INC	7	19	65	7,403	一般消費財・サービス		
PPG INDUSTRIES INC	9	17.1	202	22,732	素材		
NORTHERN TRUST CORP	6.5	16	166	18,758	金融		
NVIDIA CORP	16	42.5	943	106,067	情報技術		
IAC/INTERACTIVECORP	—	6	80	9,009	情報技術		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15.03	33.03	488	54,903	金融		
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	18	29	76	8,547	一般消費財・サービス		
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	12	46	5,270	資本財・サービス		
TYSON FOODS INC-CL A	7.5	19.5	160	18,037	生活必需品		
NETFLIX INC	13	30	627	70,610	一般消費財・サービス		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12	27.5	566	63,733	ヘルスケア		
TORCHMARK CORP	3.5	6.5	59	6,729	金融		
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5	9	79	8,926	金融		
TEXTRON INC	10	16	93	10,516	資本財・サービス		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	37.5	78.5	286	32,255	一般消費財・サービス		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-B	9	32	115	13,019	一般消費財・サービス		
NEWS CORP-CLASS A	8	29	48	5,504	一般消費財・サービス		
OGC ENERGY CORP	5	12	38	4,331	公益事業		
OMNICOM GROUP	7.5	18.5	133	14,994	一般消費財・サービス		
ORACLE CORP	99	217	1,064	119,714	情報技術		
MASTERCARD INC-A	30	63.5	1,012	113,892	情報技術		
ONEOK INC	5	22.5	127	14,292	エネルギー		
CENTURYLINK INC	16.97	54.39	89	10,116	電気通信サービス		
ROPER TECHNOLOGIES INC	3.5	7.5	202	22,798	資本財・サービス		
YUM! BRANDS INC	1.5	2.1	173	19,543	一般消費財・サービス		
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	8	91	10,337	情報技術		
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2.5	4	107	12,052	情報技術		
MOLSON COORS BREWING CO-B	6.5	12.5	104	11,755	生活必需品		
NOBLE ENERGY INC	10.5	37.5	117	13,186	エネルギー		
BANK OF AMERICA CORP	322.63	682.63	2,066	232,357	金融		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5	11	98	11,026	ヘルスケア		
NORDSTROM INC	2	8	38	4,308	一般消費財・サービス		
AMERICAN EXPRESS CO	25	52.5	527	59,343	金融		
ANALOG DEVICES INC	8	23.44	214	24,154	情報技術		
ADVANCED MICRO DEVICES	—	58	68	7,709	情報技術		
TD AMERITRADE HOLDING CORP	10	17.08	91	10,308	金融		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32.2	61.7	374	42,066	金融		
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1	—	—	—	素材		

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ANADARKO PETROLEUM CORP	18	43	238	26,845	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7	12	120	13,585	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5.5	11	135	15,233	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	5	12	41	4,658	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	2	—	—	—	ヘルスケア
EVERETT DENNISON CORP	3	6.5	77	8,691	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19.5	38	279	31,390	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	21	44.5	321	36,189	資本財・サービス
AON PLC	8.5	17	232	26,174	金融
AMGEN INC	24	49	898	101,043	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N.V.	1	—	—	—	エネルギー
TAPESTRY INC	12	18	81	9,179	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	15.12	30.62	251	28,227	資本財・サービス
CELGENE CORP	24.5	52.5	553	62,277	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6	11.5	255	28,718	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	33.5	77.1	422	47,563	情報技術
CIT GROUP INC	9	9	46	5,200	金融
CIMAREX ENERGY CO	2.5	8	102	11,479	エネルギー
CME GROUP INC	10	23	351	39,475	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	14.89	21.89	83	9,412	エネルギー
ECOLAB INC	8.5	17	232	26,124	素材
EQUIFAX INC	4.5	8.5	103	11,684	資本財・サービス
GAP INC/THE	3	13	41	4,676	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	41.5	90	702	79,041	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4.76	10.76	102	11,557	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	6	22	80	9,004	生活必需品
STATE STREET CORP	13	26.5	268	30,216	金融
STAPLES INC	8	—	—	—	その他
SUNTRUST BANKS INC	13.5	34	227	25,596	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	35.5	81	432	48,584	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	13	33.5	232	26,135	ヘルスケア
B/E AEROSPACE INC	2.5	—	—	—	その他
CAMPBELL SOUP CO	8	13	61	6,914	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	3	8	45	5,089	素材
CARDINAL HEALTH INC	9.5	24.5	164	18,486	ヘルスケア
FEDEX CORP	8.5	18	481	54,195	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15	33	335	37,735	金融
FMC CORP	3	7.5	73	8,276	素材
FLEX LTD	10	45	84	9,457	情報技術
CERNER CORP	9.5	18.5	132	14,915	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	6.5	100	11,275	素材
CITRIX SYSTEMS INC	5.5	9.5	86	9,741	情報技術
INTEL CORP	148.5	322.5	1,406	158,188	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	17	28	56	6,394	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10.5	28.5	156	17,616	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	10	22.5	379	42,723	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30	80	42	4,776	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	5.5	11.1	269	30,306	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	8.5	14.5	71	7,984	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	1.3	7.5	298	33,532	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6	8.5	87	9,864	情報技術
SNAP-ON INC	1.5	3	53	6,030	資本財・サービス

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円	
BIOGEN INC	6.5	14.5	487	54,844	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	2	5.5	91	10,249	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	46.5	103.5	612	68,877	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	5	9	81	9,193	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	10	24	148	16,673	公益事業
INTUIT INC	8	16	263	29,659	情報技術
BORGWARNER INC	9	15.5	86	9,715	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	11	17	118	13,339	一般消費財・サービス
BALL CORP	5.46	18.92	72	8,191	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	45.5	102.5	286	32,227	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC	3	-	-	-	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD	12	18.5	63	7,116	金融
ELECTRONIC ARTS INC	10.5	22.5	252	28,382	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	3.5	10.5	140	15,838	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6.5	17.7	276	31,051	ヘルスケア
VF CORP	11	21	159	17,977	一般消費財・サービス
GBS CORP - CLASS B NON VOTING	14	22	123	13,851	一般消費財・サービス
VIACOM INC - CLASS B	14	20	58	6,531	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	2.5	4.8	134	15,101	一般消費財・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5	-	-	-	情報技術
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3	6	67	7,619	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	10	24.5	165	18,632	一般消費財・サービス
COMCAST CORP - CLASS A	75	318	1,291	145,217	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	-	11	43	4,913	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10	15	93	10,503	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20	110	78	8,856	不動産
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	9,721.77 20,843.96	164.975	18,551,533	
(カナダ)		594銘柄 600銘柄	千カナダ・ドル	千円	<61.0%>
IMPERIAL OIL LTD	14	23	91	8,212	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.5	1.5	109	9,895	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9.38	9.38	29	2,678	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	8.21	14.21	110	9,987	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9	22	57	5,207	素材
INTACT FINANCIAL CORP	3	10	103	9,315	金融
BCE INC	3	9	52	4,753	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	7	11	107	9,714	素材
SUNCOR ENERGY INC	61.12	118.12	555	50,059	エネルギー
METRO INC	6	16	66	6,010	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	10	23	146	13,206	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	43	82	679	61,273	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14	29	357	32,276	金融
TORONTO - DOMINION BANK	63	126	931	83,994	金融
GREAT - WEST LIFE CO INC	7	17	59	5,331	金融
ROYAL BANK OF CANADA	51	98	1,027	92,643	金融
TOURMALINE OIL CORP	13	13	27	2,452	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	4	4	19	1,713	エネルギー
TRANSCANADA CORP	27	57	347	31,377	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	18	37.1	169	15,263	エネルギー
BOMBARDIER INC - B	47	192	56	5,107	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	47	83	150	13,576	素材
CAE INC	7	23	54	4,873	資本財・サービス

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・ドル	千円	
THOMSON REUTERS CORP	14.2	20.2	110	9,977	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	26	-	-	-	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	-	18	44	4,018	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	-	6	49	4,449	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1	10	57	5,139	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	19	19	17	1,615	金融
LINAMAR CORP	-	6	44	4,045	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	11	11	19	1,745	エネルギー
HYDRO ONE LTD	15	15	33	2,994	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	9.89	14.89	101	9,111	生活必需品
CANADIAN UTILITIES LTD - A	10	10	36	3,282	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC - B	15	22	138	12,505	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	6	18	104	9,455	素材
KINROSS GOLD CORP	25.34	105.34	54	4,910	素材
BANK OF MONTREAL	22	46	471	42,477	金融
POWER CORP OF CANADA	16	31	99	9,000	金融
METHANEX CORP	6	6	45	4,139	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	-	5	68	6,219	情報技術
NUTRIEN LTD	-	43.27	284	25,633	素材
CAMECO CORP	4	28	32	2,941	エネルギー
TELUS CORP	3	3	13	1,259	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	10	20	68	6,183	金融
TECK RESOURCES LTD - CLS B	17	44	156	14,088	素材
CANADIAN TIRE CORP - CLASS A	3	5	83	7,551	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80	80	33	3,051	素材
AGRIUM INC	6	-	-	-	その他
CANADIAN NATURAL RESOURCES	41	78	359	32,388	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0.5	2	128	11,582	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	1.2	24	177	15,975	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	2	2	21	1,959	生活必需品
BLACKBERRY LTD	27	27	48	4,367	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	19	42	216	19,522	金融
ENBRIDGE INC	30	115	576	52,024	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE - CL A	31	55	298	26,924	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	63	138	367	33,174	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	-	20	59	5,368	ヘルスケア
GOLDCORP INC	26	63	106	9,577	素材
ENCANA CORP	44	69	117	10,583	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4	10	232	20,995	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	4	11	66	5,974	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4	14	56	5,106	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	25	53	554	50,041	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	7	13	87	7,857	情報技術
HUSKY ENERGY INC	6.12	30.12	55	5,000	エネルギー
ONEX CORPORATION	3	7	63	5,680	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC - B	22	39	110	9,973	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	7	7	22	2,057	資本財・サービス
SNC - LAVALIN GROUP INC	3	9	51	4,625	資本財・サービス
ELDORADO GOLD CORP	3	-	-	-	素材
IGM FINANCIAL INC	3	3	13	1,185	金融
OPEN TEXT CORP	3	14	58	5,318	情報技術
CI FINANCIAL CORP	6	20	58	5,298	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		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	千カナダ・ドル	千円		
SAPUTO INC	6	13	56	5,123	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33	63	117	10,588	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	13	30	199	17,975	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	52	-	-	-	素材	
FORTIS INC	13	30	134	12,118	公益事業	
LUNDIN MINING CORP	-	66	55	5,022	素材	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	25	25	26	2,360	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	25	80	103	9,327	エネルギー	
DOLLARAMA INC	2	9	139	12,538	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	-	8	35	3,173	公益事業	
ALTAGAS LTD	8	8	23	2,080	エネルギー	
FIRST CAPITAL REALTY INC	-	20	42	3,814	不動産	
KEYERA CORP	7	7	25	2,283	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	7	-	-	-	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	8	20	52	4,701	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	10	28	39	3,597	エネルギー	
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 総額数<比率>	1,396.26	2,877.74	12,443	1,122,012	
(オーストラリア)		82銘柄	86銘柄		< 3.7% >	
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
HEALTHSCOPE LTD	-	160	32	2,882	ヘルスケア	
MEDIBANK PRIVATE LTD	93	228.24	73	6,458	金融	
BHP BILLITON LIMITED	116	219.58	682	59,935	素材	
SOUTH32 LTD	225	362.13	135	11,870	素材	
LENLEASE GROUP	20	-	-	-	不動産	
ALUMINA LTD	121	121	30	2,690	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	20	57.74	200	17,582	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	48	105	55	4,899	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	8	36	42	3,758	金融	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	87	172.43	510	44,883	金融	
WESTPAC BANKING CORP	108.5	230.26	726	63,842	金融	
SANTOS LTD	96	96	53	4,715	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	97	190.88	552	48,545	金融	
RIO TINTO LTD	12	31.47	251	22,088	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	68	120.5	117	10,335	エネルギー	
AMCOR LIMITED	51	74.96	113	9,980	素材	
AURIZON HOLDINGS LTD	85	153.1	74	6,511	資本財・サービス	
OIL SEARCH LTD	32	84	67	5,949	エネルギー	
SEEK LTD	26	26	50	4,398	資本財・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	26	55.92	86	7,558	生活必需品	
NEWCREST MINING LTD	22	58.04	134	11,828	素材	
INCITEC PIVOT LTD	73	73	29	2,553	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	58	116.77	959	84,341	金融	
CALTEX AUSTRALIA LTD	8	20	69	6,063	エネルギー	
ORICA LTD	20	20	37	3,300	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	60	88	92	8,151	金融	
CIMIC GROUP LTD	-	10	51	4,517	資本財・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	49	95.16	259	22,804	生活必需品	
COCA-COLA AMATIL LTD	26	26	21	1,930	生活必需品	
TABCORP HOLDINGS LTD	24	88	46	4,121	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	-	30	38	3,411	一般消費財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	136	351.14	131	11,571	電気通信サービス	
AMP LTD	93.13	165.13	86	7,575	金融	

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港ドル	千円	
KERRY PROPERTIES LTD	—	75	273	3,936	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	20	86	291	4,198	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	—	60	265	3,813	不動産
SJM HOLDINGS LTD	100	100	73	1,058	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	212	3,054	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	105.52	185.52	1,329	19,114	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20	55	370	5,326	公益事業
PCCW LTD	—	600	286	4,124	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	380	876	5,807	83,517	金融
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	—	320	262	3,773	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	140	742	10,669	不動産
SANDS CHINA LTD	102	166	694	9,989	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	40	40	71	1,027	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	55	120	617	8,878	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	—	140	324	4,670	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	155	290	1,154	16,597	金融
WYNN MACAU LTD	60	60	145	2,092	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	130	—	—	—	電気通信サービス
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,831.45 32銘柄	7,477.59 40銘柄	27,290 392,436	< 1.3% >
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	53	90	250	21,056	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	68	128	339	28,557	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	20	20	21	1,844	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	28	93	73	6,144	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	—	52	48	4,061	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	10	10	12	1,077	不動産
CAPITALAND LTD	70	190	71	6,044	不動産
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING	—	270	42	3,590	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	120	32	2,746	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	—	9	36	3,102	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	105	218	281	23,685	金融
GENTING SINGAPORE PLC	450	450	60	5,074	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	277	484	175	14,786	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	40	141	47	3,963	資本財・サービス
SEMPACORP INDUSTRIES LTD	40	40	12	1,063	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	90	90	3	291	生活必需品
SATS LTD	—	77	42	3,538	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	20	69	52	4,424	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	100	20	1,683	資本財・サービス
STARHUB LTD	120	120	34	2,918	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	50	158	50	4,268	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	40	190	64	5,388	不動産
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,701 18銘柄	3,119 22銘柄	1,774 149,314	< 0.5% >
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージー ランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	44	3,593	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	56	168.6	60	4,879	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	31	81	53	4,294	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	19	19	14	1,180	素材

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

(2) 外国投資信託受益証券

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

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

(3) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.372	0.872	150	16,970
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.934	2.094	346	38,977
BOSTON PROPERTIES INC	0.55	1.15	144	16,216
GGP INC	1.7	4	92	10,453
VORNADO REALTY TRUST	0.606	1.156	85	9,584
SBA COMMUNICATIONS CORP	-	0.8	130	14,712
EQUITY RESIDENTIAL	1	2.25	140	15,775
EQUINIX INC	0.234	0.514	234	26,355
AMERICAN TOWER CORP	1.3	3.1	437	49,169
HOST HOTELS & RESORTS INC	2.728	4.228	86	9,717
KIMCO REALTY CORP	1.8	3.3	56	6,390
PARK HOTELS & RESORTS INC	0.35	-	-	-
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	-	3.5	38	4,325
INVITATION HOMES INC	-	2.2	50	5,645
VENTAS INC	1.25	2.7	155	17,515
WEYERHAEUSER CO	2.504	4.904	172	19,444
AGNC INVESTMENT CORP	0.7	2.1	41	4,670
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1.4	1.4	24	2,717
CROWN CASTLE INTL CORP	1.15	2.8	301	33,904
IRON MOUNTAIN INC	0.918	1.718	63	7,115
VEREIT INC	4.35	7.75	58	6,527
PROLOGIS INC	1.465	3.415	213	24,058
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.2	0.7	88	9,943
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.3	0.65	57	6,450
DUKE REALTY CORP	0.8	3.1	81	9,143
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.25	0.45	106	11,955
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.25	0.45	56	6,347
WELLTOWER INC	1.2	2.35	144	16,217
HCP INC	1.2	2.8	68	7,714
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.3	1	41	4,709
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.45	0.7	66	7,478
MACERICH CO/THE	0.3	0.7	44	5,001
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3.7	9.6	110	12,425
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.65	0.65	26	3,000
REALTY INCOME CORP	0.95	1.8	97	10,980
PUBLIC STORAGE	0.45	1.1	221	24,881
REGENCY CENTERS CORP	0.3	1.15	75	8,522
SL GREEN REALTY CORP	0.4	0.65	64	7,209
UDR INC	1.2	1.9	70	7,892
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.55	1.45	163	18,359
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.5	0.8	66	7,476
アメリカ・ドル 通貨計	□数、金額 38銘柄	□数、金額 87,951 40銘柄	□数、金額 4,677	□数、金額 525,956 <1.7%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	-	2	42	3,862
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	-	1.4	34	3,096
カナダ・ドル 通貨計	□数、金額 -	□数、金額 3.4 2銘柄	□数、金額 77	□数、金額 6,959 <0.0%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE GROUP	-	4.303	69	6,095
TRANSURBAN GROUP	-	17.162	211	18,550

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額 千オーストラリア・ドル	邦貨換算金額 千円
SYDNEY AIRPORT	-	9.129	64	5,679
APA GROUP	-	7.5	61	5,424
SCENTRE GROUP	22.429	30.929	128	11,334
DEXUS	2.5	6.5	66	5,815
GPT GROUP	6.82	14.648	76	6,719
MIRVAC GROUP	13.9	31.638	73	6,478
STOCKLAND	6.1	14.3	63	5,579
WESTFIELD CORP	5.6	13.956	130	11,467
GOODMAN GROUP	8.8	14.731	124	10,900
VICINITY CENTRES	19.523	19.523	53	4,666
オーストラリア・ドル 通貨計	□数、金額 8銘柄	□数、金額 184,319 12銘柄	□数、金額 1,123	□数、金額 98,711 <0.3%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	9.5	13.5	1,002	14,414
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	-	34	344	4,947
香港・ドル 通貨計	□数、金額 1銘柄	□数、金額 47.5 2銘柄	□数、金額 1,346	□数、金額 19,362 <0.1%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	-	28	55	4,665
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	12	12	33	2,807
CAPITALAND MALL TRUST	9	9	18	1,590
SUNTEC REIT	-	26	57	4,813
シンガポール・ドル 通貨計	□数、金額 2銘柄	□数、金額 75 4銘柄	□数、金額 164	□数、金額 13,877 <0.0%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	3.05	4.808	47	7,293
SEGRO PLC	1.52	5.92	34	5,291
HAMMERSON PLC	1.2	4.9	26	3,973
BRITISH LAND CO PLC	2.3	6.3	43	6,572
イギリス・ポンド 通貨計	□数、金額 4銘柄	□数、金額 21,928 4銘柄	□数、金額 152	□数、金額 23,131 <0.1%>
(ユーロ (フランス))	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.37	0.609	128	17,292
ICADE	-	0.406	33	4,551
GECINA SA	0.14	0.334	52	7,009
KLEPIERRE	0.6	1.4	50	6,812
FONCIERE DES REGIONS	-	0.353	32	4,417
ユーロ通貨計	□数、金額 3銘柄	□数、金額 3,102 5銘柄	□数、金額 298	□数、金額 40,083 <0.1%>
合 計	□数、金額 56銘柄	□数、金額 423.2 69銘柄	□数、金額 -	□数、金額 728,082 <2.4%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年1月10日現在

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

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年1月10日現在

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

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

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) 13,970,698,284円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) 758,224,939円、i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) 61,139,199円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA510,459,045円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA858,309,210円、ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用) 13,666,240円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は18,797円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2018年1月10日

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

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

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

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

運用報告書 (全体版) 第2期

(決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式	
信託期間	無期限	
運用方針	海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券 ロ. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式 (預託証券を含みます。)
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	イ. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます。) ロ. 新興国の企業のDR (預託証券) ハ. FTSE RAFI エマーシングインデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券)
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	外国株式インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

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。

当ファンドは、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先 (コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00～17:00)

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 信 託 証 券 率 組 入 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率				
1 期末(2017年11月30日)	円 11,391	円 0	% 13.9	% 93.0	% 1.5	% 4.5	百万円 915
2 期末(2018年11月30日)	11,550	0	1.4	92.1	2.0	5.0	1,637

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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



運用経過

基準価額等の推移について



*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

期首：11,391円

期末：11,550円（分配金0円）

騰落率：1.4%（分配金込み）

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国株式インデックスマザーファンド	2.5%	79.2%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	△1.9%	20.0%

■ 基準価額の主な変動要因

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

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

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 信 組 託 入 証 比	資 券 率
	円	騰 落 率 %				
(期首) 2017年11月30日	11,391	—	93.0	1.5		4.5
12月末	11,746	3.1	92.5	1.6		4.9
2018年 1 月末	12,004	5.4	92.0	1.5		5.3
2 月末	11,494	0.9	92.8	1.5		4.7
3 月末	11,001	△3.4	94.5	1.8		2.7
4 月末	11,395	0.0	94.4	1.3		3.5
5 月末	11,325	△0.6	93.1	1.6		4.2
6 月末	11,296	△0.8	92.4	1.8		4.9
7 月末	11,820	3.8	92.2	1.4		5.4
8 月末	11,938	4.8	94.0	1.6		3.3
9 月末	12,280	7.8	93.8	1.3		3.9
10月末	11,255	△1.2	92.7	1.7		4.7
(期末) 2018年11月30日	11,550	1.4	92.1	2.0		5.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■先進国株式市況

米国・欧州を中心とする先進国株式市況は、横ばい圏で推移しました。

当作成期首より、米国の税制改革法への期待や英国のEU（欧州連合）離脱条件を巡る交渉が合意に近づいたことなどを好感し、先進国株式市況は上昇して始まりました。2018年2月以降は、米国の利上げ加速への警戒感や米中貿易摩擦が激化したことへの懸念などを嫌気し、下落しました。4月以降は、貿易摩擦問題について米中両国が歩み寄りの姿勢を示したことや好調な4～6月期の企業業績を好感し、上昇基調となりました。8月以降は、米中貿易摩擦への懸念が再燃したことや新興国通貨の急落などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落しました。当作成期末にかけては、米中貿易摩擦が深刻化したこと、米国長期金利の上昇や中東情勢の緊迫化懸念などを背景に、上値の重い展開となりました。

■先進国為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると、米ドルは対円で上昇したものの、ユーロなど他の通貨は下落しました。

当作成期首より円安が進みましたが、2018年に入ると、米国のムニューシン財務長官による米ドル安容認発言などから米ドルが下落しました。また、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや、各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。4月以降は、米国の金利が上昇したことやそれまでの米ドル安の反動もあり、米ドルが上昇傾向となりました。一方、イタリアの政治情勢への懸念が高まったことなどがユーロの下落材料となりました。8月には、トルコ情勢への警戒感が高まり市場のリスク回避姿勢が強まる中で円高傾向となりましたが、9月以降は新興国通貨安への懸念が後退し、市場のリスク回避姿勢が和らいだことを受けて円安傾向となりました。10月以降は、株価が下落し市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから円高傾向となりました。

■新興国株式市況

新興国株式市況は、まちまちの動きとなりました。

新興国株式市況は、当作成期首から、米国株式市場の上昇と中国などの堅調な景気動向を受けて大幅に上昇しました。しかし2018年2月に入ると、米国の金利上昇を要因とした米国株式市場の急落を受けて、新興国市場から資金が流出したため下落に転じました。その後も、米国トランプ政権の対中国を中心とした貿易政策に対する懸念やトルコ・リラなどの一部新興国通貨の急落などにより、新興国株式市場は上値が重い展開のまま当作成期末を迎えました。

国別では、インフレ率の低下に伴う金利引き下げが景気拡大につながっていることからロシア株式市場は堅調でした。経済政策が市場に好感されることが多かったブラジル株式市場も上昇しました。一方、政府の経済政策や中央銀行への干渉、米国との関係悪化に加えて通貨の急落など懸念材料が相次いだトルコ株式市場や、金属価格の下落および2018年4～6月期GDP（国内総生産）のマイナス成長などが悪材料となった南アフリカ株式市場は下落しました。米国との貿易摩擦が激化した中国株式市場も下落しました。

■新興国為替相場

為替相場は、米国金利の上昇と米中貿易摩擦の激化を受けて、新興国通貨全体としては対円で下落しました。

通貨別では、中央銀行の独立性に対する懸念と米国との対立激化を受けて、国外への資金流出が加速したことでトルコ・リラは急落しました。NAFTA（北米自由貿易協定）再交渉問題が悪材料となったメキシコ・ペソ、シリア問題で米国との対立が激化したことが嫌気されたロシア・ルーブル、燃料価格の上昇に端を発したトラック運転手のストなどによる経済的混乱を受けてブラジル・リアルも売られました。なお円は、日米金利差などを受けて対米ドルで当作成期を通じてやや円安となりましたが、新興国通貨は全体としては対円でも下落となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす「外国株式インデックスマザーファンド」に80%程度、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」に20%程度投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ってまいります。

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

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

株式組入比率（D R（預託証券）、E T F（上場投資信託証券）、株価指数先物を含む。以下同じ。）は、ベンチマークのリバランス時や大量設定時を除き、当作成期を通じて原則として97%以上で運用を行いました。

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

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年12月1日 ～2018年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,550

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■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は、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ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017.12.1~2018.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	39円	0.340%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,588円です。
(投 信 会 社)	(31)	(0.265)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	2	0.016	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(1)	(0.011)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.004)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0.012	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.012)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	11	0.091	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(9)	(0.073)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(1)	(0.012)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	53	0.459	

(注1) 当作成期中の費用(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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

項目	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデック ス・マザーファンド	110,433	175,670	13,914	22,306
外国株式インデック スマザーファンド	242,471	586,620	17,819	45,425

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,544,686千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,642,659千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	0.54
	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	15,302,625千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	97,909,189千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	0.15

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末	
	口 数	口 数	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千口	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	113,028	209,548	209,548	113,028	326,874
外国株式インデックスマザーファンド	305,036	529,688	529,688	305,036	1,297,524

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	326,874	19.9
外国株式インデックスマザーファンド	1,297,524	79.0
コール・ローン等、その他	17,415	1.1
投資信託財産総額	1,641,813	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1香港ドル=14.51円、1シンガポール・ドル=82.89円、1ニュージーランド・ドル=77.87円、1台湾ドル=3.68円、1イギリス・ポンド=145.01円、1イスラエル・シケル=30.60円、1スイス・フラン=113.90円、1トルコ・リラ=21.97円、1デンマーク・クローネ=17.31円、1ノルウェー・クローネ=13.28円、1スウェーデン・クローネ=12.51円、1メキシコ・ペソ=5.61円、100チリ・ペソ=16.94円、1インド・ルピー=1.64円、100インドネシア・ルピア=0.79円、1ブラジル・レアル=29.44円、1マレーシア・リンギット=27.11円、1南アフリカ・ランド=8.30円、1タイ・バーツ=3.44円、1ポーランド・ズロチ=30.14円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(6,142,117千円)の投資信託財産総額(6,297,715千円)に対する比率は、97.5%です。外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(106,744,284千円)の投資信託財産総額(107,731,273千円)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

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,641,813,617円
コール・ローン等	17,415,535
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド(評価額)	326,874,078
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,297,524,004
(B) 負債	4,539,644
未払解約金	1,793,565
未払信託報酬	2,703,093
その他未払費用	42,986
(C) 純資産総額(A - B)	1,637,273,973
元本	1,417,526,848
次期繰越損益金	219,747,125
(D) 受益権総口数	1,417,526,848口
1万口当り基準価額(C / D)	11,550円

* 期首における元本額は803,832,811円、当作成期間中における追加設定元本額は874,852,673円、同解約元本額は261,158,636円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,550円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 9,018円
受取利息	846
支払利息	△ 9,864
(B) 有価証券売買損益	13,844,910
売買益	28,737,986
売買損	△ 14,893,076
(C) 信託報酬等	△ 4,692,824
(D) 当期損益金(A + B + C)	9,143,068
(E) 前期繰越損益金	50,446,023
(F) 追加信託差損益金	160,158,034
(配当等相当額)	(60,597,183)
(売買損益相当額)	(99,560,851)
(G) 合計(D + E + F)	219,747,125
次期繰越損益金(G)	219,747,125
追加信託差損益金	160,158,034
(配当等相当額)	(60,597,183)
(売買損益相当額)	(99,560,851)
分配準備積立金	59,598,109
繰越損益金	△ 9,018

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」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	9,150,492
(c) 収益調整金	160,158,034
(d) 分配準備積立金	50,447,617
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	219,756,143
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	219,756,143
(h) 受益権総口数	1,417,526,848口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2018年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年11月30日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を92～96ページに併せて掲載いたしました。

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

(1) 株 式

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

買				売			
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
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	805	85,937	106	CHINA EVERGRANDE GROUP (ケイマン諸島)	59	20,673	350
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	208	67,147	322	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	23.1	17,313	749
CHINA MOBILE LTD (香港)	64.5	64,069	993	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	0.54	16,517	30,588
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	65	58,140	894	MTN GROUP LTD (南アフリカ)	13.55	14,931	1,101
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	910	50,910	55	RELIANCE INDUSTRIES LTD (インド)	9.73	14,420	1,482
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	462	43,476	94	PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	9.5	11,543	1,215
GAZPROM PAO -SPON ADR (ロシア)	82.27	41,458	503	VALE SA (ブラジル)	7.7	10,445	1,356
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	445	37,933	85	ICICI BANK LTD (インド)	20.734	9,940	479
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	19.1	27,091	1,418	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV (オランダ)	365.93	9,862	26
LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)	3.03	23,584	7,783	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO (ケイマン諸島)	44	9,838	223

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

買				売			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	748	1,795,977	2,401	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	570.5	1,417,246	2,484
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	22.3	3,550	159				
REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	27.44	2,600	94				
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	8.14	1,746	214				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年11月30日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド（3,983,740千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2018年11月30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		
(アメリカ)	百株	千円	千円		
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	151	83	9,509	エネルギー	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	9	140	15,959	一般消費財・サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	5	91	10,394	コミュニケーション・サービス	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	190.5	143	16,276	コミュニケーション・サービス	
JD.COM INC-ADR	12	25	2,855	一般消費財・サービス	
NETEASE INC-ADR	1	22	2,532	コミュニケーション・サービス	
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	9	25	2,863	一般消費財・サービス	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	797.14	103	11,731	金融	
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	37.2	238	27,057	エネルギー	

銘柄	2018年11月30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		
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	140.5	56	6,450	エネルギー	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	76.8	147	16,749	素材	
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	120.2	30	3,456	コミュニケーション・サービス	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	107.6	140	15,933	生活必需品	
RUSHYDRO PJSC-ADR	329.1	24	2,763	公益事業	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	419.3	498	56,546	金融	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9.3	168	19,068	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	148.7	1,065	120,878	エネルギー	
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	418.4	260	29,529	エネルギー	

銘柄	2018年11月30日現在			業種等
	株数	評価額	業種等	
MONDI LTD	13.2	411	3,418	素材
MMI HOLDINGS LTD	166	302	2,507	金融
SPAR GROUP LIMITED/THE	33.2	665	5,521	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	15.9	400	3,321	一般消費財・サービス
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	216.3	579	4,813	ヘルスケア
SIBANYE GOLD LTD	497.1	439	3,651	素材
南アフリカ・ランド 通貨計	4,087.7 35銘柄	38,967	323,432 < 5.2% >	
(タイ)	百株	千円	千円	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	73	1,540	5,298	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	139	6,143	21,134	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	164	3,148	10,831	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	117	2,246	7,727	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	385	5,255	18,078	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	211	1,107	3,810	金融
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	200	3,530	12,143	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	1,412	2,852	9,811	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	748	1,256	4,322	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	335	4,321	14,865	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	1,558	934	3,215	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	291	967	3,328	エネルギー
PTT PCL-NVDR	3,379	16,641	57,247	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	193	1,447	4,979	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	318	2,178	7,493	生活必需品
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,286	3,215	11,059	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	401	3,147	10,828	素材
タイ・パーツ 通貨計	11,210 17銘柄	59,935	206,177 < 3.3% >	
(ポーランド)	百株	千円	千円	
PKO BANK POLSKI SA	99.1	413	12,455	金融
BANK PEKAO SA	31.2	341	10,292	金融
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	122.6	526	15,870	金融
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	227.9	144	4,348	エネルギー
PGE SA	118.7	134	4,067	公益事業
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	61.9	698	21,054	エネルギー
KGHM POLSKA MIEDZ SA	36.4	328	9,904	素材
ポーランド・スロチ 通貨計	697.8 7銘柄	2,587	77,992 < 1.3% >	
ファンド合計	株数、金額 313,069.63 銘柄数<比率> 355銘柄	---	5,197,515 < 83.6% >	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2018年11月30日現在		
	株数	評価額	業種等
(アメリカ)	千口	千円	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	388	7,992	906,943
アメリカ・ドル 通貨計	388 1銘柄	7,992	906,943 < 14.6% >
(メキシコ)	千口	千円	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	46.8	979	5,497
メキシコ・ペソ 通貨計	46.8 1銘柄	979	5,497 < 0.1% >
(南アフリカ)	千口	千円	千円
REDEFINE PROPERTIES LTD	61.79	604	5,015
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	35.3	839	6,967
南アフリカ・ランド 通貨計	97.09 2銘柄	1,443	11,983 < 0.2% >
合計	531.89 4銘柄	---	924,423 < 14.9% >

(注1) 邦貨換算金額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2018年11月30日現在	
	買建額	売建額
外国 MSCI EMGMKT(アメリカ)	百万円 56	百万円 -

(注1) 外貨建の評価額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第19期 (決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30日)

外国株式インデックスマザーファンドの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。)
株式組入制限	無制限

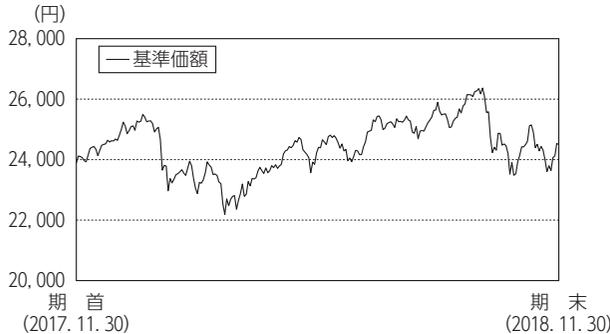
大和投資信託

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/>

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率			
(期首) 2017年11月30日	23,891	—	16,622	—	95.5	1.8	2.6
12月末	24,637	3.1	17,113	2.9	95.5	2.0	2.6
2018年1月末	24,915	4.3	17,294	4.0	95.7	1.9	2.4
2月末	23,793	△ 0.4	16,486	△ 0.8	95.9	1.8	2.3
3月末	22,784	△ 4.6	15,752	△ 5.2	95.6	2.0	2.5
4月末	23,800	△ 0.4	16,425	△ 1.2	96.3	1.4	2.4
5月末	23,916	0.1	16,426	△ 1.2	95.7	1.8	2.5
6月末	24,106	0.9	16,547	△ 0.5	95.7	2.0	2.5
7月末	25,061	4.9	17,189	3.4	96.1	1.5	2.4
8月末	25,604	7.2	17,514	5.4	95.7	1.8	2.4
9月末	26,251	9.9	17,945	8.0	96.3	1.4	2.4
10月末	23,939	0.2	16,344	△ 1.7	95.5	1.9	2.6
(期末) 2018年11月30日	24,496	2.5	16,678	0.3	95.1	2.3	2.6

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) MSCIコクサイ指数(円ベース)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注5) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：23,891円 期末：24,496円 騰落率：2.5%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆ 投資環境について

○ 海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は、横ばい圏で推移しました。

当作成期首より、米国の税制改革法への期待や英国のEU(欧州連合)離脱条件を巡る交渉が合意に近づいたことなどを好感し、海外株式市況は上昇して始まりました。2018年2月以降は、米国の利上げ加速への警戒感や米中貿易摩擦が激化したことへの懸念などを嫌気し、下落しました。4月以降は、貿易摩擦問題について米中両国が歩み寄りの姿勢を示したことや好調な4-6月期の企業業績を好感し、上昇基調となりました。8月以降は、米中貿易摩擦への懸念が再燃したことや新興国通貨の急落などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落しました。当作成期末にかけては、米中貿易摩擦が深刻化したこと、米国長期金利の上昇や中東情勢の緊迫化懸念などを背景に、上値の重い展開となりました。

○ 為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると、米ドルは対円で上昇したものの、ユーロなど他の通貨は下落しました。

当作成期首より円安が進みましたが、2018年に入ると、米国のムニンソン財務長官による米ドル安容認発言などから米ドルが下落しました。また、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや、各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。4月以降は、米国の金利が上昇したことやそれまでの米ドル安の反動もあり、米ドルが上昇傾向となりました。一方、イタリアの政治情勢への懸念が高まったことなどがユーロの下落材料となりました。8月には、トルコ情勢への警戒感が高まり市場のリスク回避姿勢が強まる中で円高傾向となりましたが、9月以降は新興国通貨安への懸念が後退し、市場のリスク回避姿勢が和らぐ中で円安傾向となりました。10月以降は、株価が下落し市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから円高傾向となりました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率(投資信託証券、株式先物を含む。)につきましては、当作成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、売買コストの抑制などを勘案しながら、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0.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.5%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は、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 (1) (0) (0)
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	2 (2) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	13 (11) (1)
合計	16

(注1) 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) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株式

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
外	アメリカ (10,431.8 477.37)	百株 千アメリカ・ドル 78,712 (△ 3,676)	百株 1,638.74	千アメリカ・ドル 7,915
	カナダ (△ 1,784.2 23.36)	百株 千カナダ・ドル 6,607 (△ 45)	百株 437	千カナダ・ドル 482
	オーストラリア (2,221 221.81)	百株 千オーストラリア・ドル 3,893 (△ 23)	百株 219.04	千オーストラリア・ドル 278
	香港 (4,423 239.17)	百株 千香港・ドル 14,250 (1)	百株 1,630	千香港・ドル 1,078
国	シンガポール (△ 1,199 630)	百株 千シンガポール・ドル 876 (△ 210)	百株 193	千シンガポール・ドル 67
	ニュージーランド (626 —)	百株 千ニュージーランド・ドル 502 (△ 3)	百株 330	千ニュージーランド・ドル 134
	イギリス (△ 12,225.8 18,461.58)	百株 千イギリス・ポンド 7,175 (△ 369)	百株 3,499.8	千イギリス・ポンド 1,371
	イスラエル (△ 135.5 9)	百株 千イスラエル・シェケル 384 (△ 270)	百株 —	千イスラエル・シェケル —
	スイス (678.9 31.27)	百株 千スイス・フラン 4,016 (△ 145)	百株 47.5	千スイス・フラン 197

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
外	デンマーク (117.9 —)	百株 千デンマーク・クローネ 4,436 (1)	百株 203.5	千デンマーク・クローネ 1,246
	ノルウェー (230 —)	百株 千ノルウェー・クローネ 3,758 (1)	百株 24	千ノルウェー・クローネ 472
	スウェーデン (944 657.88)	百株 千スウェーデン・クローネ 11,440 (1)	百株 503.88	千スウェーデン・クローネ 1,486
	ユーロ (アイルランド) (383.7 —)	百株 千ユーロ 528 (△ 960)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ) (585.9 —)	百株 千ユーロ 1,713 (1)	百株 204.5	千ユーロ 289
	ユーロ (ベルギー) (66.5 —)	百株 千ユーロ 435 (1)	百株 2.1	千ユーロ 18
	ユーロ (ルクセンブルグ) (49.2 —)	百株 千ユーロ 118 (1)	百株 7	千ユーロ 19
	ユーロ (フランス) (1,052.2 0.49)	百株 千ユーロ 4,759 (△ 30)	百株 119.9	千ユーロ 379
	ユーロ (ドイツ) (997.2 157.56)	百株 千ユーロ 5,050 (△ 98)	百株 268	千ユーロ 328
	ユーロ (ポルトガル) (165 —)	百株 千ユーロ 53 (1)	百株 —	千ユーロ —
国	ユーロ (スペイン) (1,899 8,011.2)	百株 千ユーロ 1,443 (106)	百株 8,442.2	千ユーロ 558
	ユーロ (イタリア) (1,893 61.9)	百株 千ユーロ 1,204 (△ 49)	百株 431.3	千ユーロ 138
	ユーロ (フィンランド) (177.5 72)	百株 千ユーロ 356 (1)	百株 4.5	千ユーロ 19
	ユーロ (オーストリア) (12.5 —)	百株 千ユーロ 56 (△ 8)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (その他) (20 —)	百株 千ユーロ 35 (1)	百株 299.19	千ユーロ 608
	ユーロ (ユーロ通貨計) (7,301.7 8,303.15)	百株 千ユーロ 15,756 (△ 1,040)	百株 9,778.69	千ユーロ 2,359

(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

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	千口 60.61 (△ 10.421)	千アメリカ・ドル 3,041 (△ 241)	千口 19.95 ()	千アメリカ・ドル 232 ()
	カナダ	千口 0.7 ()	千カナダ・ドル 14 ()	千口 — ()	千カナダ・ドル — ()
	オーストラリア	千口 102.7 ()	千オーストラリア・ドル 625 (△ 14)	千口 54.196 ()	千オーストラリア・ドル 458 ()
	香港	千口 18.5 ()	千香港・ドル 590 ()	千口 1.5 ()	千香港・ドル 97 ()
	シンガポール	千口 32.1 ()	千シンガポール・ドル 68 (△ 1)	千口 — ()	千シンガポール・ドル — ()
	イギリス	千口 5.9 ()	千イギリス・ポンド 44 ()	千口 21.1 ()	千イギリス・ポンド 41 ()
ユーロ (フランス)	千口 2.11 ()	千ユーロ 304 ()	千口 0.18 ()	千ユーロ 23 ()	

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 18,905	百万円 18,303	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
AMAZON.COM INC (アメリカ)	千株 1.44	千円 253,662	円 176,154	KEURIG DR PEPPER INC (アメリカ)	千株 4.548	千円 61,865	円 13,602
MICROSOFT CORP (アメリカ)	22.55	244,365	10,836	RELX PLC (イギリス)	24.719	57,927	2,343
APPLE INC (アメリカ)	10.65	218,788	20,543	APPLE INC (アメリカ)	2.3	54,222	23,575
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	8.3	155,087	18,685	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA (スペイン)	17.4	40,289	2,315
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.08	131,929	122,157	OLD MUTUAL PLC (イギリス)	122.525	37,351	304
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	8.7	128,295	14,746	GKN PLC (イギリス)	43.6	30,503	699
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	13.6	120,500	8,860	WYNDHAM DESTINATIONS INC (アメリカ)	2.4	28,765	11,985
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	5.25	118,332	22,539	WORLDPAY INC-CLASS A (アメリカ)	3.165	27,671	8,742
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.95	116,271	122,391	EQT CORP (アメリカ)	6.65	26,130	3,929
CHEVRON CORP (アメリカ)	6.95	91,877	13,219	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS (イギリス)	5.2	22,929	4,409

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	27	30.5	310	35,220	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	21	25	440	49,940	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	48	295	33,507	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13.5	16	236	26,782	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	188	188	488	55,400	金融
ABBOTT LABORATORIES	396.16	456.66	3,345	379,612	ヘルスケア
ARCONIC INC	89.33	113.33	241	27,442	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	35	41.5	513	58,311	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	92	105	571	64,897	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	69.5	78	678	77,009	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	75.79	84.79	897	101,839	情報技術
QORVO INC	29	34	221	25,188	情報技術
AFLAC INC	92	203	921	104,576	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	27.5	31.5	350	39,767	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	—	39	218	24,742	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	113.5	127.8	3,183	361,217	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	55	59.5	258	29,368	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	25	26	336	38,193	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	80	100	163	18,575	金融
GARMIN LTD	29	29	191	21,711	一般消費財・サービス
AETNA INC	75.79	—	—	—	その他
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	50.5	58	923	104,780	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	165	192	2,798	317,512	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37.51	41.71	363	41,270	情報技術
WR BERKLEY CORP	23	25.5	200	22,699	金融
AUTOZONE INC	6.3	7	578	65,594	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	53.21	63.21	558	63,425	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	209	257	562	63,864	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	26.5	29.5	262	29,737	公益事業
CELANESE CORP	33	35.5	356	40,503	素材
DR HORTON INC	83.16	94.16	351	39,905	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	24.5	113	12,888	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	52	59	218	24,763	ヘルスケア
AUTODESK INC	45.5	57.5	836	94,964	情報技術
MOODY'S CORP	40	44.5	697	79,094	金融
DEVON ENERGY CORP	117.5	139.5	375	42,596	エネルギー
ALBEMARLE CORP	26	28	269	30,634	素材
ATMOS ENERGY CORP	25	28	261	29,690	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	54	62.5	279	31,679	公益事業
CITIGROUP INC	628.23	660.73	4,288	486,574	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	103	115	1,677	190,320	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	114	130	992	112,624	公益事業
ALLEGHANY CORP	3.5	4.1	259	29,402	金融
DOMINO'S PIZZA INC	11	11	308	34,971	一般消費財・サービス
HESS CORP	65	72	391	44,476	エネルギー
DAVITA INC	35	35	229	26,076	ヘルスケア
DANAHER CORP	142	163	1,759	199,641	ヘルスケア
FORTIVE CORP	72	78	578	65,609	資本財・サービス
AVNET INC	28	32	138	15,758	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	135	151.5	1,228	139,399	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	40	49	113	12,865	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	40.28	47.28	102	11,668	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	129	143.5	660	74,966	生活必需品
BUNGE LTD	31	36	208	23,676	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	82.25	89.25	675	76,662	情報技術
APPLE INC	1,189	1,272.5	22,847	2,592,532	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	86	90	640	72,732	金融
BOEING CO/THE	130.5	143.1	4,902	556,233	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	34.65	39.15	318	36,196	金融
BECTON DICKINSON AND CO	51.87	70.19	1,755	199,191	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	60	67	121	13,775	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	33	38.5	239	27,120	情報技術
CDK GLOBAL INC	29	32	160	18,220	情報技術
NISOURCE INC	73	93.5	243	27,637	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	33.5	36	330	37,479	資本財・サービス
CR BARD INC	16.8	—	—	—	その他
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	236.71	265.21	1,344	152,513	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	934.04	1,074.54	6,388	724,862	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	285.5	334.5	7,282	826,295	金融
ANSYS INC	19	22.5	358	40,696	情報技術
H&R BLOCK INC	51	51	144	16,342	一般消費財・サービス
BB&T CORP	187.5	200	1,012	114,831	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	378.5	421.5	2,184	247,842	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	813.2	877.7	9,659	1,096,116	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	56	63	616	69,963	金融
CIGNA CORP	59	64	1,424	161,595	ヘルスケア
LKQ CORP	72	85	236	26,793	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	10	130	14,839	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	45.5	68.62	331	37,607	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	64	72.5	319	36,295	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	34.6	38.1	486	55,155	金融
DOLLAR GENERAL CORP	62	69.5	770	87,449	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	39.5	46.5	832	94,499	情報技術
CATERPILLAR INC	135	155.5	2,025	229,785	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	64	72	369	41,919	公益事業
MOSAIC CO/THE	75.5	97.5	352	40,016	素材
DELTA AIR LINES INC	44	47.5	279	31,724	資本財・サービス
CORNING INC	213	213	678	77,002	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,141	1,222.5	5,787	656,686	情報技術
MORGAN STANLEY	318	346	1,540	174,749	金融
WABCO HOLDINGS INC	12.5	14	168	19,102	資本財・サービス
MSCI INC	21.5	23	361	40,984	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	9	10	222	25,249	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	13	14.5	171	19,426	資本財・サービス
COTY INC-CL A	111.39	118.39	100	11,445	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	41	56	271	30,818	情報技術
BROADCOM INC	91.52	108.02	2,546	288,996	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	10.5	123	13,974	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	20	—	—	—	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	10	10	129	14,644	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	24.3	195	22,226	ヘルスケア
ARAMARK	58.5	64.5	244	27,694	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	49	53.5	131	14,958	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DTE ENERGY COMPANY	41.5	46.5	547	62,086	公益事業
CENTENE CORP	40	54.5	773	87,777	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	24	30	320	36,366	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	116	129	464	52,739	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	40.5	46.5	362	41,171	金融
GARTNER INC	21	23.5	359	40,838	情報技術
SPLUNK INC	32	38	386	43,821	情報技術
AGCO CORP	14.5	17	99	11,284	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	143	172	1,268	143,936	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	93	111	652	74,059	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	34	36.5	170	19,399	資本財・サービス
DEERE & CO	61.5	80	1,199	136,136	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	36	42.5	470	53,408	情報技術
TIME WARNER INC	176.33	—	—	—	その他
VMWARE INC-CLASS A	16.5	19.5	314	35,730	情報技術
CHEMOURS CO/THE	—	45.5	129	14,714	素材
NASDAQ INC	27	31.5	284	32,308	金融
VAIL RESORTS INC	9.5	10.2	283	32,148	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	34	36.5	193	21,901	金融
TARGA RESOURCES CORP	50.5	58.5	264	30,010	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	15	16.5	243	27,612	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	18	19.8	203	23,096	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	10.5	75	8,556	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	70	80	633	71,930	公益事業
COGNEX CORP	—	45.5	192	21,869	情報技術
MEDNAX INC	22	—	—	—	ヘルスケア
WYNDHAM DESTINATIONS INC	24	—	—	—	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC	10	12.3	333	37,894	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	23	244	27,726	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	25	31.5	310	35,274	ヘルスケア
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	17.5	—	—	—	資本財・サービス
IDEX CORP	18	19.5	262	29,729	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	191.5	216.5	1,364	154,865	生活必需品
ROLLINS INC	22	25.5	162	18,445	資本財・サービス
AMETEK INC	52.25	61.75	452	51,303	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	58	65	428	48,649	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	32	32	109	12,472	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	—	31	236	26,853	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	79.5	85.5	795	90,245	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	100.5	114	2,633	298,811	生活必需品
SCANA CORP	31	35	161	18,312	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13.5	13.5	150	17,092	金融
WR GRACE & CO	16	—	—	—	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	6.5	313	35,591	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	76	76	166	18,946	金融
UGI CORP	39	46	261	29,631	公益事業
CUMMINS INC	37	40.5	600	68,105	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	163	191.5	1,006	114,210	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	46	68.5	178	20,240	情報技術
CDW CORP/DE	37.5	40.5	374	42,458	情報技術
SIGNATURE BANK	13	15	183	20,865	金融
COSTAR GROUP INC	8.5	9.7	359	40,771	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	12	13.9	338	38,440	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMERCO	1.7	2.2	76	8,703	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	16.5	222	25,277	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	10	10.9	390	44,277	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	85	95	148	16,880	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	18	19.5	271	30,784	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	45.66	74.16	567	64,340	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	46	46	81	9,228	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	—	10.2	144	16,352	情報技術
DEXCOM INC	19	—	—	—	ヘルスケア
COPART INC	—	54	279	31,684	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	20.5	26.5	296	33,677	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	22.5	29	182	20,691	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	17.7	19.5	445	50,603	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12	12.8	470	53,357	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	80	90	244	27,726	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	460.81	509.81	860	97,589	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	68	73.5	1,062	120,513	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	105.5	120.5	297	33,758	エネルギー
T-MOBILE US INC	68.5	90	618	70,138	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	25	29	106	12,109	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	929.5	1,051	5,147	584,120	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	57.5	280	31,794	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	40	45.5	345	39,170	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	25	30.5	124	14,085	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	76	86.5	289	32,880	金融
CSX CORP	209.5	214	1,535	174,276	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	36.5	149	17,013	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	23.5	26	420	47,737	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	28.75	32.25	386	43,817	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	20	21.5	185	21,061	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	93	107.4	17,974	2,039,525	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	50	66.5	138	15,747	エネルギー
FLOWSERVE CORP	29	32	152	17,334	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49	54.5	887	100,677	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	971.05	1,099.05	8,689	985,950	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	34	155	17,619	情報技術
AES CORP	156	170	262	29,783	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	18	20.5	375	42,554	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	9	10.2	224	25,476	金融
EOG RESOURCES INC	132.5	152.5	1,608	182,507	エネルギー
EQT CORP	40.5	—	—	—	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	39	44.5	303	34,391	情報技術
ABIOMED INC	—	10.8	358	40,684	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	38	42.5	384	43,643	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	72.9	83.9	600	68,135	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	853.23	956.23	895	101,667	一般消費財・サービス
TESARO INC	9	—	—	—	ヘルスケア
MACY'S INC	68.98	80.98	273	31,003	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	34.4	39.9	126	14,320	コミュニケーション・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	48.87	121	13,818	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	51.2	79.89	228	25,980	コミュニケーション・サービス
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	3	—	—	—	ヘルスケア
AERCAP HOLDINGS NV	38	34	178	20,304	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FORTINET INC	35	38	280	31,864	情報技術
MARKEL CORP	3.2	3.6	401	45,593	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	—	44	96	10,894	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	107	122.5	2,169	246,198	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	318.08	364.08	430	48,830	素材
US BANCORP	387	403.5	2,180	247,422	金融
UNITED RENTALS INC	19	21.5	249	28,279	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	14.5	16	277	31,504	情報技術
FASTENAL CO	65	77	456	51,776	資本財・サービス
FISERV INC	49.5	107	839	95,236	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	1,991	2,263.5	1,797	203,930	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	—	44.5	174	19,824	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	43.5	56	288	32,762	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	56.5	60.5	139	15,837	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	311	334	1,227	139,316	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	27.5	27.5	174	19,827	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	59	66	1,202	136,427	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	81.6	93.4	1,819	206,503	金融
ALPHABET INC-CL A	68.1	77.6	8,493	963,807	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	71.47	81.77	8,899	1,009,772	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	—	27.5	141	16,098	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	130	156.5	660	74,956	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	99.68	125.68	466	52,979	公益事業
GENUINE PARTS CO	35	37.5	386	43,866	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	95.34	101.84	537	61,014	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	175	176	484	54,999	金融
HARRIS CORP	27.5	30.5	436	49,534	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	30	115	13,078	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	198.5	234	746	84,674	エネルギー
HOME DEPOT INC	273.5	298.5	5,243	594,974	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	12.5	14	136	15,536	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	246	294	426	48,372	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11	11.9	255	29,011	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	33	37.5	402	45,721	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	40	44.5	189	21,454	一般消費財・サービス
HUMANA INC	33	36	1,189	134,920	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	82	89.5	742	84,199	情報技術
HELMERICH & PAYNE	26	29	177	20,122	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	36	40.5	361	40,964	ヘルスケア
HP INC	389	433	989	112,316	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	377	394	595	67,597	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	40	48	191	21,726	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	39	43	265	30,094	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	54.5	165	18,787	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	21	83	9,440	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29	103.5	293	33,329	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	138.53	161.53	826	93,825	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	204.5	238.5	2,897	328,756	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	91	100	457	51,901	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	36	36	156	17,736	資本財・サービス
ZOETIS INC	114	126.5	1,173	133,161	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	57.79	65.79	680	77,167	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	47	54.5	335	38,125	エネルギー

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ALLEGION PLC	22	24.5	224	25,506	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	31	35	135	15,401	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	130.23	136.73	333	37,793	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	61.57	68.57	536	60,922	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	89	89	254	28,872	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	27.2	29.2	302	34,273	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	614	696	10,151	1,151,852	ヘルスケア
ABBVIE INC	364.29	394.29	3,545	402,258	ヘルスケア
HOLOGIC INC	65.5	71	315	35,778	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	81.5	89.5	1,028	116,738	生活必需品
KROGER CO	206	218.5	663	75,272	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	36.5	41	396	44,982	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	60	66.7	2,017	228,885	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	21	23.2	444	50,459	情報技術
L BRANDS INC	56	59	198	22,487	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	197	212	1,975	224,198	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	225.5	252.5	2,954	335,218	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	37	42.3	646	73,316	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	57	—	—	—	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	10	12.5	176	20,026	不動産
LOEWS CORP	65	72.5	347	39,471	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	51.49	57.99	362	41,119	金融
MCDONALD'S CORP	185.5	203.5	3,851	437,023	一般消費財・サービス
3M CO	137	153.5	3,139	356,295	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	541.5	624.5	8,660	982,714	コミュニケーション・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	48.04	51.04	541	61,389	情報技術
MANPOWERGROUP INC	15	16	128	14,551	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	59.5	65	1,172	133,018	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	14	16	314	35,731	素材
CONCHO RESOURCES INC	34.5	52.5	690	78,336	エネルギー
ENVISION HEALTHCARE CORP	26.36	—	—	—	その他
FIRST DATA CORP- CLASS A	103	134.5	255	28,951	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	43	53	137	15,636	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	99.5	116	1,075	121,990	エネルギー
MURPHY OIL CORP	36	—	—	—	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	100	111.5	264	29,972	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	107.5	134	366	41,540	一般消費財・サービス
MATTEL INC	78	87	119	13,583	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	65.38	73.38	457	51,881	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	26.5	32	476	54,120	生活必需品
MYLAN NV	104.5	137.5	468	53,109	ヘルスケア
METLIFE INC	208.5	227	1,007	114,338	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	91	157	252	28,628	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	11	13.9	328	37,271	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	25	42	181	20,545	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	38.28	42.78	567	64,357	情報技術
MONSANTO CO	100.56	—	—	—	その他
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6.4	403	45,817	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	91.73	132.73	306	34,805	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	29.5	32.3	554	62,955	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	19.4	29.4	117	13,357	金融
MERCK & CO. INC.	627.71	696.21	5,424	615,480	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	535.05	598.55	3,426	388,759	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MASCO CORP	74	79	247	28,039	資本財・サービス
M & T BANK CORP	31.69	35.19	593	67,358	金融
MARSH & MCLENNAN COS	117.5	132.5	1,155	131,058	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	74.72	77.22	940	106,758	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	29.5	37.5	544	61,826	情報技術
SQUARE INC - A	—	77.5	541	61,469	情報技術
TRANSUNION	—	47	300	34,041	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	—	87	201	22,902	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	35.5	38.5	168	19,134	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	38.5	79.5	680	77,200	情報技術
NETAPP INC	61.5	68.5	461	52,387	情報技術
NIKE INC -CL B	300.5	332	2,468	280,053	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	67	74	1,246	141,435	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	53.5	60	446	50,666	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	30	34.5	263	29,857	金融
ALLY FINANCIAL INC	102	114.5	303	34,403	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	38.3	43	1,120	127,186	資本財・サービス
APTIV PLC	62	68.5	489	55,574	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	120	140	452	51,374	素材
MCKESSON CORP	49	53	673	76,382	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	71	392	44,583	情報技術
XYLEM INC	42	48	342	38,833	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	356	404.5	3,517	399,134	生活必需品
NUCOR CORP	74	82	491	55,808	素材
WESTERN UNION CO	113.46	117.46	219	24,897	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	—	45	296	33,629	情報技術
NEWELL BRANDS INC	108.92	122.92	292	33,195	一般消費財・サービス
EVERGY INC	—	69.5	408	46,386	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	174	197	1,396	158,509	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	25.5	28.5	241	27,368	コミュニケーション・サービス
SPECTRUM BRANDS LEGACY INC	6	—	—	—	生活必需品
LINDE PLC	—	147.96	2,357	267,465	素材
PAYCHEX INC	75.5	83.5	583	66,247	情報技術
PATTERSON COS INC	19	—	—	—	ヘルスケア
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21.2	21.2	752	85,361	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	442.5	491	2,746	311,662	生活必需品
P G & E CORP	116	132.5	354	40,233	公益事業
PFIZER INC	1,363.63	1,520.13	6,918	784,998	ヘルスケア
ALKERMES PLC	36	40	143	16,226	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	115	131.5	677	76,889	公益事業
STRYKER CORP	76.5	87	1,486	168,720	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	30.5	35	591	67,077	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	39	45	671	76,168	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	15.5	149	16,952	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	586.17	650.67	6,039	685,304	生活必需品
EXELON CORP	212.22	254.72	1,163	132,000	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	51	57.5	709	80,473	ヘルスケア
NVR INC	0.8	0.9	222	25,262	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	282.5	303	2,026	229,908	エネルギー
PEPSICO INC	326	366	4,328	491,175	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	99	110	1,022	115,967	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40.5	48.5	448	50,894	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	142	167	2,689	305,219	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19.5	22	121	13,807	金融
PENTAIR PLC	40.05	42.05	178	20,264	資本財・サービス
QUALCOMM INC	336	369.5	2,147	243,638	情報技術
INVESCO LTD	91.5	109.5	221	25,160	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	19	337	38,304	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	66	72	357	40,587	金融
RAYTHEON COMPANY	67	75.2	1,305	148,114	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	20.5	—	—	—	その他
RED HAT INC	40	45.5	809	91,842	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	18.1	20.9	751	85,272	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	53.5	60	460	52,280	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	11.2	12.5	2,331	264,548	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	90	99.5	855	97,028	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	24	231	26,279	素材
RESMED INC	32.5	37	408	46,392	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	31	35.5	312	35,423	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	28	30.5	188	21,394	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	13	14.5	161	18,310	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	17	—	—	—	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	36.63	—	—	—	その他
REGIONS FINANCIAL CORP	274.35	288.35	467	53,037	金融
CHEVRON CORP	432.18	497.18	5,908	670,492	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	75	83	454	51,535	公益事業
TESLA INC	30.4	33	1,125	127,751	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	139	161.5	364	41,378	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	34.72	39.22	499	56,723	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	34	37.5	335	38,091	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	49.05	45.05	1,488	168,858	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	71	87	375	42,587	不動産
TWITTER INC	144	179	560	63,573	コミュニケーション・サービス
NAVIENT CORP	71	—	—	—	金融
SOUTHERN CO/THE	225.5	266.5	1,240	140,735	公益事業
SYSCO CORP	118	127	857	97,329	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	64.73	71.23	930	105,581	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	35.5	189	21,542	金融
STERICYCLE INC	19.5	21.5	103	11,761	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	57	62	216	24,608	素材
SCHLUMBERGER LTD	316.52	359.02	1,647	186,987	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	39	46	210	23,911	資本財・サービス
AT&T INC	1,402.91	1,887.91	5,771	654,874	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	34	36.5	194	22,046	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	110	203	23,091	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19.3	21.9	919	104,310	素材
SEMPRA ENERGY	54	64.5	726	82,461	公益事業
TIFFANY & CO	28	29.5	264	30,049	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	71	70.5	300	34,118	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	227.5	253	2,464	279,701	情報技術
SALESFORCE.COM INC	154.5	186	2,598	294,884	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	13	—	—	—	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	59.3	66.3	307	34,869	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	215.84	238.84	818	92,875	資本財・サービス
ANDEAVOR	34.5	—	—	—	その他
UNION PACIFIC CORP	186	201.5	3,032	344,060	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MARATHON OIL CORP	190	226	374	42,441	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	119	178.38	1,157	131,362	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	174.5	214.37	2,598	294,813	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	157	179	2,027	230,043	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	59	214	24,362	金融
SPRINT CORP	177.65	207.65	131	14,891	コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	51	51	68	7,800	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	31.94	41.94	524	59,462	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	45	43.5	194	22,048	金融
AMEREN CORPORATION	55	62.5	423	48,097	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	220.76	249.76	7,056	800,754	ヘルスケア
VERISIGN INC	22	29	454	51,551	情報技術
VALERO ENERGY CORP	103.42	112.92	897	101,825	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	13.1	15.1	453	51,465	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	57.38	68.38	226	25,744	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	23	317	35,978	ヘルスケア
ANTHEM INC	60.5	67.4	1,969	223,448	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	358.5	387	4,512	512,068	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,084.72	1,196.22	6,464	733,512	金融
FOOT LOCKER INC	32	—	—	—	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	100	110.5	1,024	116,256	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	187	319	815	92,519	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	32	302	34,375	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	17	214	24,382	一般消費財・サービス
WALMART INC	346.5	382	3,716	421,708	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	—	29	235	26,733	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	46	53	609	69,135	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	221	—	—	—	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	19.5	26	281	31,897	一般消費財・サービス
XEROX CORP	48.11	59.11	158	18,028	情報技術
WABTEC CORP	19	22.5	208	23,656	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	148.5	328	1,557	176,749	一般消費財・サービス
WATERS CORP	18	20.5	417	47,334	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	18	171	19,417	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	76.57	88.57	1,374	156,016	ヘルスケア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	211	220	1,866	211,814	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	29.83	35.23	558	63,357	金融
WESTERN DIGITAL CORP	67.5	78	355	40,288	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	71.3	82.8	587	66,706	公益事業
WESTAR ENERGY INC	32	—	—	—	その他
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	117.5	134	730	82,897	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	423	460.5	6,405	726,838	情報技術
PPL CORP	154	186	570	64,730	公益事業
PULTEGROUP INC	67	69	184	20,928	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	59.5	64.5	699	79,387	素材
NORTHERN TRUST CORP	49	56.5	548	62,187	金融
NVIDIA CORP	136.5	150	2,360	267,834	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	—	20.5	369	41,935	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	110.93	122.43	1,636	185,668	金融
QURATE RETAIL INC	95.5	114.5	256	29,154	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	47	184	20,948	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	65	79	455	51,740	生活必需品
NETFLIX INC	99	113.4	3,274	371,549	コミュニケーション・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	89.5	105	2,609	296,154	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	26.75	29.25	255	28,981	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	37	42.5	408	46,387	金融
TEXTRON INC	63.5	68.5	383	43,496	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	239.5	275	1,362	154,554	コミュニケーション・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	103	116	571	64,891	コミュニケーション・サービス
NEWS CORP - CLASS A	83.37	102.37	135	15,344	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	47	53	206	23,388	公益事業
OMNICOM GROUP	54	60.5	466	52,983	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	707.33	792.83	3,797	430,919	情報技術
MASTERCARD INC - A	217.5	240.5	4,729	536,675	情報技術
ONEOK INC	88	107.5	659	74,822	エネルギー
CENTURYLINK INC	226.52	253.52	472	53,563	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	27.2	799	90,699	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	75	83	762	86,513	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	30.5	341	38,730	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	11.5	13.3	261	29,685	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	43.5	50.5	324	36,851	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	109	124	300	34,148	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,280.01	2,491.01	6,984	792,564	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	41	46	445	50,499	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	156	17,803	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	173.5	190.5	2,120	240,608	金融
ANALOG DEVICES INC	82.99	95.49	854	96,997	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	180	238	510	57,873	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	72	382	43,398	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	210.22	230.22	1,000	113,478	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	127	135	724	82,260	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41.5	48	341	38,795	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	40	44.5	496	56,366	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	45	51	89	10,156	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	—	—	—	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	21	23	219	24,879	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	136	153.5	1,079	122,446	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	149	165.5	1,114	126,440	資本財・サービス
AON PLC	60	63	1,031	117,008	金融
AMGEN INC	168.5	172.5	3,490	396,110	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N. V.	10	—	—	—	エネルギー
TAPESTRY INC	64	76.5	290	32,994	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	101.36	115.36	876	99,496	資本財・サービス
CELGENE CORP	178	192	1,347	152,852	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	38.8	43.3	849	96,402	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	245	263	961	109,044	情報技術
CIT GROUP INC	33	33	152	17,333	金融
CIMAREX ENERGY CO	22.5	25	209	23,715	エネルギー
CME GROUP INC	78	93.5	1,766	200,423	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	88.44	98.94	323	36,745	エネルギー
ECOLAB INC	59	68.5	1,084	123,111	素材
EQUIFAX INC	27.5	31.5	323	36,743	資本財・サービス
GAP INC/THE	58	59.5	158	17,992	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	300	336	2,341	265,699	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	41.48	—	—	—	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	68.5	77.5	350	39,774	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
STATE STREET CORP	87.43	97.43	705	80,007	金融
SUNTRUST BANKS INC	111.98	120.48	752	85,429	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	277	318	1,404	159,344	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	113.5	131	891	101,108	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	41	48.5	192	21,809	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	34.5	175	19,937	素材
CARDINAL HEALTH INC	71.5	83	456	51,817	ヘルスケア
FEDEX CORP	58.5	66	1,501	170,375	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	109.54	126.54	1,124	127,603	金融
FMC CORP	31.5	36	298	33,925	素材
FLEX LTD	122	129	110	12,515	情報技術
CERNER CORP	67	77.5	444	50,433	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	26.24	371	42,154	素材
CITRIX SYSTEMS INC	35	37	408	46,375	情報技術
INTEL CORP	1,079	1,205	5,747	652,208	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	102	248	28,182	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	82.5	91	402	45,722	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	70.5	79.5	1,080	122,593	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	385	417	263	29,904	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	33.5	38.7	1,307	148,408	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	44	160	18,178	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	25.2	29.7	1,547	175,569	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	29	34.5	380	43,210	情報技術
SNAP-ON INC	13	15.5	254	28,844	資本財・サービス
CARMAX INC	42.5	46	304	34,496	一般消費財・サービス
COMERICA INC	40	45	355	40,333	金融
INGREDION INC	16	19	197	22,380	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	160.78	183.78	1,609	182,676	公益事業
TARGET CORP	119.5	132.5	943	107,002	一般消費財・サービス
DOVER CORP	35	39	327	37,190	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	13	13	404	45,903	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	29	34	221	25,115	資本財・サービス
CINTAS CORP	21	23.5	441	50,141	資本財・サービス
CA INC	71.05	—	—	—	その他
CONAGRA BRANDS INC	95	127	409	46,503	生活必需品
CLOROX COMPANY	29.5	33	547	62,177	生活必需品
ENTERGY CORP	42	47.5	407	46,282	公益事業
MICROSOFT CORP	1,675.5	1,892	20,847	2,365,616	情報技術
INCYTE CORP	40.5	46	298	33,817	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	231.74	335.69	2,685	304,725	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	314.38	349.88	3,379	383,510	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	241	305.5	1,158	131,415	情報技術
BLACKROCK INC	27.5	31.3	1,323	150,211	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	91	129	357	40,604	公益事業
HASBRO INC	26	31	300	34,067	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	61	68.5	433	49,162	生活必需品
KEYCORP	247	282	511	58,045	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	24	27.5	278	31,572	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	350.11	384.61	1,712	194,336	生活必需品
KOHL'S CORP	39	44.5	298	33,881	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	11	13	360	40,922	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	111	120	126	14,378	金融
APACHE CORP	87.6	98.6	350	39,762	エネルギー

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CHUBB LTD	106.49	120.49	1,617	183,491	金融	
ARROW ELECTRONICS INC	20	21.5	164	18,655	情報技術	
ALLSTATE CORP	83.5	92	814	92,366	金融	
EBAY INC	234	249	735	83,405	一般消費財・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	261.5	293	2,468	280,136	情報技術	
EASTMAN CHEMICAL CO	32.5	37.5	296	33,632	素材	
XILINX INC	56	65.5	597	67,782	情報技術	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	135.1	147.1	1,488	168,950	ヘルスケア	
DISH NETWORK CORP-A	53	57.5	189	21,504	コミュニケーション・サービス	
ZIONS BANCORP NA	48	52	250	28,446	金融	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	51.5	57.5	813	92,322	生活必需品	
TOLL BROTHERS INC	38	38	127	14,492	一般消費財・サービス	
TRIMBLE INC	59	64	239	27,160	情報技術	
LENNAR CORP-A	48	76	327	37,116	一般消費財・サービス	
LEAR CORP	15.5	16.5	222	25,251	一般消費財・サービス	
E*TRADE FINANCIAL CORP	65	70	360	40,874	金融	
PROGRESSIVE CORP	134	154	1,003	113,915	金融	
PRAXAIR INC	65	—	—	—	その他	
PACCAR INC	79.87	91.37	560	63,564	資本財・サービス	
PVH CORP	17.5	20	219	24,911	一般消費財・サービス	
BIOGEN INC	48.8	54.6	1,783	202,349	ヘルスケア	
IDEXX LABORATORIES INC	20	22.2	446	50,662	ヘルスケア	
STARBUCKS CORP	331	354.5	2,370	269,025	一般消費財・サービス	
PERRIGO CO PLC	30.5	34	217	24,733	ヘルスケア	
EVERSOURCE ENERGY	71.3	81.3	545	61,872	公益事業	
INTUIT INC	56	63	1,317	149,541	情報技術	
BORGWARNER INC	48	56	220	25,016	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	65	65	416	47,255	一般消費財・サービス	
BALL CORP	75.84	87.34	432	49,126	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	310.47	360.47	1,335	151,502	ヘルスケア	
BED BATH & BEYOND INC	36	—	—	—	一般消費財・サービス	
XL GROUP LTD	61	—	—	—	その他	
ELECTRONIC ARTS INC	71	78.5	678	76,950	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	30.5	34.5	368	41,856	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	56.5	66	1,184	134,390	ヘルスケア	
VF CORP	77.5	87	691	78,442	一般消費財・サービス	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	83.71	88.71	491	55,714	コミュニケーション・サービス	
VIACOM INC-CLASS B	81.71	92.71	296	33,694	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	14.7	15.7	199	22,692	一般消費財・サービス	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	63	—	—	—	情報技術	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	24	290	33,003	ヘルスケア	
CARNIVAL CORP	80.5	112	680	77,179	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	1,084.4	1,188.9	4,686	531,793	コミュニケーション・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	52	61	225	25,603	資本財・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	48	59	382	43,448	資本財・サービス	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	—	90	79	9,037	生活必需品	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	265	313	199	22,659	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	70,298.77 600銘柄	79,569.2 592銘柄	613,411	69,603,768 <64.6%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	67	76	308	26,331	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4.4	5	469	40,061	情報技術	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	46.96	50.96	90	7,713	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	51.87	63.87	498	42,604	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	107	120	250	21,402	素材
INTACT FINANCIAL CORP	31.5	38.5	398	34,050	金融
BCE INC	34.3	41.3	235	20,151	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	43	51	462	39,486	素材
SUNCOR ENERGY INC	388.3	429.3	1,869	159,701	エネルギー
METRO INC	55	62	283	24,255	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	81	90	544	46,480	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	279	318	2,315	197,750	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	101.5	118.5	1,332	113,835	金融
TORONTO-DOMINION BANK	432	483	3,549	303,162	金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	67	76	232	19,891	金融
ROYAL BANK OF CANADA	340.5	383.5	3,751	320,444	金融
TOURMALINE OIL CORP	54	66	120	10,317	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	28	37	124	10,654	エネルギー
TRANSCANADA CORP	205.5	238.5	1,297	110,827	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	116.29	132.29	586	50,082	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	454	530	115	9,824	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	273	304	527	45,027	素材
CAE INC	58	72	191	16,353	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	67.04	68.12	452	38,648	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	194	—	—	—	その他
EMPIRE CO LTD 'A'	39	46	116	9,949	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	16	16	112	9,579	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	34.5	38.5	204	17,472	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	97	—	—	—	金融
LINAMAR CORP	11	13	62	5,330	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	54	64	65	5,570	エネルギー
HYDRO ONE LTD	72	84	165	14,106	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	51.6	54.6	334	28,603	生活必需品
WSP GLOBAL INC	—	27	174	14,873	資本財・サービス
EMERA INC	13	13	58	4,974	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	33	103	8,837	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	86	95	668	57,080	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	55	59	273	23,384	素材
KINROSS GOLD CORP	295	341	123	10,544	素材
BANK OF MONTREAL	153	171	1,699	145,133	金融
POWER CORP OF CANADA	81	94	250	21,374	金融
METHANEX CORP	22	22	163	13,927	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	19	23	455	38,872	情報技術
NUTRIEN LTD	—	165.19	1,125	96,177	素材
AURORA CANNABIS INC	—	175	131	11,226	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	—	55	243	20,765	ヘルスケア
CAMECO CORP	92	106	168	14,351	エネルギー
TELUS CORP	54	54	256	21,937	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	57	62	174	14,892	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	134	140	372	31,846	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	16	16	242	20,697	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	248	248	60	5,126	素材
AGRIUM INC	33	—	—	—	その他
CANADIAN NATURAL RESOURCES	261	328	1,097	93,719	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6.4	7	429	36,724	金融

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
MAGNA INTERNATIONAL INC	84	87	572	48,869	一般消費財・サービス	
WESTON (GEORGE) LTD	11	20.37	198	16,921	生活必需品	
BLACKBERRY LTD	119	135	157	13,492	情報技術	
SUN LIFE FINANCIAL INC	142.5	158.5	769	65,772	金融	
ENBRIDGE INC	381	488	2,144	183,205	エネルギー	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	207.5	220.5	1,296	110,769	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	460	529	1,151	98,372	金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	71	87	274	23,453	ヘルスケア	
GOLDCORP INC	199.59	233.59	292	24,961	素材	
ENCANA CORP	231	258	238	20,385	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34	38	1,061	90,705	資本財・サービス	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	25	29	140	11,962	金融	
GILDAN ACTIVWEAR INC	52	56	240	20,521	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	175.5	192.5	2,172	185,596	資本財・サービス	
CGI GROUP INC - CLASS A	50	69	581	49,698	情報技術	
HUSKY ENERGY INC	84.58	93.58	149	12,797	エネルギー	
ONEX CORPORATION	20	22	180	15,396	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	101	116	289	24,732	コミュニケーション・サービス	
FINNING INTERNATIONAL INC	39	44	119	10,177	資本財・サービス	
SNC-LAVALIN GROUP INC	42	45	219	18,777	資本財・サービス	
IGM FINANCIAL INC	19	19	64	5,505	金融	
OPEN TEXT CORP	62	70	316	26,996	情報技術	
CI FINANCIAL CORP	64	70	139	11,899	金融	
SAPUTO INC	48	63	257	21,983	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	158	177	214	18,354	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	98	116	810	69,202	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	233	—	—	—	素材	
FORTIS INC	99	110	506	43,269	公益事業	
LUNDIN MINING CORP	—	161	91	7,838	素材	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	133	133	53	4,578	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	240	272	265	22,653	エネルギー	
DOLLARAMA INC	25	83	297	25,410	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	17	17	68	5,863	公益事業	
ALTAGAS LTD	39	69	96	8,251	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	38	48	95	8,175	不動産	
KEYERA CORP	44	53	151	12,970	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	39	—	—	—	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	88	104	224	19,179	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	83	97	88	7,581	エネルギー	
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,665.33 89銘柄	10,989.17 89銘柄	45,333 <3.6%>	3,872,423	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	375	455	100	8,316	ヘルスケア	
MEDIBANK PRIVATE LTD	617	728	180	14,999	金融	
BHP BILLITON LIMITED	747	847.5	2,625	218,131	素材	
SOUTH32 LTD	1,207	1,341	421	34,982	素材	
ALUMINA LTD	569	623	143	11,956	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	176	245	763	63,445	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	355	425	171	14,229	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	133	143	11,955	金融	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	626	712.5	1,774	147,453	金融	
WESTPAC BANKING CORP	788.48	902.48	2,384	198,091	金融	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
SANTOS LTD	428	452	254	21,179	エネルギー	
AUSNET SERVICES	410	500	79	6,584	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	684	770	2,090	173,682	金融	
RIO TINTO LTD	100	109.5	802	66,637	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	414	462	304	25,294	エネルギー	
AMCOR LIMITED	268	314	421	35,035	素材	
AURIZON HOLDINGS LTD	468	543	230	19,172	資本財・サービス	
COLES GROUP LTD	—	297.45	368	30,618	生活必需品	
OIL SEARCH LTD	329	353	258	21,467	エネルギー	
SEEK LTD	75	83	155	12,936	資本財・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	171	191	283	23,564	生活必需品	
NEWCREST MINING LTD	176	197.5	410	34,096	素材	
INCITEC PIVOT LTD	382	423	161	13,389	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	405.5	462	3,346	278,007	金融	
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	71.5	196	16,329	エネルギー	
ORICA LTD	83	101	178	14,868	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	323	360.5	413	34,382	金融	
CIMIC GROUP LTD	21	24	103	8,561	資本財・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	300	351	1,047	86,987	生活必需品	
COCA-COLA AMATIL LTD	137	137	138	11,495	生活必需品	
TABCORP HOLDINGS LTD	205	484	215	17,933	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	96	96	113	9,411	一般消費財・サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	102.54	—	—	—	資本財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	986	1,105	327	27,173	コミュニケーション・サービス	
AMP LTD	668	750	183	15,203	金融	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	103	120.5	198	16,468	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	76.84	85.84	1,002	83,304	金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	126	152.5	387	32,231	一般消費財・サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	91	108	109	9,080	金融	
CSL LTD	106	120.5	2,178	181,001	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	264.95	297.45	937	77,867	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	14	15	259	21,521	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	134	144	160	13,351	素材	
SUNCORP GROUP LTD	297	343	464	38,612	金融	
BORAL LTD	277	305	160	13,328	素材	
ASX LTD	47	50	307	25,555	金融	
COMPUTERSHARE LTD	104	122.5	226	18,777	情報技術	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	43	3,628	一般消費財・サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	549	595.36	442	36,750	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	95	104	242	20,114	ヘルスケア	
CHALLENGER LTD	139	139	136	11,363	金融	
TATTS GROUP LTD	305	—	—	—	一般消費財・サービス	
AGL ENERGY LTD	155	174	325	27,018	公益事業	
BRAMBLES LTD	373	415	434	36,133	資本財・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	14	67	5,615	一般消費財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33	38.5	213	17,771	ヘルスケア	
TPG TELECOM LTD	87	87	65	5,478	コミュニケーション・サービス	
REA GROUP LTD	12	13.5	103	8,574	コミュニケーション・サービス	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	14	16.5	76	6,372	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	16,427.31	18,651.08	29,339	2,437,500	
	銘柄数 < 比率 >	58 銘柄	57 銘柄		< 2.3% >	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	330	375	2,004	29,083	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	550	650	3,152	45,742	一般消費財・サービス
MTR CORP	345	400	1,606	23,303	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	340	420	4,758	69,047	不動産
SINO LAND CO	740	900	1,215	17,629	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	631.69	706.69	5,759	83,570	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	280	320	681	9,890	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	125	1,079	15,661	不動産
FIRST PACIFIC CO	560	—	—	—	金融
CLP HOLDINGS LTD	380	435	3,821	55,449	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	279.24	359.16	1,440	20,897	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	210	210	448	6,505	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,912.56	2,481.81	3,871	56,177	公益事業
HANG SENG BANK LTD	179	204	3,674	53,310	金融
WHEELOCK & CO LTD	200	220	992	14,396	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,330	1,590	1,707	24,778	不動産
WH GROUP LTD	1,945	2,225	1,294	18,789	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	273	313	7,142	103,639	金融
MINTH GROUP LTD	—	180	490	7,117	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD	1,320	1,520	249	3,617	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	460	500	779	11,303	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	58	76	608	8,822	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	165	190	452	6,561	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	355	425	718	10,421	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	145	175	473	6,868	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	290.4	326.4	860	12,479	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	140	170	676	9,817	不動産
SJM HOLDINGS LTD	470	470	330	4,801	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	262	288	794	11,533	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	616.69	696.69	3,901	56,610	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	150	180	1,062	15,409	公益事業
PCCW LTD	950	1,170	530	7,690	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	2,812	3,212	20,685	300,143	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	280	330	1,582	22,959	不動産
SANDS CHINA LTD	572	644	2,192	31,817	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	300	334	4,857	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	355	1,512	21,943	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	236	311	4,527	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	875	960	2,908	42,206	金融
WYNN MACAU LTD	380	420	748	10,859	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	21,726.58 39銘柄	24,758.75 39銘柄	86,853 <1.2%>	
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
UNITED OVERSEAS BANK LTD	313	359	901	74,721	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	415	473	1,143	94,802	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	136.7	131	10,934	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	345	395	242	20,136	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	132	140	87	7,229	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	104	90	7,499	不動産
CAPITALAND LTD	590	689	217	18,047	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	420	568	71	5,932	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	410	109	9,039	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	23	27	95	7,898	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	742	828	930	77,143	金融
GENTING SINGAPORE LTD	1,530	1,530	148	12,301	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	—	72	110	9,143	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,886.5	2,209.5	680	56,408	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	395	136	11,328	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	227	227	60	4,986	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,644	1,644	37	3,134	生活必需品
SATS LTD	160	160	74	6,206	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	208	151	12,551	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	553	115	9,580	資本財・サービス
STARHUB LTD	160	—	—	—	コミュニケーション・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	372	492	152	12,601	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	630	—	—	—	その他
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,244.2 22銘柄	11,620.2 21銘柄	5,689	471,627 <0.4%>
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円
MERIDIAN ENERGY LTD	260	345	112	8,731	公益事業
A2 MILK CO LTD	—	190	207	16,126	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	526.89	219	17,109	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	234	164	12,846	資本財・サービス
CONTACT ENERGY LTD	130	—	—	—	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	201	201	96	7,497	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	—	151	199	15,556	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	88	88	101	7,914	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,439.89 6銘柄	1,735.89 7銘柄	1,101	85,781 <0.1%>
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円
MERLIN ENTERTAINMENT	163	193	66	9,655	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	102.47	118.97	142	20,633	一般消費財・サービス
BP PLC	4,607	5,300	2,767	401,261	エネルギー
UNILEVER PLC	301.1	323.1	1,374	199,334	生活必需品
BARCLAYS PLC	3,955	4,500	752	109,131	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	384	440	372	54,080	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	381	421	127	18,479	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	21.5	24.8	159	23,195	素材
PRUDENTIAL PLC	602	690	1,068	154,938	金融
INMARSAT PLC	103	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	838.91	1,267.91	280	40,706	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	45.64	49.64	149	21,659	素材
BAE SYSTEMS PLC	748	856	419	60,860	資本財・サービス
AVIVA PLC	960.66	1,075.66	442	64,170	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,145.02	1,309.02	2,091	303,258	ヘルスケア
INFORMA PLC	—	320	227	32,927	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	100	115	180	26,231	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	1,263	232	33,772	資本財・サービス
WORLDPAY GROUP PLC	471	—	—	—	その他
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	80	93	33	4,927	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	224	253	110	16,043	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	20	26	154	22,376	資本財・サービス
GVC HOLDINGS PLC	—	140	105	15,256	一般消費財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
CONVATEC GROUP PLC	330	330	50	7,333	ヘルスケア
ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITL	17,664	—	—	—	資本財・サービス
ROYAL MAIL PLC	224	223	72	10,467	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC	—	27	95	13,867	ヘルスケア
RELX PLC	248.46	528.46	874	126,825	資本財・サービス
DIAGEO PLC	586	653	1,847	267,882	生活必需品
RIO TINTO PLC	287	314.5	1,138	165,046	素材
STANDARD CHARTERED PLC	779	813	500	72,539	金融
TESCO PLC	1,911	2,548	509	73,897	生活必需品
FRESNILLO PLC	50	56	43	6,311	素材
SMITH & NEPHEW PLC	203	235.5	334	48,578	ヘルスケア
GLENCORE PLC	2,851.25	3,066.25	899	130,412	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	162	180	116	16,877	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65	74	143	20,871	金融
SMITHS GROUP PLC	93.33	102.33	145	21,034	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	61	35	5,142	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	310.83	368.83	120	17,483	金融
DIXONS CARPHONE PLC	248	—	—	—	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	188.63	201.63	193	28,098	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	381.25	452.25	141	20,500	生活必需品
NEXT PLC	33	35.5	179	26,048	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	739	842	116	16,916	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	43.11	49.61	231	33,566	一般消費財・サービス
IMI PLC	66.5	—	—	—	資本財・サービス
BUNZL PLC	77.55	88.55	217	31,485	資本財・サービス
GKN PLC	406	—	—	—	その他
VODAFONE GROUP PLC	6,236.83	7,021.83	1,177	170,819	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	29.93	34.43	169	24,613	素材
KINGFISHER PLC	519.11	554.11	142	20,698	一般消費財・サービス
WPP PLC	298	331	287	41,662	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	159.27	171.27	133	19,347	公益事業
SEVERN TRENT PLC	57.33	63.33	118	17,237	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	157	178.5	1,182	171,405	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	119	136	140	20,382	金融
SCHRODERS PLC	28	30.5	78	11,455	金融
TATE & LYLE PLC	114	—	—	—	生活必需品
SSE PLC	239	264	290	42,072	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	54	61.5	90	13,069	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	227	259	122	17,753	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	297.5	334	2,055	298,058	ヘルスケア
FERGUSON PLC	59.65	62.37	315	45,691	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,381	1,551	383	55,642	金融
3I GROUP PLC	229.91	253.91	217	31,598	金融
SKY PLC	245	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ASHTED GROUP PLC	114	127	228	33,066	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	256.14	276.14	167	24,266	情報技術
NATIONAL GRID PLC	802.34	900.34	750	108,885	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	16,729.65	19,199.65	1,077	156,301	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	242.6	262.6	141	20,555	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	226.5	254	614	89,061	生活必需品
CENTRICA PLC	1,283.6	1,526.6	207	30,139	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	32	105	15,340	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	36.5	—	—	—	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	536.6	605.1	1,682	244,020	生活必需品	
BHP GROUP PLC	495.77	565.77	866	125,606	素材	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	81	91	222	32,290	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	4,695	5,302.5	3,548	514,558	金融	
SHIRE PLC	209.74	243.24	1,095	158,901	ヘルスケア	
OLD MUTUAL PLC	1,170.25	—	—	—	その他	
ANGLO AMERICAN PLC	306.83	328.83	529	76,818	素材	
MONDI PLC	83	93.5	162	23,510	素材	
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	593	144	20,938	生活必需品	
CARNIVAL PLC	45.11	48.61	224	32,622	一般消費財・サービス	
EASYJET PLC	35	40	45	6,632	資本財・サービス	
COMPASS GROUP PLC	373.89	422.39	705	102,319	一般消費財・サービス	
PERSIMMON PLC	70.5	85	167	24,226	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	1,966	2,224	582	84,479	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	44	52	123	17,946	生活必需品	
BURBERRY GROUP PLC	104.89	113.39	207	30,065	一般消費財・サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	42.86	46.36	200	29,035	一般消費財・サービス	
CAPITA PLC	150.9	—	—	—	資本財・サービス	
TRAVIS PERKINS PLC	59	69	75	10,986	資本財・サービス	
INTERTEC GROUP PLC	38	44	211	30,651	資本財・サービス	
ITV PLC	868	931	140	20,304	コミュニケーション・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	71.99	83.49	340	49,432	金融	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,043	1,217	2,886	418,603	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	872.18	995.68	2,404	348,614	エネルギー	
MEGGITT PLC	177	195	100	14,613	資本財・サービス	
G4S PLC	346	378	74	10,768	資本財・サービス	
COBHAM PLC	556	—	—	—	資本財・サービス	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	33	—	—	—	ヘルスケア	
ADMIRAL GROUP PLC	45	49.5	104	15,116	金融	
INVESTEC PLC	160	183	89	12,984	金融	
ANTOFAGASTA PLC	98	98	81	11,886	素材	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	633.57	587.62	158	23,053	金融	
EXPERIAN PLC	220.54	240.54	456	66,168	資本財・サービス	
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	89,576.69 105銘柄	79,841.11 96銘柄	47,102	6,830,372 <6.3%>	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
AZRIELI GROUP LTD	10	10	186	5,713	不動産	
FRUTAROM	9	—	—	—	その他	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	483	483	206	6,325	コミュニケーション・サービス	
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	176	382	11,708	素材	
ELBIT SYSTEMS LTD	6	6	273	8,353	資本財・サービス	
BANK HAPOALIM BM	245	266	678	20,755	金融	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	334	410	1,001	30,637	金融	
NICE LTD	14	16.5	706	21,609	情報技術	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	30	30	202	6,201	金融	
イスラエル・シケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,271 9銘柄	1,397.5 8銘柄	3,637	111,304 <0.1%>	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG	8.5	8.5	92	10,523	一般消費財・サービス	
UBS GROUP AG-REG	855	1,022.5	1,395	158,913	金融	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	108	12,346	素材	
ADECCO GROUP AG-REG	39	42.5	210	23,971	資本財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	164.8	185.2	4,707	536,216	ヘルスケア	
PARGESA HOLDING SA-BR	9.5	9.5	66	7,579	金融	
SIKA AG-REG	0.5	33.6	417	47,531	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.03	240	27,438	生活必需品	
ABB LTD-REG	464	487	989	112,658	資本財・サービス	
SWISS RE AG	75.5	84	768	87,524	金融	
NESTLE SA-REG	725.5	820	6,986	795,750	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4.2	4.5	300	34,263	金融	
SCHINDLER HOLDING-PART. CERT	9.7	10.5	215	24,588	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	561.2	671.2	800	91,166	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD	52	59	242	27,565	金融	
SGS SA-REG	1.3	1.4	333	37,935	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	5	99	11,350	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG	12	12	151	17,303	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG	—	15.5	195	22,315	情報技術	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7.4	8.5	255	29,131	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	35.22	40.22	1,261	143,661	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG	12	13	193	22,047	金融	
CLARIANT AG-REG	—	57	116	13,244	素材	
NOVARTIS AG-REG	517.5	574	5,186	590,761	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.5	0.6	103	11,774	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	122	139.6	916	104,434	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	6.2	7.1	337	38,453	コミュニケーション・サービス	
GEBERIT AG-REG	8.5	9.9	387	44,191	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	2.2	2.5	619	70,561	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2.2	2.7	164	18,743	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	12	14.2	229	26,120	ヘルスケア	
LONZA GROUP AG-REG	17.5	20.1	641	73,054	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	13	15.2	90	10,257	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	105.4	127.9	581	66,210	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	7.7	9	352	40,173	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	12.5	14.9	211	24,115	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	16.5	20.3	166	18,994	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.23	0.29	198	22,626	生活必需品	
スイス・フラン通貨計	株数、金額	3,888.27	4,550.94	30,338	3,455,503	
	銘柄数 < 比率 >	36銘柄	38銘柄		< 3.2% >	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	434	482	14,416	249,551	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	175.5	188	2,475	42,858	金融	
ISS A/S	39	44	953	16,504	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.85	0.95	857	14,841	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S	17	17	451	7,812	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	50	52.5	2,547	44,102	資本財・サービス	
TDC A/S	193	—	—	—	その他	
CARLSBERG AS-B	24.5	27.5	1,972	34,150	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	52	58	1,806	31,263	素材	
COLOPLAST-B	28	31	1,995	34,536	ヘルスケア	
DSV A/S	45	50.1	2,582	44,697	資本財・サービス	
WILLIAM DEMANT HOLDING	26.75	26.75	528	9,154	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.5	1.7	1,649	28,544	資本財・サービス	
TRYG A/S	25	33	535	9,271	金融	
PANDORA A/S	25.5	27.5	985	17,055	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	23.5	25.5	1,523	26,369	素材	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	首数	当		期 末		業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
GENMAB A/S	13	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		ヘルスケア
ORSTED A/S	44.5		50.5	1,708	29,574		公益事業
				2,190	37,920		
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,218.6	1,133	39,180	678,209		
		18 銘柄	17 銘柄		<0.6% >		
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORSK HYDRO ASA	306		352	1,441	19,142		素材
DNB ASA	225.5		261.5	3,892	51,691		金融
ORKLA ASA	190.5		208.5	1,481	19,675		生活必需品
TELENOR ASA	180		199	3,297	43,789		コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	260.73		312.23	6,238	82,845		エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	15		—	—	—		コミュニケーション・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	41.6		45.6	1,586	21,073		素材
MARINE HARVEST	99		110.5	2,198	29,202		生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48.5		48.5	664	8,830		金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	18		24	679	9,019		コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	—		29	713	9,481		エネルギー
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,384.83	1,590.83	22,195	294,752		
		10 銘柄	10 銘柄		<0.3% >		
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円		
ICA GRUPPEN AB	19		19	630	7,884		生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	710.3		811.3	6,156	77,013		情報技術
VOLVO AB-B SHS	366		421	5,346	66,887		資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15		18	954	11,945		コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES	87.5		97.5	1,388	17,368		資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	54.5		59.5	1,226	15,340		一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB	708.5		—	—	—		その他
SWEDISH MATCH AB	41.5		46	1,645	20,584		生活必需品
TELE2 AB-B SHS	89.5		137	1,565	19,580		コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	56		—	—	—		ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	350.5		430.5	4,091	51,184		金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	352		410.5	4,125	51,610		金融
SWEDBANK AB - A SHARES	209		235	4,951	61,942		金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	226		235.5	3,993	49,954		一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS	76.5		91.5	1,322	16,546		資本財・サービス
SANDVIK AB	262.5		298.5	4,020	50,300		資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	105.5		123	4,841	60,564		金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	157		173.5	3,801	47,555		資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	74		84.5	1,286	16,088		資本財・サービス
TELIA CO AB	600		770	3,237	40,505		コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	70		77	1,493	18,677		資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	91		103	2,086	26,105		資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	233		268.5	4,528	56,648		資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	9		18	492	6,160		金融
LUNDIN PETROLEUM AB	42		46.5	1,111	13,902		エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	141		157	3,658	45,762		生活必需品
BOLIDEN AB	65		70	1,417	17,732		素材
EPIROC AB-A	—		179.5	1,351	16,906		資本財・サービス
EPIROC AB-B	—		97	703	8,795		資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	97.5		114.5	827	10,356		一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP	—		794	6,485	81,132		金融
KINNEVIK AB - B	53		60.5	1,435	17,960		金融

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
HEXAGON AB-B SHS	62	69	千スウェーデン・クローネ	千円	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	40	46	3,169	39,654	金融	
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,464.3 31銘柄	6,562.3 32銘柄	84,197	1,053,312	<1.0%>
ユーロ (アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	—	60	142	18,463	素材	
AIB GROUP PLC	—	230	87	11,368	金融	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	220.6	274.6	159	20,646	金融	
KERRY GROUP PLC-A	38.5	42.2	384	49,638	生活必需品	
CRH PLC	194	227	561	72,582	素材	
PADDY POWER BETFAIR PLC	19	22	175	22,666	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	472.1 4銘柄	855.8 6銘柄	1,512	195,366	<0.2%>
ユーロ (オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.	52.48	59.98	187	24,160	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	214.76	245.26	806	104,244	ヘルスケア	
NN GROUP NV	75	80.5	305	39,456	金融	
UNILEVER NV-CVA	379.5	411	2,012	259,989	生活必需品	
HEINEKEN NV	61	67	534	69,003	生活必需品	
AEGON NV	407.44	447.44	222	28,728	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	294.83	334.83	753	97,349	生活必需品	
AKZO NOBEL	58	66	487	62,942	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	43.5	47.5	370	47,864	素材	
WOLTERS KLUWER	69	78	418	54,112	資本財・サービス	
BOSKALIS WESTMINSTER	21	—	—	—	資本財・サービス	
ING GROEP NV	903.5	1,034.5	1,117	144,392	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	782.5	842.5	213	27,613	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	87.5	109	1,648	212,971	情報技術	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	88	110.5	252	32,576	金融	
VOPAK	16	19	73	9,526	エネルギー	
RANDSTAD NV	28.5	32	135	17,549	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	26	31.5	241	31,212	生活必需品	
GEMALTO	20	—	—	—	情報技術	
ALTICE EUROPE NV	115	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ALTICE EUROPE NV - B	21	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
STMICROELECTRONICS NV	146	185.5	240	31,082	情報技術	
AIRBUS SE	135.5	154.5	1,465	189,339	資本財・サービス	
EXOR NV	25	28.8	149	19,295	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	243	272	229	29,700	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	250.5	285.5	420	54,329	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	28.35	31.45	302	39,029	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,592.86 27銘柄	4,974.26 23銘柄	12,589	1,626,472	<1.5%>
ユーロ (ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	30	32.5	238	30,793	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	58	65	414	53,524	金融	
COLRUYT SA	16	16	90	11,703	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	18.5	20	160	20,685	金融	
SOLVAY SA	17	19.5	188	24,295	素材	
UMICORE	45	54	204	26,481	素材	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	178.1	203.5	1,371	177,143	生活必需品	
AGEAS	41.4	49.4	212	27,468	金融	
PROXIMUS	35	41	98	12,775	コミュニケーション・サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	12	14.5	62	8,077	コミュニケーション・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	451 10銘柄	515.4 10銘柄	3,041 <0.4%>	392,948	
ユーロ (ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
RTL GROUP	10	10	53	6,937	コミュニケーション・サービス	
ARCELORMITTAL	156	177	354	45,859	素材	
EUROFINS SCIENTIFIC	2.7	2.9	114	14,828	ヘルスケア	
SES	83.5	97	177	22,957	コミュニケーション・サービス	
TENARIS SA	112.5	120	129	16,789	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	364.7 5銘柄	406.9 5銘柄	831 <0.1%>	107,372	
ユーロ (フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	16	19	56	7,349	コミュニケーション・サービス	
TOTAL SA	547.5	636.5	3,083	398,319	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	39.5	45	413	53,449	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	99.52	112.92	1,176	151,935	素材	
KERING	17.9	19.8	769	99,427	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	132	145	932	120,525	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	50	56	194	25,133	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	260.5	299	1,338	172,956	金融	
PEUGEOT SA	123.5	154.5	300	38,861	一般消費財・サービス	
NATIXIS	229.5	253.5	125	16,194	金融	
THALES SA	25.5	28.5	305	39,488	資本財・サービス	
DANONE	138.5	162	1,061	137,167	生活必需品	
CARREFOUR SA	128	158	259	33,506	生活必需品	
SUEZ	88.75	99.25	130	16,848	公益事業	
VIVENDI	237.41	279.91	623	80,604	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL	58.5	67.3	1,402	181,193	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	115	130.5	429	55,433	資本財・サービス	
LEGRAND SA	63.17	72.17	390	50,384	資本財・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	15.5	62	8,109	生活必需品	
PERNOD RICARD SA	49.17	56.17	788	101,846	生活必需品	
SOCIETE BIC SA	7	7	66	8,545	資本財・サービス	
EURAZEO SE	11.16	11.95	80	10,366	金融	
REXEL SA	70.5	78.5	83	10,754	資本財・サービス	
SOCIETE GENERALE SA	180	200.5	658	85,038	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	65.6	73.5	1,885	243,558	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	44	49.5	197	25,496	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	37.5	42.2	434	56,071	情報技術	
VALEO SA	56.5	64	163	21,116	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	47.5	56	295	38,126	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	60.5	71	138	17,845	資本財・サービス	
EIFFAGE	17	21.4	182	23,566	資本財・サービス	
SODEXO SA	21.5	25	228	29,461	一般消費財・サービス	
IPSEN	9	10	114	14,727	ヘルスケア	
INGENICO GROUP	13.5	16	103	13,324	情報技術	
AMUNDI SA	—	15	76	9,871	金融	
TELEPERFORMANCE	—	15	217	28,060	資本財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
UBISOFT ENTERTAINMENT	—	20	141	18,251	コミュニケーション・サービス	
ZODIAC AEROSPACE	48	—	—	—	その他	
FAURECIA	—	19	69	9,013	一般消費財・サービス	
SEB SA	5	5.6	72	9,347	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	48.5	54.3	606	78,322	ヘルスケア	
DASSAULT AVIATION SA	0.6	0.7	94	12,208	資本財・サービス	
AXA SA	455	518	1,115	144,113	金融	
LAGARDERE SCA	26.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
EDENRED	53.5	64	213	27,640	資本財・サービス	
RENAULT SA	41	50	312	40,307	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	7.3	8.6	417	53,896	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	5.5	5.5	56	7,247	生活必需品	
ATOS SE	21.5	25	187	24,261	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SA	30.5	33.8	363	46,897	情報技術	
WENDEL	6.8	6.8	73	9,487	金融	
ORANGE	468	536.5	805	104,104	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	36.5	40.5	158	20,442	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	37.5	43	86	11,232	金融	
SANOFI	263.25	296.75	2,340	302,364	ヘルスケア	
VINCI SA	116.5	134.5	1,043	134,803	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	114.5	144.5	270	34,983	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	270	301	332	42,977	金融	
BIOMERIEUX	—	11.5	74	9,656	ヘルスケア	
ENGIE	428.73	478.73	597	77,247	公益事業	
IMERYS SA	9	9	43	5,657	素材	
EDF	127.5	159.5	234	30,311	公益事業	
SAFRAN SA	74	88	981	126,761	資本財・サービス	
ILIAD SA	6	6.5	80	10,463	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA	15.5	17.7	149	19,354	素材	
ADP	7.5	8.1	140	18,124	資本財・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	40.5	47	85	11,008	コミュニケーション・サービス	
SCOR SE	41.5	41.5	176	22,785	金融	
GETLINK	104.5	124	142	18,390	資本財・サービス	
BOLLORE	190	241	95	12,348	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,174.86 65銘柄	7,107.65 68銘柄	30,332	3,918,679 <3.6%>	
ユーロ (ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	193.5	246.7	1,573	203,242	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG	38	42.5	102	13,243	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	486.5	531.5	441	56,991	金融	
COMMERZBANK AG	246.85	263.35	207	26,853	金融	
VOLKSWAGEN AG	8	8.9	129	16,752	一般消費財・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	43	49.7	745	96,349	一般消費財・サービス	
MAN SE	8.5	—	—	—	資本財・サービス	
SIEMENS AG-REG	179.5	202	2,066	266,965	資本財・サービス	
E.ON SE	517	591	530	68,555	公益事業	
UNIPER SE	—	53.5	123	15,972	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	78	86.5	630	81,409	一般消費財・サービス	
GEA GROUP AG	42	45	108	13,987	資本財・サービス	
OSRAM LICHT AG	23.6	25.6	105	13,645	資本財・サービス	
CONTINENTAL AG	25.5	29.7	394	50,973	一般消費財・サービス	
BASF SE	213.5	244.2	1,583	204,621	素材	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
K+S AG-REG	44	48	76	9,853	素材	
ALLIANZ SE-REG	106.5	116.3	2,199	284,209	金融	
THYSSENKRUPP AG	102	114.5	191	24,747	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	42	46.5	475	61,485	生活必需品	
RWE AG	119	141.5	269	34,824	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	56.5	61	131	16,959	資本財・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	10	67	8,691	資本財・サービス	
BRENTNAG AG	36.5	39.5	161	20,922	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	96.5	112.5	577	74,645	ヘルスケア	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	30	33.2	133	17,306	コミュニケーション・サービス	
HOCHTIEF AG	5	5.3	66	8,634	資本財・サービス	
SAP SE	229.92	261.42	2,381	307,670	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	36.2	39.8	764	98,773	金融	
SCHAEFFLER AG	38	38	28	3,710	一般消費財・サービス	
ZALANDO SE	26	29	83	10,744	一般消費財・サービス	
HEIDELBERGCEMENT AG	35	39	231	29,958	素材	
KION GROUP AG	16.5	18.5	94	12,208	資本財・サービス	
WIRECARD AG	—	30.7	418	54,058	情報技術	
COVESTRO AG	26	52	266	34,489	素材	
INNOGY SE	34	37.3	149	19,275	公益事業	
SARTORIUS AG-VORZUG	—	9.5	110	14,212	ヘルスケア	
PORSCHE AUTOMOBIL HDG-PRF	35.5	40	226	29,289	一般消費財・サービス	
DELIVERY HERO SE	—	25	83	10,774	一般消費財・サービス	
METRO AG	41	50	68	8,875	生活必需品	
1&1 DRILLISCH AG	—	13	58	7,560	コミュニケーション・サービス	
LINDE AG - TENDER	43	—	—	—	その他	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	—	40	155	20,050	ヘルスケア	
BEIERSDORF AG	23	26.9	252	32,666	生活必需品	
FUCHS PETROLUB SE -PRF	15	17	63	8,187	素材	
MERCK KGAA	31	34.5	335	43,340	ヘルスケア	
ADIDAS AG	44.1	49.3	973	125,789	一般消費財・サービス	
PUMA SE	—	2.06	92	11,935	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	24	28.5	260	33,615	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	758	878	1,350	174,510	コミュニケーション・サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	50.5	58.7	425	54,919	ヘルスケア	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	225	238.5	1,208	156,123	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	262	300.5	551	71,198	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	14	16.1	197	25,562	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	226	263.5	752	97,222	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	44.5	51	567	73,266	金融	
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	55.5	59.5	108	13,966	コミュニケーション・サービス	
LANXESS AG	—	22	108	13,989	素材	
MTU AERO ENGINES AG	22	14.3	251	32,496	資本財・サービス	
AXEL SPRINGER SE	12	12	67	8,720	コミュニケーション・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	84	94	398	51,538	不動産	
SYMRISE AG	30	32	227	29,335	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	165	188	67	8,685	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	12	13.5	86	11,196	一般消費財・サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	14.5	15.9	99	12,801	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	109	132	570	73,737	不動産	
国小計	株数、金額	5,532.67	6,419.43	27,233	3,518,304	
	銘柄数 < 比率 >	57銘柄	63銘柄		< 3.3% >	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ (ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	60	60	63	8,208	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	495	660	202	26,176	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	116.5	116.5	168	21,733	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	671.5 3銘柄	836.5 3銘柄	434	56,118 <0.1%>	
ユーロ (スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELEFONICA SA	1,046.27	1,250.27	975	126,052	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	76.5	82.5	162	20,937	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,555.12	1,748.12	872	112,693	金融	
IBERDROLA SA	1,357.34	1,621.34	1,070	138,286	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,229.09	1,449.09	162	21,042	金融	
BANKINTER SA	151	183	135	17,528	金融	
REPSOL SA	287	366.5	554	71,685	エネルギー	
GRIFOLS SA	67	77.5	203	26,232	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	3,782.5	4,264.5	1,796	232,134	金融	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	158	—	—	—	資本財・サービス	
AMADEUS IT GROUP SA	101	117	749	96,767	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	84.5	90.5	196	25,359	公益事業	
MAPFRE SA	254.5	254.5	64	8,298	金融	
CAIXABANK SA	816	941	340	44,007	金融	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	152	152	107	13,836	資本財・サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	53.76	67.26	227	29,413	資本財・サービス	
AENA SME SA	16	18.5	262	33,950	資本財・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	253	285	778	100,553	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	56	56	70	9,151	資本財・サービス	
ENAGAS SA	54	59	142	18,346	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	100	115	217	28,161	公益事業	
FERROVIAL SA	117	134	242	31,316	資本財・サービス	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	157	—	—	—	生活必需品	
BANKIA SA	241.05	301.05	87	11,313	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,165.63 24銘柄	13,633.63 22銘柄	9,420	1,217,067 <1.1%>	
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	217.5	—	—	—	金融	
PRYSMIAN SPA	48	61.5	98	12,704	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	290.43	313.43	462	59,745	金融	
SAIPEM SPA	134.3	—	—	—	エネルギー	
MEDIOBANCA SPA	130.15	152.65	119	15,398	金融	
UNICREDIT SPA	473.06	531.56	612	79,082	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,662.82	2,827.82	159	20,626	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,349.5	1,469.5	71	9,197	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO-RSP	210	—	—	—	金融	
INTESA SANPAOLO	3,143.97	3,962.37	805	104,043	金融	
ATLANTIA SPA	106.07	134.57	246	31,892	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	118	135	90	11,695	金融	
MONCLER SPA	—	47	138	17,918	一般消費財・サービス	
RECORDATI SPA	26	26	72	9,378	ヘルスケア	
ENI SPA	591	682	969	125,253	エネルギー	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	—	143	104	13,513	生活必需品	
PIRELLI & C SPA	—	110	68	8,873	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	株数	期首		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
LEONARDO SPA	95.25	109.75	95	12,275	資本財・サービス	
ENEL SPA	1,896.34	2,154.34	1,025	132,424	公益事業	
SNAM SPA	532	616	236	30,503	エネルギー	
LUXOTTICA GROUP SPA	38.5	45	232	30,056	一般消費財・サービス	
TERNA SPA	324	389	189	24,544	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,386.89 19銘柄	13,910.49 19銘柄	5,798	749,129 <0.7%>	
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	124	137	327	42,282	素材	
NOKIA OYJ	1,389.5	1,467.5	709	91,721	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	33.5	120	176	22,796	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	131	138	154	19,905	素材	
METSO OYJ	24	28	70	9,162	資本財・サービス	
ELISA OYJ	32.5	36.5	126	16,338	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	103.5	116.5	462	59,690	金融	
FORTUM OYJ	104.5	122.5	224	28,953	公益事業	
KONE OYJ-B	78.5	88	390	50,443	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	26.5	30.5	86	11,202	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	29.5	34.5	240	31,030	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	24.5	27.5	81	10,494	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,101.5 12銘柄	2,346.5 12銘柄	3,049	394,022 <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	160	20,697	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	66.5	74	258	33,364	金融	
VOESTALPINE AG	28.5	28.5	83	10,751	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	34	34	89	11,547	金融	
ANDRITZ AG	16	21	88	11,486	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	180.5 5銘柄	193 5銘柄	679	87,848 <0.1%>	
ユーロ (その他)	百株	百株	千ユーロ	千円		
RELX PLC	227.19	—	—	—	資本財・サービス	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	52	—	—	—	生活必需品	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	279.19 2銘柄	— —	—	— <—>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	45,373.4 233銘柄	51,199.56 236銘柄	94,924	12,263,329 <11.4%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	278,979.17 1,256銘柄	293,599.53 1,242銘柄	—	102,418,129 <95.1%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘	柄	期 首		期 末	
		□ 数	□ 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)					
AVALONBAY COMMUNITIES INC		3.197	3.617	680	77,187
SIMON PROPERTY GROUP INC		7.137	8.137	1,502	170,442
BOSTON PROPERTIES INC		3.55	4	519	58,922
GGP INC		14.4	—	—	—
VORNADO REALTY TRUST		3.827	4.347	306	34,813
SBA COMMUNICATIONS CORP		2.75	3.05	514	58,332
EQUITY RESIDENTIAL		8.5	9.8	688	78,140
EQUINIX INC		1.808	2.088	802	91,005
AMERICAN TOWER CORP		9.75	11.45	1,863	211,410
HOST HOTELS & RESORTS INC		17.293	20.043	386	43,893
KIMCO REALTY CORP		10	11.1	176	20,064
COLONY CAPITAL INC		12	—	—	—
INVITATION HOMES INC		—	8.3	177	20,145
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A		—	6.279	109	12,461
VENTAS INC		8.3	9.15	571	64,838
WEYERHAEUSER CO		16.964	20.064	536	60,877
AGNC INVESTMENT CORP		9	12.3	218	24,745
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		6.9	—	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP		9.25	10.9	1,231	139,760
IRON MOUNTAIN INC		5.61	6.76	228	25,888
VEREIT INC		22.3	24.4	186	21,124
PROLOGIS INC		12.262	16.412	1,102	125,107
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		2.1	2.72	332	37,771
CAMDEN PROPERTY TRUST		2.15	2.35	220	24,990
DUKE REALTY CORP		8	9.4	263	29,939
ESSEX PROPERTY TRUST INC		1.48	1.7	440	50,026
FEDERAL REALTY INVS TRUST		1.6	1.85	242	27,476
WELLTOWER INC		8.4	9.7	692	78,620
HCP INC		10.7	12.4	357	40,522
LIBERTY PROPERTY TRUST		3.3	3.95	175	19,904
MID-AMERICA APARTMENT COMM		2.6	3	306	34,796
MACERICH CO/THE		2.7	2.9	145	16,472
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		26.6	33.6	338	38,354
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		3.4	4.15	205	23,295
REALTY INCOME CORP		6.45	7.55	482	54,708
PUBLIC STORAGE		3.6	4.15	879	99,764
REGENCY CENTERS CORP		3.5	4.05	254	28,869
SL GREEN REALTY CORP		2.25	2.4	225	25,549
UDR INC		6.3	6.8	284	32,322
WP CAREY INC		—	4.3	291	33,076
DIGITAL REALTY TRUST INC		4.75	5.5	625	70,952
EXTRA SPACE STORAGE INC		3	3.25	306	34,808
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	287.678 39銘柄	317.917 39銘柄	18,871	2,141,387 <2.0%>
(カナダ)					
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1.5	1.5	46	4,010
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3	3.7	78	6,706
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		3.9	3.9	96	8,208
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	8.4 3銘柄	9.1 3銘柄	221	18,925 <0.0%>

外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期 首 □ 数	当 期 □ 数	期 末 評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENLEASE GROUP	13.3	14.9	195	16,265
TRANSURBAN GROUP	47.8	68.1	782	65,007
SYDNEY AIRPORT	25.1	30.3	207	17,243
APA GROUP	26.7	31.2	286	23,769
SCENTRE GROUP	124.222	143.322	574	47,747
DEXUS	23.95	25.85	279	23,258
GPT GROUP	44.06	47.56	255	21,257
MIRVAC GROUP	84.4	98.8	223	18,550
STOCKLAND	57	66	248	20,617
WESTFIELD CORP	45.496	—	—	—
GOODMAN GROUP	41.7	43.9	468	38,952
VICINITY CENTRES	76.973	89.273	243	20,247
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	610.701 12 銘柄	659.205 11 銘柄	3,766 <0.3%>
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円
LINK REIT	52	57	4,300	62,402
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	64.5	64.5	489	7,103
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	87	99	1,110	16,117
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	203.5 3 銘柄	220.5 3 銘柄	5,900 <0.1%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	60.1	70.1	123	10,226
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	57.4	69.5	180	14,920
CAPITALAND MALL TRUST	63.2	63.2	142	11,839
SUNTEC REIT	53	63	113	9,399
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	233.7 4 銘柄	265.8 4 銘柄	559 <0.0%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	17.062	19.662	163	23,733
SEGRO PLC	23.75	25.75	158	22,964
HAMMERSON PLC	19.2	19.2	74	10,833
BRITISH LAND CO PLC	22.1	23.4	133	19,341
INTU PROPERTIES PLC	21.1	—	—	—
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	103.212 5 銘柄	88.012 4 銘柄	530 <0.1%>
(ユーロ (フランス))	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	3.61	558	72,129
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.35	—	—	—
ICADE	0.9	0.8	57	7,363
GECCINA SA	1.15	1.25	156	20,250
KLEPIERRE	5.2	5.65	165	21,328
COVIVIO	0.75	0.97	84	10,946
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	10.35 5 銘柄	12.28 5 銘柄	1,021 <0.1%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,457.541 71 銘柄	1,572.814 69 銘柄	— <2.6%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 2,428	百万円 —

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 102,418,129	% 95.1
投資信託証券	2,814,132	2.6
コール・ローン等、その他	2,499,011	2.3
投資信託財産総額	107,731,273	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1香港・ドル=14.51円、1シンガポール・ドル=82.89円、1ニュージーランド・ドル=77.87円、1イギリス・ポンド=145.01円、1イスラエル・シェケル=30.60円、1スイス・フラン=113.90円、1デンマーク・クローネ=17.31円、1ノルウェー・クローネ=13.28円、1スウェーデン・クローネ=12.51円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(106,744,284千円)の投資信託財産総額(107,731,273千円)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

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	108,668,834,711円
コール・ローン等	1,481,765,867
株式（評価額）	102,418,129,349
投資信託証券（評価額）	2,814,132,682
未収入金	987,891,840
未収配当金	196,655,015
差入委託証拠金	770,259,958
(B)負債	975,308,842
未払金	941,976,460
未払解約金	33,327,900
その他未払費用	4,482
(C)純資産総額（A－B）	107,693,525,869
元本	43,964,024,902
次期繰越損益金	63,729,500,967
(D)受益権総口数	43,964,024,902口
1万口当り基準価額（C/D）	24,496円

* 期首における元本額は39,734,106,968円、当作成期間中における追加設定元本額は7,457,653,079円、同解約元本額は3,227,735,145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 A507,485,808円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）14,096,372円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）197,649,153円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）25,055,668円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）627,330,937円、外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）812,920円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）550,738,616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）1,489,095,675円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）529,688,114円、D－I's 外国株式インデックス5,542,491円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 197,868円、iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）723,449,418円、iFree 8資産バランス557,965,043円、iFree 年金バランス8,203,476円、DCダイワ外国株式インデックス27,624,252,366円、ダイワ・ライフ・バランス30 569,101,264円、ダイワ・ライフ・バランス50 839,595,806円、ダイワ・ライフ・バランス70 676,868,528円、大和DC海外株式インデックスファンド1,489,592,147円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 4,144,667円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 13,247,986円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 4,228,403円、ダイワつみたてインデックス外国株式4,608,188円、ダイワ世界分散バランスファンド15VA76,173円、ダイワ世界分散バランスファンド20VA156,042円、ダイワ世界分散バランスファンド25VA1,204,032円、ダイワ世界分散バランスファンド30VA2,140,945円、ダイワ世界分散バランスファンド40VA237,257,604円、ダイワ世界分散バランスファンド60VA353,114,328円、ダイワ・バランスファンド35VA3,137,819,193円、ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）153,703,054円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式631,981,535円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド88,367,711円、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）453,744円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,746,321,380円、ダイワライフスタイル25 19,463,084円、ダイワライフスタイル50 70,173,613円、ダイワライフスタイル75 58,841,550円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,496円です。

■損益の状況

当期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2, 238, 368, 228円
受取配当金	2, 230, 054, 681
受取利息	1, 602, 711
その他収益金	7, 233, 728
支払利息	△ 522, 892
(B) 有価証券売買損益	288, 319, 317
売買益	8, 625, 906, 440
売買損	△ 8, 337, 587, 123
(C) 先物取引等損益	66, 002, 151
取引益	346, 066, 933
取引損	△ 280, 064, 782
(D) その他費用	△ 52, 956, 222
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	2, 539, 733, 474
(F) 前期繰越損益金	55, 193, 221, 227
(G) 解約差損益金	△ 4, 705, 704, 655
(H) 追加信託差損益金	10, 702, 250, 921
(I) 合計 (E + F + G + H)	63, 729, 500, 967
次期繰越損益金 (I)	63, 729, 500, 967

(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。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド

運用報告書 第8期 (決算日 2018年7月5日)

(計算期間 2017年7月6日～2018年7月5日)

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの第8期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

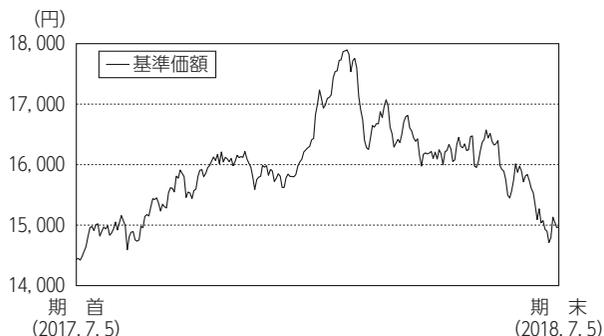
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,435円 期末：14,971円 騰落率：3.7%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク (FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)) に連動させることをめざした運用を行なった結果、新興国株式が中国や資源国を中心に全体として上昇基調だったことからベンチマークが上昇し、当ファンドの基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○新興国株式市況

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

国別では、2017年GDP (国内総生産) 成長率が前年を上回るなど、堅調な内需を受けた中国株式市場は上昇しました。資源価格の上昇を受けて、ロシア株式市場や南アフリカ株式市場、ブラジル株式市場なども堅調でした。一方、政府の経済政策や中央銀行への干渉が懸念材料となったトルコ株式市場、通貨安と燃料補助金問題が悪材料となったインドネシア株式市場は下落しました。

○為替相場

為替相場は、米国金利の上昇を受けて、新興国通貨全体としては対米ドルで下落しました。通貨別では、堅調な国内景気と米国との貿易摩擦の激化が材料となり、中国・人民元は買われました。また一部のアジア通貨も、中国景気の堅調さを好感して上昇しました。一方、中央銀行の独立性に対する懸念と米国金利の上昇が要因となって国外への資金流出が加速したことで、トルコ・リラは急落しました。N A F T A (北米自由貿易協定) 再交渉問題が悪材料となったメキシコ・ペソ、シリア問題で米国との対立が激化したことが嫌気されたロシア・ルーブル、燃料価格の上昇に端を發したトラック運転手のストライキなどによる経済的混乱を受けたブラジル・レアルも売られました。なお、円は対米ドルで期を通じてやや円安となった結果、新興国通貨は対円ではまちまちの値動きとなりました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

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

◆ポートフォリオについて

株式組入比率 (D R、E T F、株価指数先物を含む。以下同じ。) は、FTSE RAFI エマージング インデックスのリバランス時や大量

年月日	基準価額		FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率						
(期首)2017年7月5日	円	%	円	%	%	%	%	%	%
7月5日	14,435	—	15,859	—	91.8	—	—	—	5.6
7月末	14,832	2.8	16,337	3.0	91.0	0.2	—	—	6.9
8月末	15,437	6.9	17,046	7.5	92.5	—	—	—	5.9
9月末	15,440	7.0	17,051	7.5	93.4	—	—	—	4.6
10月末	15,981	10.7	17,685	11.5	90.2	—	—	—	7.8
11月末	15,894	10.1	17,595	11.0	86.4	—	—	—	12.1
12月末	16,431	13.8	18,185	14.7	83.9	—	—	—	14.3
2018年1月末	17,536	21.5	19,423	22.5	81.0	—	—	—	16.9
2月末	16,960	17.5	18,832	18.8	84.1	—	—	—	14.5
3月末	16,190	12.2	17,913	13.0	93.6	1.0	—	—	3.6
4月末	16,245	12.5	17,986	13.4	90.3	0.7	—	—	7.8
5月末	15,449	7.0	17,119	7.9	86.4	0.7	—	—	11.4
6月末	14,790	2.5	16,396	3.4	82.9	0.7	—	—	14.9
(期末)2018年7月5日	14,971	3.7	16,627	4.8	81.7	0.7	—	—	15.8

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

設定時を除き、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないました。

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

未取配当金部分等については株式の組み入れができないため、期を通じて、株式組入比率を基本的に97~99%台で推移させました。その結果、ベンチマークの上昇に対しマイナスの乖離が発生しました。

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

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

《今後の運用方針》

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

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	12円
(株式)	(8)
(先物)	(1)
(投資信託証券)	(3)
有価証券取引税	5
(株式)	(5)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	48
(保管費用)	(43)
(その他)	(5)
合 計	66

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1)株 式

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 2,109.29 ()	千アメリカ・ドル 1,605 ()	百株 19,747.33	千アメリカ・ドル 196
	香港	百株 56,539 (38.92)	千香港ドル 41,472 (△ 414)	百株 3,494	千香港ドル 7,625
	シンガポール	百株 325 ()	千シンガポール・ドル 40 ()	百株 —	千シンガポール・ドル —
	台湾	百株 22,480 (△ 686.57)	千台湾ドル 87,017 (△ 1,344)	百株 570	千台湾ドル 4,369
	トルコ	百株 1,020.9 ()	千トルコ・リラ 1,272 ()	百株 415.6	千トルコ・リラ 452
	メキシコ	百株 3,638.7 ()	千メキシコ・ペソ 10,763 ()	百株 1,001.85	千メキシコ・ペソ 2,499
	チリ	百株 4,167.1 (552.79)	千チリ・ペソ 207,792 (△ 8,375)	百株 31.7	千チリ・ペソ 43,271
	インド	百株 3,022.7 (482.69)	千インド・ルピー 94,146 ()	百株 1,119	千インド・ルピー 18,908
	インドネシア	百株 6,430 (4,458)	千インドネシア・ルピア 3,287,820 ()	百株 2,384	千インドネシア・ルピア 1,055,474
	ブラジル	百株 3,206 (74.43)	千ブラジル・リアル 6,814 (△ 5)	百株 724.63	千ブラジル・リアル 1,755
国	マレーシア	百株 3,909 (914)	千マレーシア・リンギット 1,916 ()	百株 876	千マレーシア・リンギット 697
	南アフリカ	百株 4,607.4 ()	千南アフリカ・ランド 12,308 (△ 22)	百株 4,089.7	千南アフリカ・ランド 9,227
	タイ	百株 1,861 (2,511)	千タイ・バーツ 18,362 ()	百株 507	千タイ・バーツ 3,506
	ポーランド	百株 226.3 ()	千ポーランド・ズロチ 716 ()	百株 467.1	千ポーランド・ズロチ 574

(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

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外	千口 717.5 (ー)	千アメリカ・ドル 15,849 (ー)	千口 430.5 (ー)	千アメリカ・ドル 10,058 (ー)
	千口 16.1 (ー)	千メキシコ・ペソ 461 (△ 4)	千口 — (ー)	千メキシコ・ペソ — (ー)
国	千口 26.9 (ー)	千南アフリカ・ランド 408 (ー)	千口 — (ー)	千南アフリカ・ランド — (ー)

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	1,438	1,384	—	—

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

買 付	当			期 付	期 付		
	銘 柄	株 数	金 額		銘 柄	株 数	金 額
		千株	千円			千株	千円
			円				円
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	627	67,637	107	CHINA EVERGRANDE GROUP (ケイマン諸島)	59	20,673	350
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	166	56,859	342	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	23.1	17,313	749
CHINA MOBILE LTD (香港)	52	53,947	1,037	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	0.54	16,517	30,588
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	50	43,059	861	MTN GROUP LTD (南アフリカ)	13.55	14,931	1,101
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	719	42,172	58	RELIANCE INDUSTRIES LTD (インド)	9.73	14,420	1,482
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	366	31,745	86	PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	9.5	11,543	1,215
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	337	28,982	86	VALE SA (ブラジル)	7.7	10,445	1,356
GAZPROM PAO -SPON ADR (ロシア)	51.79	25,467	491	ICICI BANK LTD (インド)	20.734	9,940	479
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	14.7	23,116	1,572	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV (オランダ)	365.93	9,862	26
BANCO DO BRASIL S. A. (ブラジル)	15.8	20,527	1,299	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO (ケイマン諸島)	44	9,838	223

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

買 付	当			期 付	期 付		
	銘 柄	□ 数	金 額		銘 柄	□ 数	金 額
		千口	千円			千口	千円
			円				円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	717.5	1,749,883	2,438	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	430.5	1,085,447	2,521
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	16.1	2,723	169				
REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	20.26	2,076	102				
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	6.64	1,507	227				

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	株数	金額	期首	当	期末		業種等
			株数	株数	評価額		
			百株	百株	外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	
(アメリカ)							
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	138	151	75	8,329	エネルギー		
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	8	147	16,321	情報技術		
BAIDU INC - SPON ADR	—	4	98	10,885	情報技術		
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	117.5	168.5	150	16,635	電気通信サービス		
JD.COM INC-ADR	—	10	38	4,238	一般消費財・サービス		
NETEASE INC-ADR	—	1	24	2,756	情報技術		
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	—	8	37	4,103	一般消費財・サービス		
VTB BANK JSC -GDR-REG S	437.44	797.14	120	13,318	金融		
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	27	32.9	212	23,506	エネルギー		
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	132.7	140.5	61	6,758	エネルギー		
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	52.6	67	120	13,332	素材		
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	27.9	120.2	34	3,761	電気通信サービス		
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	17.7	107.6	193	21,328	生活必需品		
MEGAFON-REG S GDR	23.2	61.8	55	6,114	電気通信サービス		
RUSHYDRO PJSC-ADR	116.9	329.1	34	3,757	公益事業		
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	312	345.9	490	54,202	金融		
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	4.9	8.6	128	14,159	エネルギー		
LUKOIL PJSC-SPON ADR	102.4	122.7	841	92,897	エネルギー		
ROSNFT OIL CO PJSC-REGS GDR	210.9	380.4	235	25,994	エネルギー		
GAZPROM PAO -SPON ADR	1,676.8	2,194.7	973	107,486	エネルギー		
SEVERSTAL - GDR REG S	22	39.3	57	6,297	素材		
TATNEFT-PREF 3 SERIES	—	20	14	1,595	エネルギー		
ROSSETI PJSC	16,037.2	—	—	—	公益事業		
INTER RAO UES PJSC	3,640.2	—	—	—	公益事業		
ALROSA PJSC	149.9	315.9	52	5,781	素材		
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	—	175.09	29	3,232	金融		
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	177	177	23	2,585	エネルギー		
TRANSNEFT PJSC	0.13	—	—	—	エネルギー		
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	23,424.37 21銘柄	5,786.33 25銘柄	4,250 <8.9%>	469,382		
(香港)							
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	315	665	520	7,331	資本財・サービス		
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	660	—	—	—	その他		
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	530	1,030	594	8,367	資本財・サービス		
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	120	200	316	4,449	資本財・サービス		
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	95	125	338	4,769	情報技術		
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	150	150	288	4,055	一般消費財・サービス		
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	220	280	994	13,995	生活必需品		
JIANGXI COPPER CO LTD-H	180	320	305	4,298	素材		
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	80	—	—	—	資本財・サービス		
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,818	8,478	5,790	81,529	エネルギー		
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	60	90	337	4,752	公益事業		
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	360	560	451	6,355	一般消費財・サービス		
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,920	3,650	295	4,162	一般消費財・サービス		
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	380	—	—	—	電気通信サービス		
FOSUN INTERNATIONAL LTD	210	280	394	5,558	資本財・サービス		
TENCENT HOLDINGS LTD	44	48	1,838	25,884	情報技術		
CHINA TELECOM CORP LTD-H	2,440	4,460	1,618	22,795	電気通信サービス		
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	340	920	322	4,546	一般消費財・サービス		
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	1,100	1,260	1,195	16,836	電気通信サービス		

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港ドル	千円	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	155	270	510	7,185	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	—	660	244	3,447	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	260	600	846	11,911	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	3,280	4,920	2,843	40,040	エネルギー
CNOOC LTD	2,970	3,750	4,830	68,006	エネルギー
HUANENG POWER INTL INC-H	740	1,620	878	12,362	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110	105	437	6,157	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	310	690	413	5,819	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	12,410	18,680	13,169	185,425	金融
CHINA MOBILE LTD	545	1,065	7,311	102,942	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	174	158	371	5,227	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,090	1,960	932	13,136	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	86	—	—	—	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	168	200	2,819	金融
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	—	1,760	371	5,228	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	40	60	443	6,243	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	580	1,040	510	7,189	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	540	680	1,184	16,678	エネルギー
SINOPHARM GROUP CO-H	100	216	654	9,215	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	260	340	853	12,015	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	110	110	267	3,771	一般消費財・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	260	200	198	2,796	エネルギー
BYD CO LTD-H	—	40	191	2,689	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,760	5,740	2,049	28,852	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	50	81	250	3,529	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,020	1,950	676	9,527	金融
CITIC LTD	410	640	696	9,804	資本財・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	940	2,240	508	7,159	金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	10,630	14,000	8,064	113,541	金融
LEGEND HOLDINGS CORP-H	—	148	338	4,761	情報技術
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	—	320	334	4,712	ヘルスケア
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	—	47.12	47	667	資本財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	140	280	355	4,998	公益事業
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	320	520	1,297	18,267	不動産
CRRC CORP LTD - H	210	—	—	—	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	480	1,030	758	10,673	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	—	1,400	287	4,040	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	340	335	2,339	32,946	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	200	100	254	3,583	不動産
YUEXIU PROPERTY CO LTD	—	1,980	279	3,930	不動産
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	774	1,510.8	826	11,635	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	710	410	521	7,343	不動産
CHINA VANKE CO LTD-H	108	113	283	3,993	不動産
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	560	1,200	981	13,820	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	205	465	260	3,672	一般消費財・サービス
WEICAI POWER CO LTD-H	340	—	—	—	資本財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL	630	1,930	337	4,755	公益事業
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	—	350	273	3,853	資本財・サービス
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD-H	520	1,000	325	4,576	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	202	266	771	10,861	金融
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	420	700	1,367	19,258	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	50	60	455	6,416	公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD	380	620	416	5,866	エネルギー
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	232	236	347	4,891	不動産

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	220	—	—	—	エネルギー
LENOVO GROUP LTD	1,680	3,540	1,462	20,585	情報技術
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	780	1,400	999	14,074	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,231	2,121	1,164	16,395	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	730	270	560	7,888	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	—	700	300	4,228	不動産
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	—	320	384	5,415	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	320	590	263	3,705	金融
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,040	3,100	210	2,968	情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H	415	480	1,296	18,247	金融
BANK OF CHINA LTD-H	10,860	18,050	6,967	98,099	金融
SOHO CHINA LTD	—	620	221	3,125	不動産
CITIC SECURITIES CO LTD-H	155	220	330	4,652	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	450	720	234	3,294	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	180	412	319	4,495	金融
LONGFOR PROPERTIES	170	165	331	4,669	不動産
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	80,904 133,987.92	94,018	1,323,786	
		76銘柄	82銘柄	<25.0%>	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	—	325	28	2,325	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	—	325	28	
		—	1銘柄	<0.0%>	
(台湾)		百株	百株	千台湾ドル	千円
TAIWAN CEMENT	200	660	2,772	10,034	素材
ASIA CEMENT CORP	—	380	1,316	4,766	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	—	539.64	3,777	13,674	情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	421.12	461.12	3,555	12,869	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	286	446	5,084	18,405	素材
NAN YA PLASTICS CORP	351.4	471.4	4,148	15,016	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	283.9	413.9	5,256	19,028	素材
WALSIN LIHWA CORP	—	720	1,443	5,225	資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	806.86	1,066.86	2,507	9,075	素材
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	172.55	292.55	1,332	4,823	一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	196.16	486.16	1,774	6,423	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	130	280	2,842	10,288	情報技術
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	659.29	—	—	—	その他
ACER INC	—	750	1,762	6,380	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	91.41	191.41	1,401	5,072	情報技術
INVENTEC CORP	330	650	1,556	5,635	情報技術
TATUNG CO LTD	470	470	1,323	4,789	一般消費財・サービス
QUANTA COMPUTER INC	260	480	2,491	9,018	情報技術
AU OPTRONICS CORP	2,370	3,530	4,518	16,356	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	354	504	5,619	20,342	電気通信サービス
MEDIATEK INC	160.03	210.03	6,258	22,657	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	60	80	2,736	9,904	情報技術
HTC CORP	222.57	182.57	923	3,344	情報技術
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	356.17	388.22	1,230	4,454	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	714.11	1,064.11	5,320	19,260	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	756.93	1,136.93	5,900	21,360	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	—	2,170	2,473	8,955	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	531.81	851.2	1,779	6,440	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	718.28	1,488.28	1,949	7,057	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	749.93	1,049.93	2,782	10,071	金融

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千台湾ドル	千円		
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	605.76	991.78	1,418	5,134	金融	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	850.41	1,830.41	2,031	7,354	金融	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	—	1,040	1,138	4,122	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,480.28	2,580.28	5,625	20,362	金融	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	718.22	952.58	1,933	7,000	金融	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	50	100	1,385	5,013	情報技術	
TAIWAN MOBILE CO LTD	110	190	2,109	7,634	電気通信サービス	
WISTRON CORP	588.14	1,079.4	2,396	8,674	情報技術	
INNOLUX CORP	2,620	3,780	4,120	14,915	情報技術	
TPK HOLDING CO LTD	80	160	1,003	3,631	情報技術	
WPG HOLDINGS LTD	150	—	—	—	情報技術	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	120	210	1,656	5,997	電気通信サービス	
PEGATRON CORP	340	660	4,184	15,147	情報技術	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	—	110	1,058	3,830	金融	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	—	600	1,059	3,833	金融	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	80	—	—	—	情報技術	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	74	114	962	3,483	情報技術	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	70	140	1,617	5,853	エネルギー	
POU CHEN	144.4	274.4	972	3,521	一般消費財・サービス	
SILICONWARE PRECISION INDS	120	—	—	—	その他	
COMPAL ELECTRONICS	374.53	614.53	1,173	4,248	情報技術	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,100	1,600	34,560	125,107	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,441.28	3,101.28	25,306	91,609	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	40	50	1,722	6,235	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	47.6	87.6	2,281	8,260	情報技術	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	—	630	1,940	7,024	資本財・サービス	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,150	2,920	5,241	18,973	情報技術	
台湾ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	24,007.14 48銘柄	45,230.57 53銘柄	192,736 <13.2% >	697,706	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円		
TURKIYE GARANTI BANKASI	291.4	368	311	7,350	金融	
AKBANK T. A. S.	270.9	408.5	306	7,233	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	271.7	411.2	236	5,572	金融	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	98.5	194.3	241	5,697	電気通信サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	25.2	28.7	309	7,318	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	178.31	197.41	206	4,884	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	146.2	294.4	259	6,123	金融	
TURKIYE HALK BANKASI	153.6	294.9	219	5,173	金融	
YAPI VE KREDI BANKASI	173.7	—	—	—	金融	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	193.2	271.7	134	3,168	金融	
KOC HOLDING AS	112.55	203.15	286	6,758	資本財・サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	157.6	108.7	151	3,569	資本財・サービス	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	110	—	—	—	電気通信サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15.5	22.7	156	3,703	生活必需品	
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,198.36 14銘柄	2,803.66 12銘柄	2,818 <1.3% >	66,554	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	4,864	5,166	8,327	47,300	電気通信サービス	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	151	274	2,084	11,837	一般消費財・サービス	
CEMEX SAB-CPO	1,798.19	3,502.19	4,573	25,979	素材	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	155	220	3,823	21,718	生活必需品	
GRUPO FIN SANTANDER-B	225	—	—	—	その他	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	42	73	824	4,684	生活必需品	

銘柄	期首		当期		期末		業種等	
	株数	株数	評価額					
			外貨建金額	邦貨換算金額				
	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円				
MEXICHEM SAB DE CV-*	110.23	138.23	792	4,499	素材			
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	103	157	595	3,381	生活必需品			
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7.9	14.75	511	2,903	素材			
ALFA S. A. B. -A	424	625	1,418	8,054	資本財・サービス			
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	302	507	2,786	15,830	素材			
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	157	—	—	—	金融			
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	398	639	3,306	18,779	生活必需品			
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	179	237	2,762	15,689	金融			
メキシコ・ペソ通貨計	株数 銘柄数	金額 銘柄数	8,916.32 14銘柄	11,553.17 12銘柄	31,805	180,657	<3.4%>	
(チリ)			百株	百株	千チリ・ペソ	千円		
ENEL CHILE SA	1,523.1	2,290.97	14,664	2,482	公益事業			
BANCO DE CREDITO E INVERSION	—	4.7	20,383	3,450	金融			
ENEL GENERACION CHILE SA	266.8	—	—	—	公益事業			
LATAM AIRLINES GROUP SA	28.8	40.9	26,374	4,465	資本財・サービス			
CENCOSUD SA	93.4	278.7	43,031	7,285	生活必需品			
BANCO SANTANDER CHILE	5,410.5	7,526.8	38,921	6,589	金融			
ENEL AMERICAS SA	2,489.2	3,468.2	39,298	6,653	公益事業			
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5	—	—	—	素材			
EMPRESAS CMPC SA	—	138.2	33,270	5,632	素材			
S. A. C. I. FALABELLA	19.1	41.1	24,459	4,140	一般消費財・サービス			
EMPRESAS COPEC SA	—	37	36,985	6,261	エネルギー			
BANCO DE CHILE	1,945.94	2,643.46	26,172	4,431	金融			
チリ・ペソ通貨計	株数 銘柄数	金額 銘柄数	11,781.84 9銘柄	16,470.03 10銘柄	303,561	51,393	<1.0%>	
(インド)			百株	百株	千インド・ルピー	千円		
RAJESH EXPORTS LTD	—	34	1,974	3,199	一般消費財・サービス			
TATA STEEL LTD	37.4	53.2	3,038	4,921	素材			
AXIS BANK LTD	82.4	147	7,566	12,258	金融			
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2	4	3,688	5,975	一般消費財・サービス			
HINDUSTAN UNILEVER LTD	17.6	22.6	3,787	6,136	生活必需品			
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	63.4	163.9	4,135	6,699	エネルギー			
STATE BANK OF INDIA	194.5	353.3	9,095	14,735	金融			
NTPC LTD	197.6	337.9	5,166	8,369	公益事業			
JSW STEEL LTD	100	113.6	3,546	5,744	素材			
INDIAN OIL CORP LTD	132.7	652.8	10,134	16,418	エネルギー			
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	75.7	203.65	7,491	12,135	エネルギー			
IDEA CELLULAR LTD	117.6	304.3	1,678	2,718	電気通信サービス			
YES BANK LTD	—	94.5	3,170	5,136	金融			
TATA MOTORS LTD-A-DVR	44.4	87	1,368	2,217	一般消費財・サービス			
RURAL ELECTRIFICATION CORP	84.2	200.2	2,017	3,267	金融			
COAL INDIA LTD	139.1	223.2	5,900	9,558	エネルギー			
BHARTI INFRA TEL LTD	—	72.4	2,168	3,512	電気通信サービス			
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	17.3	25.3	2,883	4,671	金融			
GAIL INDIA LTD	29.5	64.93	2,261	3,664	公益事業			
HINDALCO INDUSTRIES LTD	146.5	170.1	3,811	6,175	素材			
GRASIM INDUSTRIES LTD	—	26.4	2,548	4,129	素材			
WIPRO LTD	60.4	97.2	2,546	4,124	情報技術			
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	15.88	54.36	10,144	16,433	情報技術			
INFOSYS LTD	87.8	142	19,101	30,944	情報技術			
LARSEN & TOUBRO LTD	11.55	25.52	3,214	5,207	資本財・サービス			
TATA MOTORS LTD	114.3	227.2	6,067	9,829	一般消費財・サービス			
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	283.8	—	—	—	電気通信サービス			

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千インド・ルピー	千円			
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	55.1	75.7	14,553	23,576	金融		
ICICI BANK LTD	173.14	—	—	—	金融		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	153.7	280.4	27,762	44,975	エネルギー		
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	385.75	611.95	9,546	15,465	エネルギー		
ITC LTD	95.4	163.6	4,325	7,007	生活必需品		
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	19.3	53.2	4,788	7,757	一般消費財・サービス		
HERO MOTOCORP LTD	4.7	7.7	2,663	4,314	一般消費財・サービス		
BHARTI AIRTEL LTD	100.2	150.8	5,540	8,975	電気通信サービス		
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	20.5	55.2	3,197	5,180	ヘルスケア		
HCL TECHNOLOGIES LTD	18.2	39.9	3,693	5,983	情報技術		
VEDANTA LTD	80.5	209.5	4,777	7,739	素材		
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,162.12 34銘柄	5,548.51 36銘柄	209,357	339,159		<6.4%>
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円		
UNITED TRACTORS TBK PT	125	151	484,710	3,732	エネルギー		
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,312	1,840	1,150,000	8,855	一般消費財・サービス		
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	313	635	407,987	3,141	生活必需品		
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	3,218	5,292	1,989,792	15,321	電気通信サービス		
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	520	790	568,800	4,379	金融		
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	438	425	902,062	6,945	金融		
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	664	1,739	1,147,740	8,837	金融		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	1,334	2,987	480,907	3,702	公益事業		
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	779	4,675	1,369,775	10,547	金融		
ADARO ENERGY TBK PT	1,327	—	—	—	エネルギー		
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,030 10銘柄	18,534 9銘柄	8,501,774	65,463		<1.2%>
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	—	12	24	680	公益事業		
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	—	121	220	6,231	一般消費財・サービス		
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	826	863	1,592	44,932	エネルギー		
VALE SA-PREF	300	—	—	—	その他		
BANCO BRADESCO SA-PREF	337.4	527.34	1,484	41,891	金融		
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	356.24	503.24	2,112	59,603	金融		
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	100	157	126	3,557	素材		
VALE SA	197	507.9	2,439	68,841	素材		
GERDAU SA-PREF	172	215	313	8,846	素材		
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	716	673	1,393	39,332	エネルギー		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	239.97	646.97	491	13,875	公益事業		
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	192.29	309.41	299	8,452	金融		
BRASKEM SA-PREF A	18	35	173	4,898	素材		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	27	56	100	2,828	公益事業		
BANCO DO BRASIL S. A.	214	372	1,134	32,018	金融		
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	—	26	92	2,609	エネルギー		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	34	79	124	3,524	公益事業		
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	24	59	135	3,829	公益事業		
EMBRAER SA	84	127	342	9,658	資本財・サービス		
METALURGICA GERDAU SA-PREF	417	491	322	9,103	素材		
CCR SA	62	140	140	3,954	資本財・サービス		
BRF SA	67	129	267	7,535	生活必需品		
NATURA COSMETICOS SA	25	—	—	—	生活必需品		
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	37	57	135	3,810	公益事業		
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	37	77	126	3,578	公益事業		
TIM PARTICIPACOES SA	104.26	123.26	162	4,577	電気通信サービス		

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	51	83	375	10,610	電気通信サービス	
CPFL ENERGIA SA	35.87	—	—	—	公益事業	
LOJAS RENNER S. A.	32.5	38.5	114	3,243	一般消費財・サービス	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	—	66	109	3,099	一般消費財・サービス	
JBS SA	170	504	485	13,710	生活必需品	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	—	49	223	6,320	素材	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	24	—	—	—	公益事業	
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	90	—	—	—	生活必需品	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	84	120	253	7,158	金融	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	45.08	113.08	113	3,194	不動産	
CIELO SA	63.28	99.28	158	4,482	情報技術	
FIBRIA CELULOSE SA	27	27	195	5,516	素材	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	36	45	360	10,159	生活必需品	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	10	—	—	—	公益事業	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	—	56	39	1,101	公益事業	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45	74	222	6,277	金融	
KLABIN SA - UNIT	—	66	128	3,639	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	43	70	320	9,047	エネルギー	
LOJAS AMERICANAS SA	—	19	24	695	一般消費財・サービス	
KROTON EDUCACIONAL SA	68	130	135	3,826	一般消費財・サービス	
BANCO BRADESCO S. A.	80.17	139.88	351	9,931	金融	
AMBEV SA	296	367	664	18,745	生活必需品	
GRUPO BTG PACTUAL-UNIT	30	—	—	—	その他	
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額	5,818.06	8,373.86	18,034	508,936	
	銘柄数 < 比率 >	41銘柄	42銘柄		< 9.6% >	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円		
MALAYAN BANKING BHD	374	727	652	17,829	金融	
GENTING BHD	108	204	171	4,679	一般消費財・サービス	
PUBLIC BANK BERHAD	226	272	625	17,070	金融	
SIME DARBY BERHAD	397	699	167	4,581	資本財・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	183	425	178	4,886	電気通信サービス	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	37	—	—	—	生活必需品	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	234	297	250	6,853	素材	
GENTING MALAYSIA BHD	173	302	147	4,016	一般消費財・サービス	
IOI CORP BHD	169	295	131	3,593	生活必需品	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	672	825	450	12,301	金融	
SIME DARBY PLANTATION BHD	—	278	148	4,061	生活必需品	
TENAGA NASIONAL BHD	364	575	828	22,612	公益事業	
PETRONAS GAS BHD	44	—	—	—	公益事業	
DIGI. COM BHD	269	269	111	3,056	電気通信サービス	
SAPURA ENERGY BHD	482	2,511	154	4,217	エネルギー	
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額	3,732	7,679	4,019	109,760	
	銘柄数 < 比率 >	14銘柄	13銘柄		< 2.1% >	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円		
GOLD FIELDS LTD	173.6	208.6	1,017	8,201	素材	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	147.9	—	—	—	一般消費財・サービス	
VODACOM GROUP LTD	55	72.4	912	7,352	電気通信サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	36	38.4	867	6,994	生活必需品	
NEDBANK GROUP LTD	26.7	32.8	867	6,991	金融	
BIDVEST GROUP LTD	21.8	24.2	471	3,803	資本財・サービス	
BID CORP LTD	28.1	31.7	873	7,041	生活必需品	
NETCARE LTD	104.6	188.4	521	4,206	ヘルスケア	
STANDARD BANK GROUP LTD	162.2	166.5	3,297	26,578	金融	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円			
IMPERIAL HOLDINGS LTD	29.4	36.4	755	6,085	一般消費財・サービス		
SASOL LTD	100.7	110	5,511	44,418	素材		
REMGRO LTD	27.6	37.8	794	6,405	金融		
EXXARO RESOURCES LTD	23.9	34.8	447	3,608	エネルギー		
KUMBA IRON ORE LTD	16.5	—	—	—	素材		
PICK N PAY STORES LTD	37.7	—	—	—	生活必需品		
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	37.2	41.6	326	2,632	一般消費財・サービス		
SANLAM LTD	157	161.7	1,159	9,347	金融		
TIGER BRANDS LTD	9.3	12.5	416	3,357	生活必需品		
FIRSTRAND LTD	260.9	288.5	1,909	15,388	金融		
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	70.2	121.8	672	5,418	一般消費財・サービス		
THE FOSCHINI GROUP LTD	16.8	16.8	301	2,429	一般消費財・サービス		
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	69.9	128.4	2,143	17,279	金融		
NASPERS LTD-N SHS	9.6	5.9	2,010	16,206	一般消費財・サービス		
INVESTEC LTD	31	44.4	441	3,555	金融		
MTN GROUP LTD	333.1	282.1	3,117	25,124	電気通信サービス		
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	120	187.8	400	3,224	素材		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	12.2	20.4	542	4,376	ヘルスケア		
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44	72.3	855	6,891	素材		
BARLOWORLD LTD	39.1	39.6	526	4,242	資本財・サービス		
SAPPI LIMITED	68.2	88.4	806	6,501	素材		
TELKOM SA SOC LTD	40.9	86.7	432	3,484	電気通信サービス		
MONDI LTD	8.4	13.2	477	3,845	素材		
MMI HOLDINGS LTD	130.1	166	298	2,406	金融		
SPAR GROUP LIMITED/THE	19.4	27.4	524	4,226	生活必需品		
MR PRICE GROUP LTD	15.9	15.9	362	2,922	一般消費財・サービス		
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	96	159.9	404	3,256	ヘルスケア		
SIBANYE GOLD LTD	147	318.7	257	2,078	素材		
BRAIT SE	36.4	—	—	—	金融		
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,764.3 38銘柄	3,282 34銘柄	34,725	279,887	<5.3%>	
(タイ)		百株	百株	千タイ・パーツ	千円		
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	58	73	1,460	4,861	金融		
SIAM CEMENT PCL-NVDR	21	115	4,738	15,777	素材		
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	49	135	2,713	9,035	金融		
KASIKORNBANK PCL-NVDR	32	97	1,915	6,379	金融		
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	229	318	3,975	13,236	金融		
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	140	211	1,012	3,372	金融		
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	128	165	3,192	10,631	電気通信サービス		
KRUNG THAI BANK - NVDR	773	1,165	1,980	6,595	金融		
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	615	748	1,503	5,006	エネルギー		
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	226	282	3,792	12,630	エネルギー		
IRPC PCL - NVDR	1,788	1,558	927	3,086	エネルギー		
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	231	291	960	3,197	エネルギー		
PTT PCL-NVDR	246	2,790	13,322	44,363	エネルギー		
THAI OIL PCL-NVDR	161	193	1,394	4,643	エネルギー		
CP ALL PCL-NVDR	228	257	1,966	6,546	生活必需品		
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	189	—	—	—	電気通信サービス		
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	516	1,061	2,610	8,691	生活必需品		
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	295	331	2,432	8,101	素材		
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,925 18銘柄	9,790 17銘柄	49,897	166,159	<3.1%>	
(ポーランド)		百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円		
PKO BANK POLSKI SA	90.7	81.8	314	9,228	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			
	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円			
BANK PEKAO SA	20	31.2	355	10,454	金融		
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	91.4	101.2	394	11,595	金融		
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	162	227.9	132	3,896	エネルギー		
PGE SA	140.9	118.7	113	3,333	公益事業		
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	48.7	51.1	445	13,100	エネルギー		
TAURON POLSKA ENERGIA SA	224.8	—	—	—	公益事業		
ENERGA SA	74.3	—	—	—	公益事業		
KGHM POLSKA MIEDZ SA	29.8	29.9	267	7,865	素材		
ポーランド・ズロチ通貨計	株数、金額	882.6	641.8	2,024	59,475		
	銘柄数 < 比率 >	9 銘柄	7 銘柄		<1.1% >		
ファンド合計	株数、金額	183,546.11	270,005.85	—	4,320,647		
	銘柄数 < 比率 >	346 銘柄	353 銘柄		<81.7% >		

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(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□	千□	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)						
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M		75	362	7,428	820,300	
アメリカ・ドル通貨計	□数、金額	75	362	7,428	820,300	
	銘柄数 < 比率 >	1 銘柄	1 銘柄		<15.5% >	
		千□	千□	千メキシコ・ペソ	千円	
(メキシコ)						
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		22.5	38.6	1,077	6,121	
メキシコ・ペソ通貨計	□数、金額	22.5	38.6	1,077	6,121	
	銘柄数 < 比率 >	1 銘柄	1 銘柄		<0.1% >	
		千□	千□	南アフリカ・ランド	千円	
(南アフリカ)						
REDEFINE PROPERTIES LTD		30.72	50.98	535	4,318	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		22.49	29.13	771	6,221	
南アフリカ・ランド通貨計	□数、金額	53.21	80.11	1,307	10,540	
	銘柄数 < 比率 >	2 銘柄	2 銘柄		<0.2% >	
合計	□数、金額	150.71	480.71	—	836,962	
	銘柄数 < 比率 >	4 銘柄	4 銘柄		<15.8% >	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外国 MSCI EMG MKT (アメリカ)	百万円 34	百万円 —

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	4,320,647	81.1%
投資信託証券	836,962	15.7
コール・ローン等、その他	172,279	3.2
投資信託財産総額	5,329,889	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.43円、1香港ドル=14.08円、1シンガポール・ドル=80.85円、1台湾ドル=3.62円、1トルコ・リラ=23.61円、1メキシコ・ペソ=5.68円、100チリ・ペソ=16.93円、1インド・ルピー=1.62円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・レアル=28.22円、1マレーシア・リンギット=27.31円、1南アフリカ・ランド=8.06円、1タイ・バーツ=3.33円、1ポーランド・ズロチ=29.38円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(5,264,525千円)の投資信託財産総額(5,329,889千円)に対する比率は、98.8%です。

■損益の状況

当期 自 2017年7月6日 至 2018年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	129,796,252円
受取配当金	129,371,689
受取利息	361,237
その他収益金	87,862
支払利息	△ 24,536
(B) 有価証券売買損益	△ 99,440,284
売買益	527,077,157
売買損	△ 626,517,441
(C) 先物取引等損益	△ 22,058,834
取引益	2,538,565
取引損	△ 24,597,399
(D) その他費用	△ 13,779,359
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 5,482,225
(F) 前期繰越損益金	991,684,315
(G) 解約差損益金	△ 191,511,556
(H) 追加信託差損益金	961,997,978
(I) 合計 (E + F + G + H)	1,756,688,512
次期繰越損益金 (I)	1,756,688,512

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,340,835,151円
コール・ローン等	117,342,920
株式 (評価額)	4,320,647,774
投資信託証券 (評価額)	836,962,370
未収入金	10,981,000
未取配当金	26,853,258
差入委託証拠金	28,047,829
(B) 負債	50,223,249
未払金	47,160,960
未払解約金	3,050,000
その他未払費用	12,289
(C) 純資産総額 (A - B)	5,290,611,902
元本	3,533,923,390
次期繰越損益金	1,756,688,512
(D) 受益権総口数	3,533,923,390口
1万口当り基準価額 (C / D)	14,971円

*期首における元本額は2,236,184,868円、当期中における追加設定元本額は1,623,534,022円、同解約元本額は325,795,500円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンダラップ 外国株式インデックスエマージングプラス (為替ヘッジなし) 212,644,854円、ダイワファンダラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 198,745,837円、D-I's 新興国株式インデックス75,405,735円、iFree 新興国株式インデックス1,103,194,778円、iFree 8資産バランス687,189,724円、DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド843,845,731円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式349,755,986円、ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド63,140,745円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は14,971円です。

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年11月30日）
（作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30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。

当ファンドは、わが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
1 期末(2017年11月30日)	円 10,010	円 0	% 0.1	522.295	% 0.2	% 99.3	% -	百万円 1,379
2 期末(2018年11月30日)	10,025	0	0.1	523.683	0.3	99.4	-	2,161

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

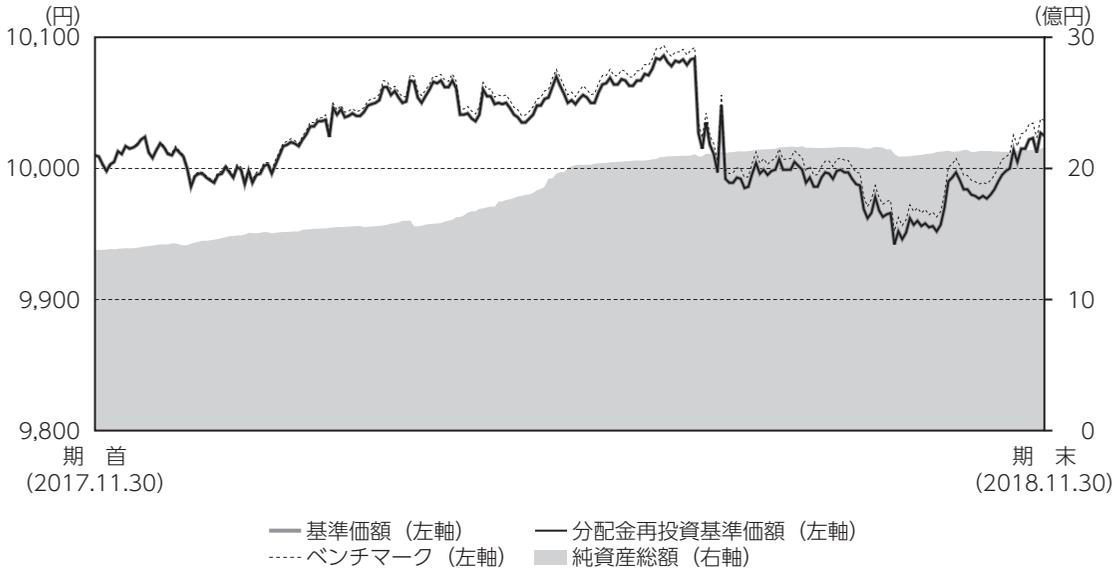
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- *分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- *分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- *ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

■基準価額・騰落率

期首：10,010円

期末：10,025円（分配金0円）

騰落率：0.1%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

金利の上昇（債券価格は下落）はマイナス要因となりましたが、債券からの利息収入がプラス要因となり、基準価額はやや上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数 (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2017年11月30日	10,010	% -	522.295	% -	% 99.3	% -
12月末	10,015	0.0	522.656	0.1	99.4	-
2018年 1 月末	9,998	△0.1	521.766	△0.1	99.4	-
2 月末	10,036	0.3	523.788	0.3	99.4	-
3 月末	10,050	0.4	524.618	0.4	99.3	-
4 月末	10,041	0.3	524.225	0.4	99.6	-
5 月末	10,063	0.5	525.397	0.6	99.1	-
6 月末	10,067	0.6	525.663	0.6	99.1	-
7 月末	10,048	0.4	524.694	0.5	99.3	-
8 月末	9,993	△0.2	521.874	△0.1	98.9	-
9 月末	9,968	△0.4	520.614	△0.3	99.5	-
10月末	9,984	△0.3	521.502	△0.2	99.4	-
(期末) 2018年11月30日	10,025	0.1	523.683	0.3	99.4	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■国内債券市況

国内債券市場では、当作成期を通してみると長期金利は上昇しました。

当作成期首より、日銀の金融緩和策の縮小観測などから、長期金利は上昇しました。2018年2月以降は、政府が日銀の黒田総裁を再任する人事案を提示したことにより、金融緩和の縮小観測が後退したことなどから長期金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移が続きましたが、7月下旬に日銀が金融政策を修正するとの観測報道を受けて、長期金利は上昇しました。7月末に日銀は金融緩和継続のための枠組み強化を決定したものの、その後9月半ば以降は、米国金利の上昇や株高などを受けて長期金利は上昇しました。10月後半以降は、世界的な株安により市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期金利は低下しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

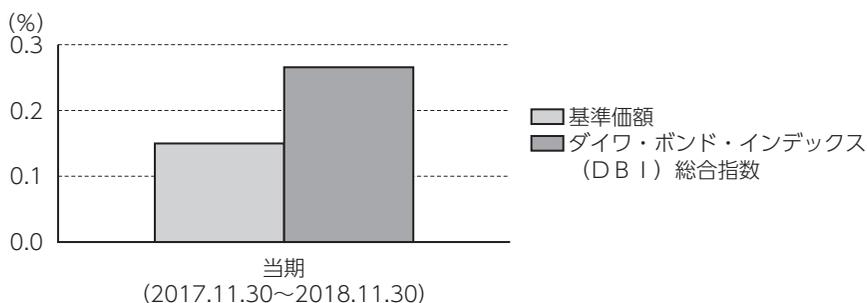
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.1%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は $\Delta 0.1\%$ でした。差異の内訳は、信託報酬要因によるベンチマークとの差異が $\Delta 0.1\%$ 程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が $\Delta 0.0\%$ 程度となっており、信託報酬要因を除くと、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年12月1日 ～2018年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	25

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017.12.1~2018.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	11円	0.108%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,020円です。
(投 信 会 社)	(7)	(0.070)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(3)	(0.027)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(1)	(0.011)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	11	0.113	

(注1) 当作成期中の費用（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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックス マザーファンド	722,393	1,009,556	165,550	230,728

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区 分	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C		
公社債	百万円 25,880	百万円 603	% 2.3	百万円 14,958	百万円 1,265	% 8.5
コール・ローン	83,878	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合2.5%

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

(3) 当作成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

当作成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、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	988,470	1,545,313	2,159,420			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	2,159,420	99.8
コール・ローン等、その他	4,387	0.2
投資信託財産総額	2,163,807	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,163,807,870円
コール・ローン等	4,387,039
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,159,420,831
(B) 負債	2,231,683
未払解約金	1,030,817
未払信託報酬	1,143,725
その他未払費用	57,141
(C) 純資産総額(A - B)	2,161,576,187
元本	2,156,165,819
次期繰越損益金	5,410,368
(D) 受益権総口数	2,156,165,819口
1万口当り基準価額(C/D)	10,025円

*期首における元本額は1,377,639,463円、当作成期間中における追加設定元本額は1,389,815,832円、同解約元本額は611,289,476円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,025円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,048円
受取利息	465
支払利息	△ 3,513
(B) 有価証券売買損益	3,315,453
売買益	4,608,465
売買損	△1,293,012
(C) 信託報酬等	△2,079,494
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,232,911
(E) 前期繰越損益金	1,902,601
(F) 追加信託差損益金	2,274,856
(配当等相当額)	(2,267,764)
(売買損益相当額)	(7,092)
(G) 合計(D + E + F)	5,410,368
次期繰越損益金(G)	5,410,368
追加信託差損益金	2,274,856
(配当等相当額)	(2,267,764)
(売買損益相当額)	(7,092)
分配準備積立金	3,138,560
繰越損益金	△ 3,048

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」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	1,235,401
(c) 収益調整金	2,274,856
(d) 分配準備積立金	1,903,159
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	5,413,416
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	5,413,416
(h) 受益権総口数	2,156,165,819口

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第19期 (決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

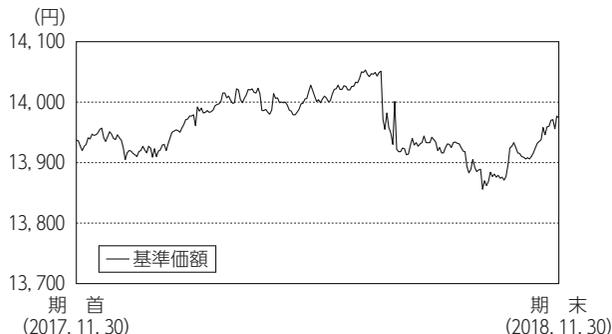
大和投資信託

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/>

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数 (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	%		%	%	%
(期首) 2017年11月30日	13,937	—	522.295	—	99.4	—
12月末	13,946	0.1	522.656	0.1	99.5	—
2018年 1 月末	13,923	△ 0.1	521.766	△ 0.1	99.5	—
2 月末	13,977	0.3	523.788	0.3	99.5	—
3 月末	13,998	0.4	524.618	0.4	99.4	—
4 月末	13,987	0.4	524.225	0.4	99.7	—
5 月末	14,019	0.6	525.397	0.6	99.2	—
6 月末	14,026	0.6	525.663	0.6	99.2	—
7 月末	14,001	0.5	524.694	0.5	99.4	—
8 月末	13,925	△ 0.1	521.874	△ 0.1	99.0	—
9 月末	13,892	△ 0.3	520.614	△ 0.3	99.6	—
10 月末	13,916	△ 0.2	521.502	△ 0.2	99.5	—
(期末) 2018年11月30日	13,974	0.3	523.683	0.3	99.6	—

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。
- (注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。
- (注5) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,937円 期末：13,974円 騰落率：0.3%

【基準価額の主な変動要因】

金利の上昇 (債券価格は下落) はマイナス要因となりましたが、債券からの利息収入がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ 国内債券市場

国内債券市場では、当作成期を通してみると長期金利は上昇しました。

当作成期首より、日銀の金融緩和策の縮小観測などから、長期金利は上昇しました。2018年2月以降は、政府が日銀の黒田総裁を再任する人事案を提示したことにより、金融緩和の縮小観測が後退したことなどから長期金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移が続きましたが、7月下旬に日銀が金融政策を修正することの観測報道を受けて、長期金利は上昇しました。7月末に日銀は金融緩和継続のための枠組み強化を決定したものの、その後9月半ば以降は、米国金利の上昇や株高などを受けて長期金利は上昇しました。10月後半以降は、世界的な株安により市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期金利は低下しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

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

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.3%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 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) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	23,825,721	(13,083,950 —)
	地方債証券	692,825	(761,442 —)
	特殊債券	234,179	(101,392 —)
	社債券	1,127,317	(1,011,646 —)

(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

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,141,819	117 5年国債 0.2% 2019/3/20	732,722
350 10年国債 0.1% 2028/3/20	916,238	120 5年国債 0.2% 2019/9/20	682,434
349 10年国債 0.1% 2027/12/20	854,384	121 5年国債 0.1% 2019/9/20	551,303
351 10年国債 0.1% 2028/6/20	798,948	347 10年国債 0.1% 2027/6/20	503,049
124 5年国債 0.1% 2020/6/20	793,884	116 5年国債 0.2% 2018/12/20	501,870
136 5年国債 0.1% 2023/6/20	705,588	119 5年国債 0.1% 2019/6/20	481,214
383 2年国債 0.1% 2019/12/15	622,752	342 10年国債 0.1% 2026/3/20	463,132
342 10年国債 0.1% 2026/3/20	593,411	380 2年国債 0.1% 2019/9/15	330,795
339 10年国債 0.4% 2025/6/20	516,478	145 20年国債 1.7% 2033/6/20	322,350
134 5年国債 0.1% 2022/12/20	515,168	374 2年国債 0.1% 2019/3/15	320,867

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

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

作成期 区分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちB B 格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	62,354,000	67,198,735	85.6	—	55.9	20.9	8.8
地方債証券	4,100,000	4,305,812	5.5	—	2.5	2.5	0.5
特殊債券(除く金融債券)	3,100,000	3,227,508	4.1	—	1.6	2.0	0.5
金融債券	100,000	98,303	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	3,200,000	3,306,672	4.2	—	2.1	1.3	0.8
合 計	72,854,000	78,137,032	99.6	—	62.2	26.7	10.6

(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、新株予約権付社債券(転換社債券)を除く)

区 分	当 期		年 利 率	末		償還年月日
	銘 柄	額 面 金 額		評 価 額	額 面 金 額	
国債証券		千円	%	千円	千円	
	383 2年国債	450,000	0.1000	451,138	451,138	2019/12/15
	122 5年国債	630,000	0.1000	631,581	631,581	2019/12/20
	305 10年国債	500,000	1.3000	507,490	507,490	2019/12/20
	385 2年国債	500,000	0.1000	501,505	501,505	2020/02/15
	123 5年国債	780,000	0.1000	782,472	782,472	2020/03/20
	306 10年国債	255,000	1.4000	260,087	260,087	2020/03/20
	307 10年国債	400,000	1.3000	407,460	407,460	2020/03/20
	44 20年国債	85,000	2.5000	87,912	87,912	2020/03/20
	45 20年国債	148,000	2.4000	152,879	152,879	2020/03/20
	124 5年国債	1,340,000	0.1000	1,345,078	1,345,078	2020/06/20
	308 10年国債	200,000	1.3000	204,458	204,458	2020/06/20
	309 10年国債	90,000	1.1000	91,728	91,728	2020/06/20
	46 20年国債	73,000	2.2000	75,654	75,654	2020/06/22
	391 2年国債	100,000	0.1000	100,416	100,416	2020/08/01
	125 5年国債	940,000	0.1000	944,145	944,145	2020/09/20
	310 10年国債	130,000	1.0000	132,670	132,670	2020/09/20
	311 10年国債	150,000	0.8000	152,539	152,539	2020/09/20
	47 20年国債	89,000	2.2000	92,757	92,757	2020/09/21
	126 5年国債	890,000	0.1000	894,467	894,467	2020/12/20
	312 10年国債	700,000	1.2000	719,173	719,173	2020/12/20
	48 20年国債	54,000	2.5000	56,929	56,929	2020/12/21
	127 5年国債	980,000	0.1000	985,409	985,409	2021/03/20
	313 10年国債	200,000	1.3000	206,600	206,600	2021/03/20
	314 10年国債	260,000	1.1000	267,384	267,384	2021/03/20
	49 20年国債	64,000	2.1000	67,297	67,297	2021/03/22
	50 20年国債	107,000	1.9000	112,020	112,020	2021/03/22
	128 5年国債	1,000,000	0.1000	1,006,000	1,006,000	2021/06/20
	315 10年国債	221,000	1.2000	228,505	228,505	2021/06/20
	316 10年国債	250,000	1.1000	257,850	257,850	2021/06/20
	51 20年国債	82,000	2.0000	86,464	86,464	2021/06/21

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	
	129 5年国債		0.1000	1,020,000	1,026,579	2021/09/20
	317 10年国債		1.1000	214,000	221,357	2021/09/20
	318 10年国債		1.0000	200,000	206,314	2021/09/20
	52 20年国債		2.1000	52,000	55,250	2021/09/21
	130 5年国債		0.1000	880,000	886,186	2021/12/20
	319 10年国債		1.1000	100,000	103,746	2021/12/20
	320 10年国債		1.0000	230,000	237,912	2021/12/20
	53 20年国債		2.1000	66,000	70,490	2021/12/20
	54 20年国債		2.2000	65,000	69,621	2021/12/20
	131 5年国債		0.1000	920,000	926,992	2022/03/20
	321 10年国債		1.0000	175,000	181,510	2022/03/20
	322 10年国債		0.9000	130,000	134,405	2022/03/20
	55 20年国債		2.0000	140,000	149,844	2022/03/21
	132 5年国債		0.1000	580,000	584,645	2022/06/20
	324 10年国債		0.8000	410,000	423,427	2022/06/20
	133 5年国債		0.1000	550,000	554,719	2022/09/20
	325 10年国債		0.8000	310,000	320,877	2022/09/20
	58 20年国債		1.9000	200,000	215,410	2022/09/20
	134 5年国債		0.1000	510,000	514,666	2022/12/20
	326 10年国債		0.7000	30,000	31,000	2022/12/20
	327 10年国債		0.8000	450,000	466,834	2022/12/20
	59 20年国債		1.7000	45,000	48,330	2022/12/20
	60 20年国債		1.4000	10,000	10,618	2022/12/20
	135 5年国債		0.1000	950,000	959,015	2023/03/20
	328 10年国債		0.6000	350,000	360,874	2023/03/20
	61 20年国債		1.0000	100,000	104,810	2023/03/20
	136 5年国債		0.1000	700,000	706,874	2023/06/20
	329 10年国債		0.8000	500,000	520,900	2023/06/20
	62 20年国債		0.8000	95,000	98,948	2023/06/20
	63 20年国債		1.8000	130,000	141,341	2023/06/20
	137 5年国債		0.1000	80,000	80,790	2023/09/20
	330 10年国債		0.8000	612,000	638,854	2023/09/20
	331 10年国債		0.6000	365,000	377,497	2023/09/20
	64 20年国債		1.9000	90,000	98,700	2023/09/20
	332 10年国債		0.6000	310,000	321,085	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	175,000	192,752	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	135,000	148,009	2023/12/20
	333 10年国債		0.6000	700,000	726,068	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	60,837	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	134,650	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	122,844	2024/03/20
	334 10年国債		0.6000	800,000	830,992	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	94,517	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	140,952	2024/06/20
	335 10年国債		0.5000	780,000	806,816	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	175,000	197,275	2024/09/20
	336 10年国債		0.5000	275,000	284,691	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	300,000	306,924	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	135,123	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	82,644	2024/12/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	338 10年国債		0.4000	490,000	504,714	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	90,972	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	57,350	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	147,009	2025/03/20
	339 10年国債		0.4000	780,000	804,102	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	68,878	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	56,786	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	60,541	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	770,000	794,170	2025/09/20
	81 20年国債		2.0000	76,000	86,655	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	99,791	2025/09/20
	341 10年国債		0.3000	260,000	266,528	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	107,138	2025/12/20
	342 10年国債		0.1000	830,000	839,105	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	67,103	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	93,726	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	64,034	2026/03/20
	343 10年国債		0.1000	830,000	838,789	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	117,664	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	91,188	2026/06/20
	344 10年国債		0.1000	640,000	646,246	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	20,000	23,476	2026/09/20
	91 20年国債		2.3000	60,000	70,898	2026/09/20
	345 10年国債		0.1000	730,000	736,759	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	310,000	362,820	2026/12/20
	346 10年国債		0.1000	800,000	806,968	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	116,634	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	152,703	2027/03/20
	347 10年国債		0.1000	330,000	332,534	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	59,775	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	55,000	64,814	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	600,000	604,212	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	47,657	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	120,000	141,919	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	750,000	754,395	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	150,000	178,012	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	810,000	813,742	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	185,911	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	75,000	91,345	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	100,659	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	600,000	601,704	2028/06/20
	102 20年国債		2.4000	80,000	97,720	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	170,000	206,041	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,930	2028/06/20
	352 10年国債		0.1000	210,000	210,304	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	150,741	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	180,912	2028/09/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	108,010	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	177,000	208,897	2028/12/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	65,085	2029/03/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	110 20年国債		2.1000	130,000	156,488	2029/03/20
	111 20年国債		2.2000	80,000	97,428	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	130,000	156,967	2029/06/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	20,515	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	150,000	181,560	2029/09/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	84,970	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	220,455	2029/12/20
	2 30年国債		2.4000	24,000	29,989	2030/02/20
	116 20年国債		2.2000	140,000	171,966	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	215,000	261,702	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	37,245	2030/05/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	114,814	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	110,288	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	210,000	244,278	2030/06/20
	121 20年国債		1.9000	170,000	204,011	2030/09/20
	122 20年国債		1.8000	160,000	190,161	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	47,523	2030/11/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	245,276	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	193,000	234,415	2030/12/20
	125 20年国債		2.2000	85,000	105,523	2031/03/20
	126 20年国債		2.0000	110,000	133,835	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	165,000	198,773	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	34,807	2031/05/20
	128 20年国債		1.9000	119,000	143,668	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	230,000	274,866	2031/06/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	167,531	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	80,000	94,736	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	30,594	2031/11/20
	132 20年国債		1.7000	150,000	177,928	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	250,000	299,715	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	80,000	96,014	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	109,232	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	185,000	217,271	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	69,727	2032/05/20
	137 20年国債		1.7000	70,000	83,243	2032/06/20
	138 20年国債		1.5000	87,000	101,181	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	235,000	276,383	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	335,000	398,985	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	32,539	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	49,475	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	220,000	262,220	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	200,000	241,084	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	49,933	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	247,583	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	200,000	233,052	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	47,771	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	380,000	453,826	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	75,195	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	230,000	275,036	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	93,087	2033/12/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	147 20年国債		1.6000	250,000	295,722	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	106,788	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	300,000	350,589	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	100,000	131,989	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	252,000	294,507	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	100,000	132,283	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	250,000	288,645	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	80,000	104,757	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	370,000	415,572	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	103,725	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	350,000	393,127	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	73,978	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	380,000	432,736	2035/06/20
	20 30年国債		2.5000	60,000	79,957	2035/09/20
	154 20年国債		1.2000	360,000	404,056	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	78,130	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	275,000	299,420	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	70,000	93,548	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	330,000	326,043	2036/03/20
	23 30年国債		2.5000	60,000	80,327	2036/06/20
	157 20年国債		0.2000	400,000	380,948	2036/06/20
	24 30年国債		2.5000	92,000	123,381	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	100,000	100,081	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	196,317	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	280,000	284,398	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	238,921	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	270,000	278,348	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	320,000	323,779	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	202,242	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	300,000	302,811	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	290,000	292,247	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	229,824	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	400,000	394,788	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	330,000	325,079	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	267,488	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	35,000	35,714	2038/09/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	290,813	2039/03/20
	31 30年国債		2.2000	180,000	235,207	2039/09/20
	32 30年国債		2.3000	235,000	312,493	2040/03/20
	33 30年国債		2.0000	311,000	396,070	2040/09/20
	34 30年国債		2.2000	233,000	306,905	2041/03/20
	35 30年国債		2.0000	295,000	377,443	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	320,000	410,297	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	300,000	378,846	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	220,000	273,365	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	172,000	217,739	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	140,000	174,195	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	207,775	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	176,000	215,205	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	170,000	207,964	2044/06/20

区 分	当		期		末	
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	44	30年国債	1.7000	165,000	201,936	2044/09/20
	45	30年国債	1.5000	200,000	235,506	2044/12/20
	46	30年国債	1.5000	180,000	211,975	2045/03/20
	47	30年国債	1.6000	190,000	228,533	2045/06/20
	48	30年国債	1.4000	250,000	288,510	2045/09/20
	49	30年国債	1.4000	93,000	107,315	2045/12/20
	50	30年国債	0.8000	215,000	216,453	2046/03/20
	51	30年国債	0.3000	240,000	211,718	2046/06/20
	52	30年国債	0.5000	235,000	218,470	2046/09/20
	53	30年国債	0.6000	185,000	176,321	2046/12/20
	54	30年国債	0.8000	218,000	218,503	2047/03/20
	55	30年国債	0.8000	200,000	200,232	2047/06/20
	56	30年国債	0.8000	210,000	210,000	2047/09/20
	57	30年国債	0.8000	250,000	249,705	2047/12/20
	1	40年国債	2.4000	70,000	99,047	2048/03/20
	58	30年国債	0.8000	300,000	299,289	2048/03/20
	59	30年国債	0.7000	200,000	194,060	2048/06/20
	60	30年国債	0.9000	35,000	35,756	2048/09/20
	2	40年国債	2.2000	186,000	254,459	2049/03/20
	3	40年国債	2.2000	74,000	101,710	2050/03/20
	4	40年国債	2.2000	107,000	147,717	2051/03/20
	5	40年国債	2.0000	125,000	165,962	2052/03/20
	6	40年国債	1.9000	105,000	136,632	2053/03/20
	7	40年国債	1.7000	121,000	150,350	2054/03/20
	8	40年国債	1.4000	230,000	264,718	2055/03/20
	9	40年国債	0.4000	220,000	183,893	2056/03/20
	10	40年国債	0.9000	375,000	371,298	2057/03/20
	11	40年国債	0.8000	160,000	152,478	2058/03/20
種別小計	銘 柄 数	258銘柄				
	金 額			62,354,000	67,198,735	
地方債証券	21-5	京都市公債	1.4500	100,000	101,782	2020/02/25
	471	名古屋市債	1.2700	100,000	101,959	2020/06/19
	688	東京都公債	0.9400	100,000	101,686	2020/09/18
	90	共同発行地方	1.1200	100,000	102,028	2020/09/25
	22-1	岡山県公債	1.0500	100,000	102,095	2020/11/30
	22-5	京都府公債	1.2600	100,000	102,588	2020/12/21
	699	東京都公債	1.0200	100,000	102,847	2021/09/17
	23-2	島根県公債	1.0300	100,000	103,057	2021/11/25
	108	共同発行地方	1.0100	100,000	103,337	2022/03/25
	24-1	北海道公債	0.9900	100,000	103,311	2022/04/27
	24-5	札幌市公債	0.8300	100,000	102,912	2022/06/20
	361	大阪府公債	0.9200	100,000	103,200	2022/06/28
	24-6	北海道公債	0.8400	100,000	103,061	2022/08/31
	713	東京都公債	0.7700	100,000	102,910	2022/09/20
	24-5	京都府公債	0.8200	100,000	103,081	2022/09/20
	24-10	神戸市公債	0.7960	100,000	103,060	2022/10/21
	117	共同発行地方	0.7200	100,000	102,890	2022/12/22
	24-3	横浜市公債	0.7290	100,000	102,918	2022/12/22

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,119	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,971	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	103,827	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	206,709	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,306	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,710	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,277	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	205,899	2025/04/16
	751 東京都公債	0.3700	100,000	102,005	2025/12/19
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,836	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,295	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	100,413	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	120,317	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	117,573	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	120,885	2029/06/20
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	118,610	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	115,088	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	115,205	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	106,831	2035/12/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	110,197	2045/12/20
種別小計	銘 柄 数	38銘柄			
	金 額		4,100,000	4,305,812	
特殊債券 (除く金融債券)	14政保地方公共6	0.1990	100,000	100,419	2020/06/18
	61 道路機構	1.2400	100,000	101,889	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	101,969	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	102,168	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	105,595	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	102,898	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	103,058	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	103,259	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	103,310	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	103,225	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	103,125	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	103,297	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	103,256	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	103,630	2023/02/24
	19 政保政策投資C	0.6680	100,000	103,044	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,044	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,434	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	102,879	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	103,756	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,700	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,005	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,351	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	205,126	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	110,078	2027/08/25
	1 地方公共団体15年	1.3340	100,000	110,154	2028/01/28

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	118,832	2029/07/31
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	117,488	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	114,840	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	186,665	2036/07/31
種別小計	銘柄数	29銘柄			
	金額		3,100,000	3,227,508	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	98,303	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄			
	金額		100,000	98,303	
普通社債券	29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,193	2020/03/19
	260 北陸電力	2.3300	100,000	103,386	2020/05/25
	9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,282	2020/07/24
	20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	104,214	2020/07/27
	15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	103,016	2020/08/21
	17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	103,327	2020/09/16
	72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	102,548	2020/12/22
	44 野村ホールディング	0.7230	100,000	101,318	2021/02/25
	2 イオンFS	0.5720	100,000	100,459	2021/03/18
	9三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	103,810	2021/04/28
	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,552	2022/06/20
	11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	104,310	2022/06/27
	372 中国電力	1.2040	100,000	104,149	2022/08/25
	4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	104,148	2022/12/14
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	102,720	2022/12/14
	175 オリックス	1.0640	100,000	104,250	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,403	2023/12/20
	1 三菱UFJFG劣後	0.9400	100,000	103,423	2024/06/26
	5 野村不動産HD	0.9240	100,000	103,776	2025/05/30
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	103,016	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	103,693	2025/12/18
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,504	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	101,133	2026/09/18
	509 関西電力	0.4700	100,000	100,585	2027/05/25
	12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	100,394	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	99,917	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,974	2027/07/23
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,817	2028/01/25
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	118,447	2029/01/29
	18 エヌティティ都市開	1.0900	100,000	106,649	2029/09/20
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	107,302	2029/12/12
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	110,940	2045/01/27
種別小計	銘柄数	32銘柄			
	金額		3,200,000	3,306,672	
合 計	銘柄数	358銘柄			
	金額		72,854,000	78,137,032	

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	78,137,032	99.2
コール・ローン等、その他	629,637	0.8
投資信託財産総額	78,766,669	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	78,766,669,145円
コール・ローン等	228,171,491
公社債 (評価額)	78,137,032,000
未収入金	202,835,000
未収利息	193,828,008
前払費用	4,802,646
(B) 負債	276,776,680
未払解約金	276,774,272
その他未払費用	2,408
(C) 純資産総額 (A - B)	78,489,892,465
元本	56,170,487,793
次期繰越損益金	22,319,404,672
(D) 受益権総口数	56,170,487,793口
1万口当り基準価額 (C/D)	13,974円

* 期首における元本額は48,889,824,254円、当作成期間中における追加設定元本額は15,940,542,707円、同解約元本額は8,659,879,168円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ国内重視バランスファンド30VA (一般投資家私募) 129,097,081円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募) 795,274,382円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募) 105,597,525円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募) 1,111,264,823円、DCダイワ日本債券インデックス5,920,239,246円、ダイワ・バランスファンド35VA13,051,578,465円、ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 2,124,813,517円、ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 293,362,664円、ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用) 405,138,528円、ダイワ・ノーロード日本債券ファンド62,288,888円、ダイワファンドラップ 日本債券インデックス19,210,529,646円、ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用) 2,623,576,618円、ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス1,545,313,319円、ダイワ・インデックスセレクト 日本債券1,266,064,865円、ダイワ投信倶楽部 日本債券インデックス6,443,095,280円、ダイワライフスタイル25 452,397,864円、ダイワライフスタイル50 492,380,016円、ダイワライフスタイル75 138,475,066円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,974円です。

■損益の状況

当期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	667,283,574円
受取利息	667,528,566
支払利息	△ 244,992
(B) 有価証券売買損益	△ 497,026,750
売買益	58,461,020
売買損	△ 555,487,770
(C) その他費用	△ 37,123
(D) 当期損益金 (A + B + C)	170,219,701
(E) 前期繰越損益金	19,249,367,735
(F) 解約差損益金	△ 3,424,219,960
(G) 追加信託差損益金	6,324,037,196
(H) 合計 (D + E + F + G)	22,319,404,672
次期繰越損益金 (H)	22,319,404,672

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

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

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書 (全体版) 第2期

(決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日~2018年11月30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。

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果をF T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行ないました。ここに、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/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をF T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	外国の公社債
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の10%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2017年11月30日)	円 10,078	円 0	% 0.8	10,111	% 1.1	% 95.4	% 1.5	百万円 2,166
2 期末(2018年11月30日)	9,860	0	△2.2	9,927	△1.8	97.0	0.7	3,598

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

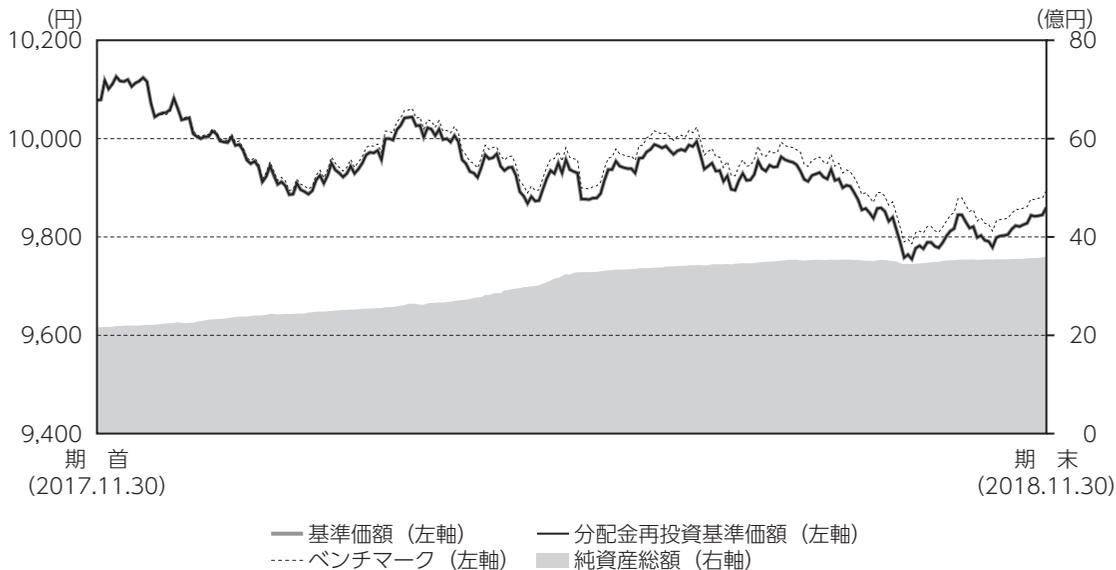
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- * ベンチマークは F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,078円

期末：9,860円（分配金0円）

騰落率：△2.2%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

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

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2017年11月30日	10,078	% -	10,111	% -	% 95.4	% 1.5
12月末	10,061	△0.2	10,094	△0.2	92.1	6.7
2018年 1 月末	9,949	△1.3	9,988	△1.2	91.1	3.9
2 月末	9,909	△1.7	9,953	△1.6	91.4	1.6
3 月末	10,042	△0.4	10,091	△0.2	97.0	-
4 月末	9,942	△1.3	9,994	△1.2	95.7	2.9
5 月末	9,930	△1.5	9,987	△1.2	93.4	1.6
6 月末	9,961	△1.2	10,019	△0.9	93.7	4.0
7 月末	9,913	△1.6	9,974	△1.4	95.2	1.0
8 月末	9,925	△1.5	9,988	△1.2	94.9	0.3
9 月末	9,859	△2.2	9,923	△1.9	97.7	1.4
10月末	9,831	△2.5	9,897	△2.1	93.8	1.2
(期末) 2018年11月30日	9,860	△2.2	9,927	△1.8	97.0	0.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通じて多くの国で上昇しました。

当作成期首より、米国の税制改革法が成立したことを背景に市場のリスク選好度が強まったことや、日本およびユーロ圏などの主要先進国において金融政策の正常化観測が高まったことなどから、主要国の国債金利は上昇しました。2018年2月半ば以降は、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことを受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期年限を中心に金利は低下傾向となりました。4月に入ると、米国と中国の貿易摩擦への懸念が後退し、市場のリスク選好度が強まったことなどから、金利は上昇傾向となりました。5月後半以降は、イタリアの政治情勢や米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、金利は低下傾向となりました。その後レンジ内での推移が続きましたが、9月以降はリスク資産の価格が堅調に推移したことなどから、金利は上昇基調となりました。10月以降は株価が下落し市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、金利は低下しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

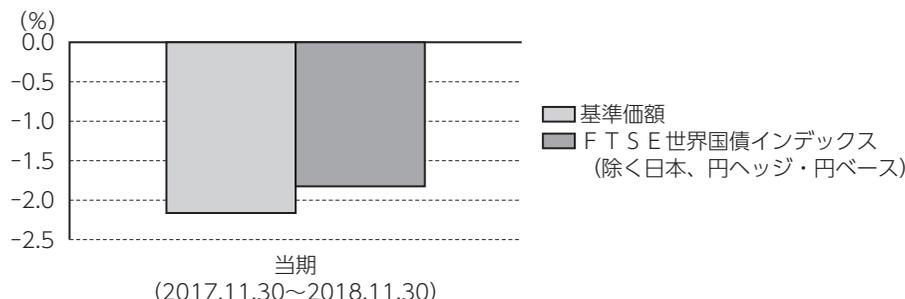
外貨建て資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.2%となりました。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。

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



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳 (1万口当り)

項 目	当 期	
	2017年12月1日 ～2018年11月30日	
当期分配金 (税込み) (円)	—	
対基準価額比率 (%)	—	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	32	

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2017.12.1~2018.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	26円	0.259%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,934円です。
(投 信 会 社)	(18)	(0.184)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	2	0.022	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.013)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	28	0.283	

(注1) 当作成期中の費用(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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	1,704,413	1,631,000	155,248	147,999

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	金 額	評 価 額	口 数	金 額	評 価 額
	千口	千円	千円	千口	千円	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	2,234,684	2,234,684	3,594,657	3,783,849	3,783,849	3,594,657

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	3,594,657	99.7
コール・ローン等、その他	10,081	0.3
投資信託財産総額	3,604,738	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1シンガポール・ドル=82.89円、1イギリス・ポンド=145.01円、1デンマーク・クローネ=17.31円、1ノルウェー・クローネ=13.28円、1スウェーデン・クローネ=12.51円、1メキシコ・ペソ=5.61円、1マレーシア・リンギット=27.11円、1南アフリカ・ランド=8.30円、1ポーランド・ズロチ=30.14円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) 外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (80,298,604千円) の投資信託財産総額 (82,294,261千円) に対する比率は、97.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,604,738,326円
コール・ローン等	10,081,320
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド(評価額)	3,594,657,006
(B) 負債	6,569,102
未払解約金	1,928,754
未払信託報酬	4,499,709
その他未払費用	140,639
(C) 純資産総額(A-B)	3,598,169,224
元本	3,649,169,243
次期繰越損益金	△ 51,000,019
(D) 受益権総口数	3,649,169,243口
1万口当り基準価額(C/D)	9,860円

* 期首における元本額は2,149,445,185円、当作成期間中における追加設定元本額は2,190,846,317円、同解約元本額は691,122,259円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,860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51,000,019円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,498円
受取利息	511
支払利息	△ 6,009
(B) 有価証券売買損益	△44,645,275
売買益	7,046,165
売買損	△51,691,440
(C) 信託報酬等	△ 8,000,015
(D) 当期損益金(A + B + C)	△52,650,788
(E) 前期繰越損益金	5,570,452
(F) 追加信託差損益金	△ 3,919,683
(配当等相当額)	(6,330,968)
(売買損益相当額)	(△10,250,651)
(G) 合計(D + E + F)	△51,000,019
次期繰越損益金(G)	△51,000,019
追加信託差損益金	△ 3,919,683
(配当等相当額)	(6,330,968)
(売買損益相当額)	(△10,250,651)
分配準備積立金	5,571,385
繰越損益金	△52,651,721

- (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下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	6,330,968
(d) 分配準備積立金	5,571,385
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	11,902,353
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	11,902,353
(h) 受益権総口数	3,649,169,243口

《お知らせ》

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

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の決算日（2018年6月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年11月30日）現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの組入資産の内容等を178～188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（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

（2017年12月1日から2018年11月30日まで）

買			付			売			付		
銘	柄	金額	銘	柄	金額	銘	柄	金額	銘	柄	金額
		千円			千円			千円			千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.625% 2020/11/15	2,192,511	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.5% 2018/12/31	1,514,536	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2019/5/15	929,576	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.5% 2019/10/31	655,338
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.5% 2019/10/31	1,641,051	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2019/5/15	929,576	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.25% 2018/10/31	534,168	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2025/8/15	981,702
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.125% 2021/6/30	984,803	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.25% 2018/10/31	534,168	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2021/11/15	969,728	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2023/5/15	911,983
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2025/8/15	981,702	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア)	4.25% 2019/9/1	460,082	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/2/28	870,544	SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	1.4% 2020/1/31	233,742
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2021/11/15	969,728	SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	1.4% 2020/1/31	233,742	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/9/30	828,221	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	0.5% 2019/11/25	219,651
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2023/5/15	911,983	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	0.5% 2019/11/25	219,651	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2023/11/15	782,564	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	1% 2019/5/25	191,380
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/2/28	870,544	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	1% 2019/5/25	191,380	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.875% 2043/5/15	727,890	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ)	0.25% 2019/10/11	186,531
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/9/30	828,221	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ)	0.25% 2019/10/11	186,531				GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ)	3.5% 2019/7/4	179,388
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2023/11/15	782,564	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ)	3.5% 2019/7/4	179,388						
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.875% 2043/5/15	727,890									

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年11月30日現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（85,791,284千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2018年11月30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 328,038	千アメリカ・ドル 323,460	千円 36,703,023	% 45.0	% -	% 18.5	% 15.4	% 11.2
カナダ	千カナダ・ドル 18,204	千カナダ・ドル 19,168	1,637,341	2.0	-	0.9	0.5	0.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 19,297	千オーストラリア・ドル 20,475	1,701,145	2.1	-	1.2	0.7	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 3,642	千シンガポール・ドル 3,720	308,420	0.4	-	0.2	0.2	-
イギリス	千イギリス・ポンド 29,172	千イギリス・ポンド 35,600	5,162,463	6.3	-	4.7	1.3	0.4
デンマーク	千デンマーク・クローネ 22,610	千デンマーク・クローネ 27,324	472,991	0.6	-	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 13,650	千ノルウェー・クローネ 13,986	185,734	0.2	-	0.2	0.1	-
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 18,650	千スウェーデン・クローネ 20,947	262,048	0.3	-	0.2	0.2	-

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		2018年11月30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	千 円		邦 貨 換 算 金 額	5 年 以 上			2 年 以 上	2 年 未 満	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 99,030	千メキシコ・ペソ 91,089	千円 511,013	% 0.6	% -	% 0.4	% 0.1	% 0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 10,330	千マレーシア・リンギット 10,212	276,859	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 54,930	千南アフリカ・ランド 51,043	423,658	0.5	-	0.5	0.0	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 15,055	千ポーランド・ズロチ 15,406	464,350	0.6	-	0.2	0.4	0.0	
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 4,438	千ユーロ 5,045	651,881	0.8	-	0.5	0.1	0.2	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 11,012	千ユーロ 12,795	1,653,105	2.0	-	1.4	0.5	0.2	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 13,800	千ユーロ 15,317	1,978,923	2.4	-	1.8	0.6	0.1	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 54,030	千ユーロ 63,060	8,146,770	10.0	-	6.3	2.5	1.2	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 37,570	千ユーロ 43,483	5,617,571	6.9	-	3.8	2.0	1.1	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 29,962	千ユーロ 34,605	4,470,721	5.5	-	3.6	1.4	0.4	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 50,059	千ユーロ 53,660	6,932,374	8.5	-	5.0	3.0	0.5	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 3,280	千ユーロ 3,541	457,480	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 7,180	千ユーロ 8,608	1,112,096	1.4	-	0.9	0.4	0.1	
ユーロ (小計)	211,331	240,118	31,020,925	38.1	-	23.6	10.6	3.8	
合 計	-	-	79,129,977	97.1	-	51.0	29.6	16.4	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものである。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分		銘		種 類		年 利 率		額 面 金 額		評 価 額		償 還 年 月 日
								千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	32,370	32,250	3,659,507	2020/11/15					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	10,040	10,213	1,158,947	2021/02/15					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	18,946	18,504	2,099,733	2021/11/15					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,700	7,345	833,545	2022/11/15					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	7,950	7,813	886,615	2019/12/31					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	11,020	10,505	1,192,018	2023/05/15					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,540	7,431	843,226	2020/06/30					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	6,310	6,208	704,468	2023/08/15					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	12,905	12,836	1,456,540	2023/11/15					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,000	4,966	563,577	2024/02/15					

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2018年11月30日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	10,580	10,370	1,176,778	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	13,990	13,749	1,560,157	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	5,250	6,521	739,940	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,205	136,783	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	2,700	3,209	364,147	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,800	4,960	562,896	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,130	1,392	158,061	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,250	1,475	167,400	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,330	3,469	393,706	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	410	480	54,492	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,350	1,632	185,281	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	670	825	93,718	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,970	2,884	327,263	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	9,600	8,880	1,007,689	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,156	131,173	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	2,715	308,178	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,500	1,576	178,939	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	2,600	2,624	297,786	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,190	3,081	349,694	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	17,440	17,249	1,957,346	2019/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	11,810	11,382	1,291,596	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	15,450	14,927	1,693,803	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,570	1,480	168,014	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	12,320	11,613	1,317,777	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	16,720	16,048	1,821,026	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	6,900	6,595	748,376	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,827	207,348	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,165	1,060	120,346	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,070	1,760	199,723	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,500	2,247	255,063	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,350	2,185	248,007	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,480	2,275	258,167	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	10,500	10,329	1,172,109	2019/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,120	4,841	549,373	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,500	5,418	614,842	2020/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,350	3,194	362,452	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	2,113	239,828	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,500	1,412	160,244	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,069	348,322	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,310	5,633	639,248	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	5,300	5,094	578,087	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,406	159,645	2048/08/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	52銘柄		328,038	323,460	36,703,023		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	460	507	43,332	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,194	102,004	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	450	636	54,364	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	848	1,174	100,363	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	170	216	18,458	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	5,820	5,935	507,052	2020/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	406	34,753	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,040	1,260	107,695	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,238	1,199	102,451	2023/06/01	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2018年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	230	232	19,895	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	300	321	27,435	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	592	591	50,515	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	320	302	25,867	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	1,959	1,882	160,843	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	930	837	71,533	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,240	1,173	100,202	2022/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	300	294	25,126	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,000	1,000	85,445	2024/03/01
通貨小計	銘 柄 数 金 額	18銘柄			18,204	19,168	1,637,341	
オーストラリア					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	1,770	1,926	160,081	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	800	826	68,696	2020/04/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	1,080	1,216	101,039	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	1,383	1,572	130,648	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	1,089	1,270	105,588	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	656	670	55,688	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	920	973	80,894	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	1,200	1,259	104,676	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	859	1,035	86,034	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	998	1,117	92,846	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	725	807	67,124	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	400	398	33,070	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	684	709	58,908	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,300	1,318	109,536	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	2,158	2,094	174,026	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	475	463	38,535	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	500	506	42,067	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	2,300	2,307	191,680	2022/11/21
通貨小計	銘 柄 数 金 額	18銘柄			19,297	20,475	1,701,145	
シンガポール					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.5000	203	221	18,357	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.1250	1,000	1,038	86,056	2022/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.0000	150	156	12,980	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	300	311	25,819	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.2500	390	392	32,517	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	89	89	7,399	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	200	205	17,039	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.3750	120	130	10,857	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.3750	400	403	33,454	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	330	328	27,236	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.1250	200	198	16,412	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.2500	260	244	20,289	2036/08/01
通貨小計	銘 柄 数 金 額	12銘柄			3,642	3,720	308,420	
イギリス					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
	United Kingdom Gilt		国債証券	2.0000	750	796	115,554	2025/09/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.5000	1,300	1,321	191,568	2021/01/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	2.5000	910	1,076	156,120	2065/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.5000	525	539	78,227	2026/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.5000	250	247	35,847	2022/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.7500	420	411	59,606	2037/09/07

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2018年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	1,350	1,283	186,190	2057/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.2500	1,850	1,852	268,641	2027/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	6.0000	863	1,244	180,482	2028/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	700	925	134,232	2032/06/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	5.0000	675	838	121,524	2025/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	1,565	2,131	309,025	2036/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.7500	200	295	42,888	2038/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.7500	1,090	1,145	166,042	2020/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	450	723	104,870	2055/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	620	916	132,872	2046/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.5000	411	609	88,391	2042/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.7500	907	1,235	179,208	2030/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	2,093	3,183	461,662	2049/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	1,430	2,000	290,102	2039/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.0000	1,040	1,147	166,410	2022/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.0000	787	1,252	181,649	2060/01/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.7500	810	852	123,662	2020/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.7500	742	802	116,385	2021/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	1,380	1,426	206,885	2022/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.2500	1,425	1,772	257,059	2044/01/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.2500	2,290	2,433	352,827	2023/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.5000	748	1,127	163,559	2068/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.7500	300	329	47,798	2024/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.5000	1,290	1,676	243,163	2045/01/22
通貨小計	銘 柄 数 金 額	30銘柄			29,172	35,600	5,162,463	
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	4.5000	5,140	8,841	153,042	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	2,760	2,883	49,914	2019/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	2,310	2,551	44,161	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	2,670	2,898	50,180	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	2,330	2,608	45,158	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	5,200	5,303	91,799	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	2,200	2,237	38,733	2020/11/15
通貨小計	銘 柄 数 金 額	7銘柄			22,610	27,324	472,991	
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	3.7500	2,620	2,784	36,974	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	1,150	1,178	15,653	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	1,300	1,397	18,563	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	150	151	2,008	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,430	1,412	18,763	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	3,000	2,999	39,833	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	4,000	4,061	53,936	2028/04/26
通貨小計	銘 柄 数 金 額	7銘柄			13,650	13,986	185,734	
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	2,780	3,084	38,591	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	1,920	2,719	34,017	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	2,950	3,336	41,744	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	4,150	4,468	55,901	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	2,020	2,324	29,077	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	2,280	2,401	30,047	2026/11/12

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2018年11月30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	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.7500	% 千スウェーデン・クローネ 2,550	千スウェーデン・クローネ 2,611	千円 32,667	2028/05/12
通貨小計	銘 柄 数 額	7銘柄			18,650	20,947	262,048	
メキシコ	Mexican Bonos		国 債 証 券	5.0000	千メキシコ・ペソ 5,400	千メキシコ・ペソ 5,216	29,267	2019/12/11
	Mexican Bonos		国 債 証 券	5.7500	4,200	3,465	19,440	2026/03/05
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	11,450	9,564	53,656	2047/11/07
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	6,740	6,494	36,432	2023/12/07
	Mexican Bonos		国 債 証 券	10.0000	6,340	6,635	37,224	2024/12/05
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.5000	4,800	4,343	24,368	2027/06/03
	Mexican Bonos		国 債 証 券	10.0000	2,750	2,832	15,892	2036/11/20
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.5000	6,500	6,172	34,627	2029/05/31
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.5000	5,000	4,480	25,136	2038/11/18
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	5,500	5,469	30,682	2020/06/11
	Mexican Bonos		国 債 証 券	6.5000	13,700	13,063	73,288	2021/06/10
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	2,700	2,370	13,300	2031/05/29
	Mexican Bonos		国 債 証 券	6.5000	8,900	8,287	46,492	2022/06/09
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	4,750	3,899	21,878	2042/11/13
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	10,300	8,792	49,325	2034/11/23
通貨小計	銘 柄 数 額	15銘柄			99,030	91,089	511,013	
マレーシア	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.4980	千マレーシア・リンギット 1,760	千マレーシア・リンギット 1,777	48,185	2030/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8920	1,250	1,221	33,122	2027/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.4920	1,050	1,049	28,458	2020/03/31
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8440	600	553	15,000	2033/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.9550	1,150	1,140	30,911	2025/09/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.7950	1,100	1,098	29,784	2022/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8000	600	596	16,170	2023/08/17
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.7360	1,420	1,376	37,319	2046/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.6200	400	399	10,821	2021/11/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.7620	1,000	999	27,085	2037/04/07
通貨小計	銘 柄 数 額	10銘柄			10,330	10,212	276,859	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	7.2500	千南アフリカ・ランド 1,210	千南アフリカ・ランド 1,223	10,154	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	10.5000	8,010	8,722	72,393	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	6.7500	1,200	1,189	9,873	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	6.5000	2,610	1,836	15,244	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	7.7500	2,900	2,853	23,686	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.7500	15,900	14,298	118,679	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.5000	5,250	4,703	39,037	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.0000	2,850	2,587	21,478	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.7500	2,300	2,069	17,176	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.2500	9,700	8,772	72,811	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	9.0000	3,000	2,785	23,123	2040/01/31
通貨小計	銘 柄 数 額	11銘柄			54,930	51,043	423,658	
ポーランド	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 1,200	千ポーランド・ズロチ 1,356	40,884	2022/09/23
	Poland Government Bond		国 債 証 券	1.5000	1,340	1,340	40,404	2020/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	640	622	18,756	2026/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.0000	2,000	2,015	60,750	2021/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	1.7500	1,520	1,521	45,863	2021/07/25

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2018年11月30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	
				%	千ポランド・ズロチ	千ポランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	1,815	1,742	52,517	2027/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.2500	800	805	24,275	2022/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	3,000	3,026	91,224	2023/01/25
	Poland Government Bond		国債証券	5.7500	600	740	22,304	2029/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	4.0000	710	762	22,975	2023/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	3.2500	1,430	1,472	44,393	2025/07/25
通貨小計	銘 柄 数	11銘柄			15,055	15,406	464,350	
	金 額							
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY		国債証券	5.4000	688	900	116,342	2025/03/13
	IRISH TREASURY		国債証券	5.0000	910	1,004	129,745	2020/10/18
	IRISH TREASURY		国債証券	3.9000	420	490	63,407	2023/03/20
	IRISH TREASURY		国債証券	3.4000	600	700	90,527	2024/03/18
	IRISH TREASURY		国債証券	2.4000	680	772	99,824	2030/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	2.0000	310	323	41,799	2045/02/18
	IRISH TREASURY		国債証券	1.0000	320	329	42,554	2026/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.7000	170	173	22,351	2037/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.3000	150	147	19,083	2033/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	4.5000	190	203	26,244	2020/04/18
国小計	銘 柄 数	10銘柄			4,438	5,045	651,881	
	金 額							
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	580	849	109,782	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	655	1,003	129,608	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	1,170	1,368	176,840	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	175	186	24,139	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	630	998	129,014	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	492	541	69,927	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	500	548	70,829	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	590	730	94,369	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	540	764	98,727	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	380	424	54,782	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	850	859	110,991	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	690	697	90,135	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	670	685	88,512	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	-	420	425	55,012	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	470	486	62,809	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,600	1,609	207,919	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	600	616	79,702	2028/07/15
国小計	銘 柄 数	17銘柄			11,012	12,795	1,653,105	
	金 額							
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond		国債証券	0.8000	670	692	89,475	2025/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.0000	1,022	1,015	131,176	2031/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.9000	610	650	83,989	2038/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.0000	595	618	79,932	2026/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.6000	564	541	69,935	2047/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.2000	400	404	52,235	2023/10/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.8000	1,730	1,755	226,853	2027/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.5000	500	509	65,797	2024/10/22
	Belgium Government Bond		国債証券	2.2500	310	329	42,604	2057/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.8000	680	682	88,195	2028/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.2500	500	503	64,996	2033/04/22
	Belgium Government Bond		国債証券	5.0000	200	308	39,842	2035/03/28

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2018年11月30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	
	Belgium Government Bond		国債証券	4.0000	550	630	81,419	2022/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	3.7500	534	576	74,454	2020/09/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.2500	665	997	128,898	2041/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.2500	500	566	73,206	2021/09/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.5000	300	388	50,230	2026/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.2500	730	856	110,709	2022/09/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.0000	300	408	52,804	2032/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	2.2500	1,000	1,109	143,294	2023/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	3.7500	340	488	63,093	2045/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	2.6000	800	910	117,631	2024/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	3.0000	300	372	48,142	2034/06/22
国小計	銘柄数 金 額	23銘柄			13,800	15,317	1,978,923	
ユーロ (フランス)					千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	6.0000	2,415	3,371	435,574	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	1,000	1,485	191,956	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	1,700	2,761	356,696	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	1,310	2,024	261,570	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,382	2,223	287,300	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	650	716	92,516	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,065	1,572	203,146	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	1,200	1,457	188,258	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	1,043	1,665	215,228	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	3,000	3,171	409,773	2020/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	1,040	1,287	166,293	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	4,270	4,519	583,846	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	3,314	3,668	473,899	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	1,900	2,116	273,409	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,910	2,283	294,968	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,695	1,861	240,432	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	1,540	2,108	272,415	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,530	1,661	214,619	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,400	1,572	203,117	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	2,486	2,943	380,244	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,060	1,165	150,557	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,100	2,144	277,026	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	600	607	78,544	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	3,000	3,034	391,996	2021/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	2,570	2,539	328,083	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,300	1,389	179,473	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	1,300	1,406	181,678	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,200	1,207	156,029	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	1,300	1,315	169,893	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	1,400	1,423	183,949	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	1,150	1,156	149,446	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,200	1,198	154,823	2024/03/25
国小計	銘柄数 金 額	32銘柄			54,030	63,060	8,146,770	
ユーロ (ドイツ)					千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.5000	855	1,320	170,633	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.2500	1,696	2,785	359,835	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	160	255	33,043	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	970	1,565	202,207	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	890	1,384	178,805	2037/01/04

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2018年11月30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	4.2500	720	1,192	154,122	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	360	641	82,925	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	1,500	1,587	205,152	2020/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	806	1,216	157,148	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	2,655	2,862	369,767	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,542	1,665	215,143	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	1,248	1,695	218,992	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	1,150	1,241	160,400	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	1,460	1,620	209,316	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	500	552	71,340	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	725	997	128,817	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	990	1,082	139,869	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	200	213	27,577	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,190	1,235	159,579	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	1,800	1,927	249,054	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	883	914	118,118	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	950	944	122,064	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,000	1,009	130,463	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,900	1,950	252,049	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	580	618	79,937	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	450	460	59,441	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	100	99	12,835	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,900	1,917	247,746	2020/04/17
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	3,440	3,497	451,879	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,800	1,827	236,151	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,500	1,524	196,970	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	500	508	65,636	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	150	152	19,672	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,000	1,013	130,870	2023/10/13
国小計	銘柄数 金 額	34銘柄			37,570	43,483	5,617,571	
ユーロ（スペイン）					千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	6.0000	2,320	3,296	425,888	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.6000	500	523	67,625	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.9500	610	623	80,595	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.1500	1,865	2,010	259,766	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.1500	1,000	1,023	132,218	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.9500	1,000	1,060	137,016	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	1,000	1,021	132,012	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.9000	889	936	120,951	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.4500	480	536	69,323	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.3000	1,749	1,764	227,959	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.4000	1,250	1,262	163,124	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	600	609	78,727	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.3500	1,320	1,370	177,041	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.4500	670	674	87,164	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.4000	950	946	122,336	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	280	410	53,049	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2000	800	1,040	134,437	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.9000	600	856	110,646	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7000	943	1,318	170,289	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.8500	1,600	1,754	226,605	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	724	821	106,160	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.8500	1,140	1,348	174,219	2022/01/31

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2018年11月30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	5.4000	2,310	2,797	361,415	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.4000	1,588	1,886	243,763	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.1500	1,100	1,468	189,697	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.1500	590	880	113,781	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.8000	700	816	105,470	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,384	1,543	199,432	2024/10/31
国小計	銘	柄	数					
	金	額	額		29,962	34,605	4,470,721	
			28銘柄		千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	7.2500	1,600	2,087	269,639	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.5000	2,135	2,697	348,474	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	705	653	84,382	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	920	855	110,531	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	500	476	61,517	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.4500	800	785	101,418	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	750	631	81,585	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.6500	1,400	1,299	167,894	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.3500	3,000	2,906	375,489	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.8000	690	565	73,105	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.4500	1,300	1,153	149,068	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2000	500	471	60,874	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2000	1,500	1,471	190,062	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.4500	350	329	42,585	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.9000	700	674	87,130	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	500	460	59,539	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.8000	2,000	1,936	250,181	2028/12/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.2500	740	874	112,931	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	6.0000	1,288	1,625	210,015	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.7500	1,000	1,243	160,592	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	1,050	1,231	159,046	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.0000	770	812	104,946	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	3.7500	1,702	1,801	232,696	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	1,640	1,922	248,389	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.7500	2,170	2,409	311,345	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	1,700	1,925	248,709	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	664	776	100,263	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.0000	3,050	3,214	415,338	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.5000	1,850	2,051	264,988	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	3.7500	1,650	1,744	225,377	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.7500	1,320	1,431	184,996	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	780	857	110,815	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.5000	2,770	3,122	403,389	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.7500	1,480	1,689	218,250	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.7500	1,075	1,232	159,252	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.5000	830	911	117,712	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	3.7500	2,110	2,238	289,172	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	3.5000	370	377	48,733	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	2.1500	700	711	91,928	2021/12/15
国小計	銘	柄	数					
	金	額	額		50,059	53,660	6,932,374	
			39銘柄		千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond		国債証券	0.7500	190	188	24,382	2031/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	180	182	23,615	2026/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	200	200	25,887	2027/09/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2018年11月30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	1.1250	150	153	19,832	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	495	63,971	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	250	32,351	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	200	210	27,245	2020/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	144	18,693	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	980	1,050	135,726	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	210	276	35,659	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	387	50,113	2024/04/15
国小計	銘柄数 金 額	11銘柄			3,280	3,541	457,480
ユーロ（オーストリア）				千ユーロ	千ユーロ		
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	840	896	115,862	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	504	65,134	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	120	122	15,827	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	400	401	51,852	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	300	305	39,422	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	566	73,234	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	480	515	66,547	2020/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	660	733	94,793	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	510	765	98,888	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	860	986	127,481	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	520	893	115,464	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	380	532	68,748	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	680	742	95,943	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	280	335	43,299	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	280	306	39,596	2024/10/21
国小計	銘柄数 金 額	15銘柄			7,180	8,608	1,112,096
通貨小計	銘柄数 金 額	209銘柄			211,331	240,118	31,020,925
合 計	銘柄数 金 額	407銘柄					79,129,977

(注1) 邦貨換算金額は、2018年11月30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。

(3) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘 柄 別	2018年11月30日現在		
	買 建 額	売 建 額	
外	百万円	百万円	
	US LONG BOND(CBT)(アメリカ)	15	—
	US 5YR NOTE (CBT)(アメリカ)	192	—
	US ULTRA BOND CBT(アメリカ)	120	—
	EURO-BOBL FUTURE(ドイツ)	119	—
国	EURO BUXL 30Y BND(ドイツ)	115	—
	EURO-BTP FUTURE(イタリア)	16	—
	EURO-OAT FUTURE(フランス)	19	—

(注1) 外貨建の評価額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書 第2期（決算日 2018年6月15日）

（計算期間 2017年6月16日～2018年6月15日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	外国の公社債
運用方法	①主として、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ②運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

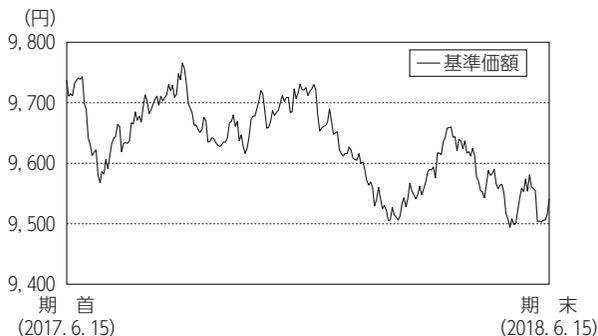
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：9,737円 期末：9,541円 騰落率：△2.0%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○外国債券市況

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

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

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15	2,250,639	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/12/31	1,514,536
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	1,288,601	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2019/5/15	930,753
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/10/31	1,080,802	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2018/10/31	666,443
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2019/11/15	1,071,093	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/10/31	656,168
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/2/28	1,019,721	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2019/11/15	234,971
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2025/8/15	982,367	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 1.75% 2019/3/1	219,795
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15	926,726	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.5% 2018/8/1	207,619
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15	911,983	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1% 2019/5/25	191,365
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2043/5/15	812,683	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 3.75% 2019/1/4	165,622
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2024/11/15	801,927	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2018/10/25	135,148

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作 成 期	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
アメリカ	千アメリカ・ドル 250,848	千アメリカ・ドル 247,571	千円	41.6 %	%	17.9 %	17.7 %	6.0 %
カナダ	千カナダ・ドル 15,864	千カナダ・ドル 16,695		2.1	—	0.8	0.6	0.8
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 15,297	千オーストラリア・ドル 16,399		2.1	—	1.3	0.6	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 2,667	千シンガポール・ドル 2,685		0.3	—	0.2	0.0	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 24,047	千イギリス・ポンド 30,675		6.8	—	5.2	1.1	0.5
スイス	千スイス・フラン 552	千スイス・フラン 682		0.1	—	0.1	0.0	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 16,410	千デンマーク・クローネ 20,239		0.5	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 9,650	千ノルウェー・クローネ 9,975		0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 15,650	千スウェーデン・クローネ 17,882		0.3	—	0.2	0.1	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 82,030	千メキシコ・ペソ 81,660		0.7	—	0.4	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 10,330	千マレーシア・リンギット 10,123		0.4	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 41,430	千南アフリカ・ランド 38,181		0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 13,175	千ポーランド・ズロチ 13,504		0.6	—	0.2	0.3	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 3,678	千ユーロ 4,139		0.8	—	0.4	0.3	0.1

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 9,212	千ユーロ 10,695	千円 1,367,958	% 2.1	% —	% 1.4	% 0.5	% 0.2
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 11,130	千ユーロ 12,439	1,590,975	2.4	—	1.8	0.5	0.1
ユーロ (フランス)	千ユーロ 44,510	千ユーロ 52,249	6,682,731	10.2	—	6.4	3.1	0.6
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 31,694	千ユーロ 36,291	4,641,639	7.1	—	4.0	2.1	0.9
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 25,130	千ユーロ 29,111	3,723,340	5.7	—	3.9	1.2	0.5
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 40,799	千ユーロ 45,788	5,856,341	8.9	—	5.6	2.6	0.7
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 2,710	千ユーロ 2,982	381,408	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 6,180	千ユーロ 7,423	949,499	1.4	—	1.0	0.4	—
ユーロ (小計)	175,043	201,120	25,723,348	39.1	—	24.7	11.1	3.3
合計	—	—	62,822,098	95.5	—	52.3	32.1	11.1

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

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

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	8,210	7,945	879,432	2043/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,208	133,751	2043/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	332	372	41,189	2043/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	2,600	2,745	303,839	2044/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,190	3,226	357,065	2044/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	12,440	12,274	1,358,505	2019/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	9,810	9,438	1,044,706	2024/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	13,150	12,681	1,403,584	2022/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,570	1,552	171,784	2045/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	12,320	11,591	1,282,921	2025/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	16,720	16,013	1,772,346	2022/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,900	3,724	412,257	2025/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,820	201,470	2026/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,165	1,057	117,065	2026/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,070	1,850	204,835	2046/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	895	99,152	2026/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,350	2,185	241,870	2026/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,480	2,389	264,426	2046/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	10,500	10,282	1,138,025	2019/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,120	4,849	536,704	2027/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,500	5,412	599,061	2020/03/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,850	1,767	195,654	2027/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	2,222	245,934	2047/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,310	5,923	655,558	2047/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,200	2,225	246,291	2048/05/15
通貨小計	銘柄数 金 額	45銘柄			250,848	247,571	27,401,194	
カナダ		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	460	524	44,195	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	707	942	79,500	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	250	358	30,199	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	668	941	79,369	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	170	220	18,585	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	5,820	5,992	2020/06/01	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	409	34,569	2022/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	880	1,091	92,009	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,238	1,200	101,233	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	230	233	19,722	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	592	592	49,989	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	320	302	25,522	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,959	1,880	158,541	2021/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	834	70,406	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,240	1,170	98,710	2022/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄			15,864	16,695	1,407,919	
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,770	1,949	160,915	2021/05/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	800	835	68,926	2020/04/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,080	1,226	101,229	2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,383	1,581	130,488	2023/04/21

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,089	1,265	104,442	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	656	665	54,939	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	920	964	79,591	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,251	103,249	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	859	1,023	84,430	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	998	1,111	91,727	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	300	302	25,003	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	796	65,697	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	400	396	32,743	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	697	57,527	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,158	2,069	170,808	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	275	262	21,703	2047/03/21
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄			15,297	16,399	1,353,423	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	218	17,958	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	125	125	10,345	2019/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	155	12,764	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	300	305	25,091	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	390	392	32,224	2021/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	89	86	7,074	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	204	16,805	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	120	127	10,499	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	300	299	24,600	2019/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	398	32,748	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	317	26,128	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	60	54	4,487	2036/08/01
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄			2,667	2,685	220,728	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	750	793	116,359	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,300	1,325	194,331	2021/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	910	1,193	175,100	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	525	534	78,385	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	245	36,047	2022/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	850	840	123,338	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	863	1,248	183,042	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	350	465	68,326	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	675	843	123,739	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,165	1,618	237,323	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,090	1,167	171,159	2020/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	620	963	141,367	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	411	633	92,959	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,238	181,620	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,893	3,050	447,424	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,430	2,063	302,673	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,040	1,161	170,321	2022/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,045	1,085	159,135	2019/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	787	1,361	199,655	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	810	864	126,829	2020/09/07

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
							千円	
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	千イギリス・ポンド 742	千イギリス・ポンド 811	119,054	2021/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	580	599	87,961	2022/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,425	1,853	271,896	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,290	1,369	200,819	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	748	1,251	183,597	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	300	329	48,295	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,290	1,759	258,113	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	27銘柄			24,047	30,675	4,498,881	
					千スイス・フラン	千スイス・フラン		
スイス		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	282	393	43,597	2028/04/08
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	120	127	14,158	2020/07/06
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	150	161	17,959	2021/04/28
通貨小計	銘柄数 金 額	3銘柄			552	682	75,715	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	4,140	7,011	120,388	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,760	2,942	50,514	2019/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,310	2,580	44,307	2021/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,896	49,730	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,330	2,597	44,597	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,211	37,967	2027/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄			16,410	20,239	347,506	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,620	2,820	38,353	2021/05/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,150	1,183	16,094	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,407	19,147	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	151	2,060	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,412	19,216	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,999	40,795	2027/02/17
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄			9,650	9,975	135,667	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	2,780	3,165	40,007	2020/12/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,920	2,715	34,322	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,950	3,393	42,898	2022/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,150	2,328	29,438	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,342	29,607	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,280	1,344	16,991	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,592	32,766	2028/05/12
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄			15,650	17,882	226,032	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.0000	5,400	5,185	27,534	2019/12/11
		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	4,200	3,669	19,485	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,450	1,445	7,675	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	6,747	35,828	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	7,004	37,193	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	4,800	4,664	24,770	2027/06/03

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

		当 期			末			
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	3,279	17,415	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,762	35,908	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	5,246	27,858	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	5,500	5,519	29,309	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,700	13,192	70,050	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,700	2,652	14,085	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	8,900	8,448	44,862	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,750	4,613	24,496	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,300	3,228	17,140	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		82,030	81,660	433,614		
				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット			
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,760	1,741	48,374	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,250	1,207	33,549	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,050	1,049	29,152	2020/03/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	600	541	15,037	2033/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,128	31,353	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,100	1,095	30,425	2022/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	600	595	16,533	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,374	38,178	2046/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	400	399	11,102	2021/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	990	27,515	2037/04/07	
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		10,330	10,123	281,223		
				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド			
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	1,210	1,205	9,909	2020/01/15	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	5,010	5,469	44,958	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	1,200	1,166	9,585	2021/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	2,610	1,832	15,060	2041/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,900	2,838	23,330	2023/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	8,400	7,536	61,949	2048/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	5,250	4,718	38,786	2037/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	2,850	2,579	21,201	2030/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	2,300	2,070	17,017	2044/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	9,700	8,766	72,058	2032/03/31	
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		41,430	38,181	313,856		
				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ			
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,200	1,367	40,798	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,120	1,182	35,280	2019/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	1,340	1,339	39,968	2020/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	640	612	18,284	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,009	59,972	2021/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,520	1,512	45,143	2021/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,719	51,316	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	800	801	23,924	2022/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	742	22,158	2029/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	760	22,691	2023/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,430	1,455	43,446	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		13,175	13,504	402,985		

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

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

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

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	306	451	57,771	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,655	2,890	369,640	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,675	214,273	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,248	1,649	211,034	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,245	159,247	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	960	1,068	136,621	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	500	552	70,633	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	725	968	123,856	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,080	138,257	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,225	156,776	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,800	1,914	244,914	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	904	115,734	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	950	931	119,102	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	995	127,306	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,012	129,477	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	280	286	36,665	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	251	32,190	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,440	1,458	186,489	2019/10/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,923	245,972	2020/04/17
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,440	3,509	448,810	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,522	194,727	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	150	151	19,376	2023/04/14
国 小 計	銘柄数 金 額	30銘柄		31,694	36,291	4,641,639	
ユーロ（スペイン）	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,320	1,911	244,506	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	500	527	67,490	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	610	632	80,933	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,865	2,027	259,297	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	1,025	131,224	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	889	971	124,271	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	280	330	42,236	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,749	1,777	227,316	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	350	353	45,273	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	600	614	78,604	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	920	974	124,589	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	670	680	86,977	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	350	351	44,943	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	280	421	53,933	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	800	1,072	137,118	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	400	589	75,344	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	1,238	1,307	167,204	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	943	1,359	173,866	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,600	1,789	228,826	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	724	840	107,473	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,140	1,379	176,435	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	810	1,000	128,008	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,588	1,919	245,544	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	600	815	104,265	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	340	524	67,065	2044/10/31

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	829	106,054	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,384	1,563	200,009	2024/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,480	1,520	194,525	2020/01/31
国 小 計	銘柄数 金 額	28銘柄			25,130	29,111	3,723,340	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	800	1,080	138,179	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,135	2,792	357,217	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	705	684	87,513	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	871	111,499	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	200	187	24,002	2023/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	690	586	74,950	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	600	553	70,784	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	500	482	61,700	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,500	1,485	190,025	2022/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	350	345	44,223	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	469	60,024	2028/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	740	901	115,291	2029/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,288	1,682	215,193	2031/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,301	166,406	2033/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,050	1,290	165,118	2034/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	770	852	109,060	2037/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	702	756	96,736	2021/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,021	258,517	2039/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,570	1,789	228,857	2023/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	3,470	3,625	463,669	2019/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,700	1,984	253,812	2025/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	664	818	104,628	2040/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	3,050	3,255	416,399	2020/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,850	2,111	270,110	2026/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,650	1,767	226,067	2021/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,320	1,465	187,476	2021/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	780	878	112,332	2022/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,770	3,206	410,125	2022/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,480	1,721	220,233	2028/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	395	476	60,997	2044/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	830	937	119,861	2024/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,295	293,630	2024/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	370	387	49,592	2030/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	700	720	92,102	2021/12/15
国 小 計	銘柄数 金 額	34銘柄			40,799	45,788	5,856,341	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フィンランド)		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	190	187	23,936	2031/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	181	23,191	2026/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	198	25,364	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.3750	80	84	10,771	2019/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	252	32,242	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	3.3750	200	214	27,440	2020/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	144	18,498	2028/07/04

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		Finland Government Bond	国債証券	1.6250	千ユーロ 980	千ユーロ 1,057	千円 135,223	2022/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	210	273	34,963	2042/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	389	49,775	2024/04/15
国 小 計	銘柄数 金 額	10銘柄			2,710	2,982	381,408	
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	千ユーロ 440	千ユーロ 467	59,744	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	499	63,929	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	120	119	15,336	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	400	397	50,806	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	572	73,285	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.9000	480	524	67,091	2020/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.5000	660	744	95,208	2021/09/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	510	761	97,450	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	860	997	127,634	2022/11/22
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	420	705	90,253	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	180	248	31,801	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	680	744	95,196	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	280	332	42,587	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	280	306	39,172	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	14銘柄			6,180	7,423	949,499	
通貨小計	銘柄数 金 額	196銘柄			175,043	201,120	25,723,348	
合 計	銘柄数 金 額	379銘柄					62,822,098	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

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

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

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

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

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

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,541円です。

*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,167,814,868円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

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

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

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

《お知らせ》

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

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし)

運用報告書 (全体版) 第2期

(決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日~2018年11月30日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	無期限	
運用方針	海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券 ロ. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	新興国通貨建ての債券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	外国債券インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

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。

当ファンドは、海外の債券指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先 (コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
		税金 分	入金 金	期騰 落 中率			
1期末 (2017年11月30日)	円 10,477		円 0	% 4.8	% 97.9	% -	百万円 1,406
2期末 (2018年11月30日)	10,222		0	△2.4	97.4	-	2,442

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

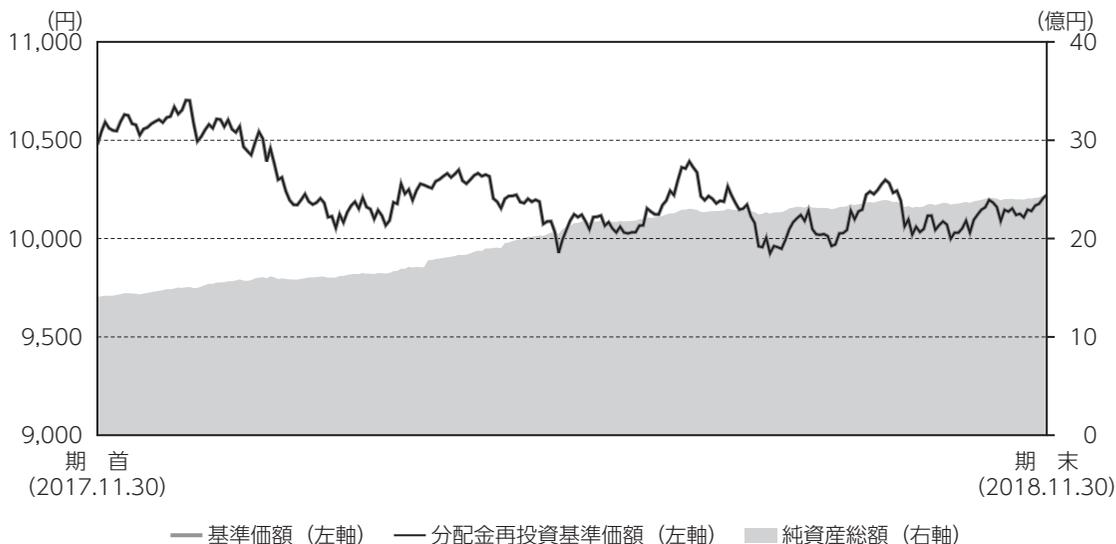
(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,477円

期末：10,222円（分配金0円）

騰落率：△2.4%（分配金込み）

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	△1.7%	79.8%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	△4.2%	20.1%

■ 基準価額の主な変動要因

主に海外の債券に投資した結果、債券市場で金利が上昇（債券価格は下落）したことや、ユーロなど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。

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし)

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率	債 券 先 物 率
	騰 落 率	率		
(期首) 2017年11月30日	円 10,477	% -	% 97.9	% -
12月末	10,633	1.5	97.3	-
2018年 1 月末	10,425	△0.5	97.6	-
2 月末	10,181	△2.8	97.3	-
3 月末	10,228	△2.4	98.0	-
4 月末	10,317	△1.5	97.9	-
5 月末	9,994	△4.6	97.8	-
6 月末	10,067	△3.9	97.7	-
7 月末	10,188	△2.8	97.8	-
8 月末	10,048	△4.1	97.6	-
9 月末	10,276	△1.9	97.5	-
10月末	10,091	△3.7	97.5	-
(期末) 2018年11月30日	10,222	△2.4	97.4	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■海外債券市況

国債金利は、当作成期を通じて多くの国で上昇しました。

先進国の債券市場では、当作成期を通じて多くの国で金利は上昇しました。当作成期首より、米国の税制改革法が成立したことを背景に市場のリスク選好度が強まったことや、日本およびユーロ圏などの主要先進国において金融政策の正常化観測が高まったことなどから、主要国の国債金利は上昇しました。2018年4月に入ると、米国と中国の貿易摩擦への懸念が後退し、市場のリスク選好度が強まったことなどから、金利は再び上昇傾向となりました。5月後半以降は、イタリアの政治情勢や米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、金利は低下傾向となりました。その後はレンジ内での推移が続きましたが、9月以降はリスク資産の価格が堅調に推移したことなどから、金利は上昇基調となりました。

新興国の債券市場では、米国の利上げの影響を受けて利上げを行なった国も多く、先進国と同様に主な新興国の金利は上昇しました。

■為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると、米ドルは対円で上昇したものの、ユーロなど他の通貨は下落しました。

先進国の為替相場は、当作成期を通してみると、米ドルは対円で上昇したものの、ユーロなど他の通貨は下落しました。当作成期首より円安が進みましたが、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。2018年4月以降は、米国の金利が上昇したことやそれまでの米ドル安の反動もあり、米ドルが上昇傾向となりました。一方、イタリアの政治情勢への懸念が高まったことなどがユーロの下落材料となりました。8月にはトルコ情勢への警戒感が高まり、市場のリスク回避姿勢が強まる中で円高傾向となりましたが、9月以降は新興国通貨安への懸念が後退し、市場のリスク回避姿勢が和らいだことを受けて円安傾向となりました。10月以降は、株価が下落し市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから円高傾向となりました。

新興国の為替相場は、米国が利上げを進める中で米ドル高が進んだことや、国によっては経常赤字の拡大懸念や政治的な不透明要因から、各国の通貨とも対円で下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年12月1日 ～2018年11月30日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	279

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017.12.1~2018.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	28円	0.270%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,227円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0.194)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	6	0.059	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(5)	(0.051)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(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	34	0.329	

(注1) 当作成期中の費用(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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	193,073	260,869	27,353	36,308
外国債券インデックス・マザーファンド	320,375	879,630	14,229	39,352

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	203,180	368,899	491,079			
外国債券インデックス・マザーファンド	400,023	706,169	1,948,886			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	491,079	20.1
外国債券インデックス・マザーファンド	1,948,886	79.6
コール・ローン等、その他	6,922	0.3
投資信託財産総額	2,446,887	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1シンガポール・ドル=82.89円、1イギリス・ポンド=145.01円、1トルコ・リラ=21.97円、1デンマーク・クローネ=17.31円、1ノルウェー・クローネ=13.28円、1スウェーデン・クローネ=12.51円、1メキシコ・ペソ=5.61円、1フィリピン・ペソ=2.16円、1アルゼンチン・ペソ=3.00円、100チリ・ペソ=16.94円、100コロンビア・ペソ=3.50円、100インドネシア・ルピア=0.79円、1ブラジル・レアル=29.44円、1チェコ・コルナ=4.98円、1ルーマニア・レイ=27.74円、1ロシア・ルーブル=13.28円、1マレーシア・リンギット=27.11円、1南アフリカ・ランド=8.30円、1タイ・バーツ=3.44円、1ペルー・ソル=33.54円、1ポーランド・ズロチ=30.14円、100ハンガリー・フォリント=39.92円、1ウルグアイ・ペソ=3.53円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(10,453,694千円)の投資信託財産総額(10,715,098千円)に対する比率は、97.6%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(168,411,756千円)の投資信託財産総額(169,866,619千円)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

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,446,887,602円
コール・ローン等	6,922,277
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	491,079,297
外国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	1,948,886,028
(B) 負債	4,551,230
未払解約金	1,343,977
未払信託報酬	3,113,868
その他未払費用	93,385
(C) 純資産総額(A-B)	2,442,336,372
元本	2,389,228,743
次期繰越損益金	53,107,629
(D) 受益権総口数	2,389,228,743口
1万口当り基準価額(C/D)	10,222円

*期首における元本額は1,342,783,335円、当作成期間中における追加設定元本額は1,446,419,314円、同解約元本額は399,973,906円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,222円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,579円
受取利息	282
支払利息	△ 3,861
(B) 有価証券売買損益	△ 23,358,497
売買益	7,262,379
売買損	△ 30,620,876
(C) 信託報酬等	△ 5,515,062
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 28,877,138
(E) 前期繰越損益金	30,492,019
(F) 追加信託差損益金	51,492,748
(配当等相当額)	(36,308,841)
(売買損益相当額)	(15,183,907)
(G) 合計(D+E+F)	53,107,629
次期繰越損益金(G)	53,107,629
追加信託差損益金	51,492,748
(配当等相当額)	(36,308,841)
(売買損益相当額)	(15,183,907)
分準備積立金	30,492,601
繰越損益金	△ 28,877,720

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	36,308,841
(d) 分配準備積立金	30,492,601
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	66,801,442
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	66,801,442
(h) 受益権総口数	2,389,228,743口

《お知らせ》

■運用において参照している指数の名称変更について

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

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2018年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年11月30日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を214～220ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2020/7/1	126,957	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2020/7/1	153,238
Mexican Bonos (メキシコ) 7.5%	2027/6/3	96,868	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2020/1/1	99,865
Poland Government Bond (ポーランド) 2.5%	2023/1/25	91,352	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2019/1/1	75,625
Colombian TES (コロンビア) 6%	2028/4/28	89,700	Thailand Government Bond (タイ) 3.875%	2019/6/13	63,441
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2021/7/1	85,500	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2019/4/1	58,048
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5%	2026/12/21	78,300	Mexican Bonos (メキシコ) 5%	2019/12/11	53,765
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2022/1/1	75,607	Colombian TES (コロンビア) 7%	2019/9/11	48,022
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10%	2025/1/1	69,160	MALAYSIAN GOVERNMENT (マレーシア) 4.378%	2019/11/29	42,910
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2022/7/1	65,998	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2019/7/1	40,131
MALAYSIAN GOVERNMENT (マレーシア) 3.733%	2028/6/15	65,762	Mexican Bonos (メキシコ) 8.5%	2018/12/13	40,109

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年11月30日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（8,027,339千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2018年11月30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
トルコ	千トルコ・リラ 31,410	千トルコ・リラ 25,545	千円 561,228	% 5.3	% -	% 1.8	% 2.7	% 0.7
メキシコ	千メキシコ・ペソ 176,240	千メキシコ・ペソ 164,665	923,774	8.6	-	5.5	2.3	0.9
フィリピン	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 14,874	32,128	0.3	-	-	0.3	-
アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 22,900	千アルゼンチン・ペソ 17,382	52,147	0.5	0.5	0.4	0.1	-
チリ	千チリ・ペソ 1,605,000	千チリ・ペソ 1,668,438	282,633	2.6	-	2.0	0.5	0.1
コロンビア	千コロンビア・ペソ 20,680,000	千コロンビア・ペソ 21,483,521	751,923	7.0	-	5.2	1.0	0.8
インドネシア	千インドネシア・ルピア 125,449,000	千インドネシア・ルピア 124,596,860	984,315	9.2	-	7.1	1.9	0.2
ブラジル	千ブラジル・レアル 32,550	千ブラジル・レアル 29,677	873,691	8.2	-	2.0	4.7	1.5

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分	2018年11月30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	
チェコ	千チェコ・コルナ 82,900	千チェコ・コルナ 84,776	千円 422,186	% 4.0	% -	% 2.5	% 1.1	% 0.4	
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 10,510	千ルーマニア・レイ 10,630	294,876	2.8	-	0.7	1.7	0.4	
ロシア	千ロシア・ルーブル 469,310	千ロシア・ルーブル 449,761	769,092	7.2	-	3.9	2.8	0.5	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,760	千マレーシア・リンギット 21,637	586,590	5.5	-	3.4	1.1	1.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 119,440	千南アフリカ・ランド 109,335	907,487	8.5	-	7.4	0.7	0.3	
タイ	千タイ・バーツ 241,960	千タイ・バーツ 251,259	864,333	8.1	-	4.9	2.9	0.3	
ペルー	千ペルー・ソル 8,610	千ペルー・ソル 9,285	311,438	2.9	-	2.8	-	0.1	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 29,960	千ポーランド・ズロチ 30,624	923,014	8.6	-	2.4	4.8	1.4	
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 1,134,600	千ハンガリー・フォリント 1,234,350	492,752	4.6	-	1.9	2.0	0.7	
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 8,100	千ウルグアイ・ペソ 7,614	26,879	0.3	-	0.1	0.2	-	
合 計	-	-	10,060,492	94.1	0.5	54.0	30.8	9.3	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2018年11月30日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
トルコ	Turkey Government Bond	国 債 証 券	% 10.5000	千トルコ・リラ 680	千トルコ・リラ 626	千円 13,759	2020/01/15	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	9.5000	1,660	1,338	29,409	2022/01/12	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	8.5000	790	622	13,667	2022/09/14	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	7.1000	2,780	1,992	43,776	2023/03/08	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	8.8000	1,390	1,051	23,091	2023/09/27	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.4000	680	542	11,923	2024/03/20	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	9.0000	1,630	1,216	26,729	2024/07/24	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	7.4000	2,070	1,828	40,180	2020/02/05	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	8.0000	1,490	1,013	22,272	2025/03/12	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	9.4000	1,180	1,034	22,733	2020/07/08	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.7000	1,610	1,393	30,613	2021/02/17	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.6000	2,570	1,999	43,925	2026/02/11	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	9.2000	1,010	836	18,377	2021/09/22	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	11.0000	1,400	1,187	26,079	2022/03/02	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	11.0000	1,470	1,139	25,044	2027/02/24	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.7000	1,900	1,581	34,743	2022/08/17	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.5000	1,700	1,268	27,866	2027/08/11	
Turkey Government Bond	国 債 証 券	12.2000	1,400	1,223	26,875	2023/01/18		
Turkey Government Bond	国 債 証 券	12.4000	2,000	1,671	36,721	2028/03/08		

2018年11月30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		
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	% 16.2000	千トルコ・リラ 2,000	千トルコ・リラ 1,977	千円 43,439	2023/06/14	
通貨小計	銘柄数 20銘柄			31,410	25,545	561,228		
メキシコ	Mexican Bonos	国 債 証 券	5.7500	千メキシコ・ペソ 10,400	千メキシコ・ペソ 8,580	48,137	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	4,500	3,758	21,087	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.2500	5,000	4,807	26,972	2021/12/09	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	11,250	10,839	60,810	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	18,350	19,204	107,739	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.5000	23,230	21,022	117,934	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	7,390	7,612	42,707	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	7,230	6,865	38,516	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	4,100	3,674	20,611	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	16,990	16,895	94,782	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	6.5000	21,950	20,930	117,422	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	7,950	6,980	39,162	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	6.5000	19,450	18,111	101,605	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	11,320	9,293	52,139	2042/11/13	
Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	7,130	7,130	6,086	34,144	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 15銘柄			176,240	164,665	923,774		
フィリピン	Philippine Government International Bond	国 債 証 券	4.9500	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 14,874	32,128	2021/01/15	
通貨小計	銘柄数 1銘柄			15,000	14,874	32,128		
アルゼンチン	REPUBLIC OF ARGENTINA	国 債 証 券	18.2000	千アルゼンチン・ペソ 4,700	千アルゼンチン・ペソ 3,687	11,063	2021/10/03	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国 債 証 券	16.0000	1,400	1,133	3,400	2023/10/17	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国 債 証 券	15.5000	16,800	12,561	37,683	2026/10/17	
通貨小計	銘柄数 3銘柄			22,900	17,382	52,147		
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国 債 証 券	4.5000	千チリ・ペソ 325,000	千チリ・ペソ 330,157	55,928	2021/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国 債 証 券	4.5000	470,000	474,873	80,443	2026/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国 債 証 券	5.0000	400,000	411,460	69,701	2035/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国 債 証 券	6.0000	260,000	299,460	50,728	2043/01/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国 債 証 券	4.7000	100,000	101,008	17,110	2030/09/01	
	Chile Government International Bond	国 債 証 券	5.5000	50,000	51,478	8,720	2020/08/05	
通貨小計	銘柄数 6銘柄			1,605,000	1,668,438	282,633		
コロンビア	Colombia Government International Bond	国 債 証 券	9.8500	千コロンビア・ペソ 90,000	千コロンビア・ペソ 112,743	3,946	2027/06/28	
	Colombia Government International Bond	国 債 証 券	7.7500	95,000	99,272	3,474	2021/04/14	
	Colombia Government International Bond	国 債 証 券	4.3750	45,000	43,247	1,513	2023/03/21	
	Colombian TES	国 債 証 券	11.0000	2,265,000	2,476,052	86,661	2020/07/24	
	Colombian TES	国 債 証 券	7.0000	2,935,000	3,054,777	106,917	2022/05/04	
	Colombian TES	国 債 証 券	10.0000	3,050,000	3,569,598	124,935	2024/07/24	
	Colombian TES	国 債 証 券	6.0000	3,590,000	3,352,701	117,344	2028/04/28	
	Colombian TES	国 債 証 券	7.5000	3,310,000	3,460,207	121,107	2026/08/26	
	Colombian TES	国 債 証 券	7.7500	2,000,000	2,094,220	73,297	2030/09/18	
	Colombian TES	国 債 証 券	7.0000	1,800,000	1,749,186	61,221	2032/06/30	
Colombian TES	国 債 証 券	6.2500	1,500,000	1,471,515	51,503	2025/11/26		
通貨小計	銘柄数 11銘柄			20,680,000	21,483,521	751,923		

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2018年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	5,750,000	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000				33,093
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	2,800,000				20,823
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000				53,828
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000				20,253
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	1,600,000				14,161
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,700,000				15,477
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	4,180,000				38,655
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	7,210,000				57,829
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000				25,852
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000				82,366
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000				37,579
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000				76,739
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	8,660,000				66,770
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	8,910,000				64,719
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000				60,986
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	4,975,000				34,470
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,020,000				79,848
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	11,150,000				89,698
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	7,820,000				65,794
通貨小計	銘 柄 数 金 額	20銘柄		125,449,000	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	984,315	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,030	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	92,545	2021/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,410			133,738	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,990			119,844	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,750			81,672	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	500			14,738	2029/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	3,640			95,661	2020/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	5,030			120,449	2021/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	3,400			77,467	2022/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	2,300			61,695	2020/04/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	3,500			75,878	2022/07/01
通貨小計	銘 柄 数 金 額	10銘柄		32,550		29,677	873,691	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	6,500	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	33,636	2020/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	8,200			43,375	2021/09/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	10,600			54,933	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600			52,014	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	10,200			56,408	2022/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	10,100			51,752	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	10,900			50,597	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	10,000			43,572	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	-	1,900			9,338	2020/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	2,900			13,547	2023/10/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	3,000			13,006	2027/02/10
	通貨小計	銘 柄 数 金 額	11銘柄		82,900		84,776	422,186
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	42,153	2023/04/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.9500	940			27,379	2021/06/11
	Romania Government Bond	国債証券	5.7500	770			22,072	2020/04/29

2018年11月30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		
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	千円	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,150	1,163	32,286	2021/03/22	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	630	624	20,816	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	2.2500	700	691	19,185	2020/02/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,064	29,528	2022/12/19	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	800	753	20,903	2024/04/29	
	Romania Government Bond	国債証券	3.4000	800	785	21,796	2022/03/08	
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,493	41,431	2023/06/28	
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		10,510	10,630	294,876		
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		2021/04/14	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	14,880	14,800	25,308	2022/02/03	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	41,760	40,888	69,919	2027/07/20	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	21,910	21,597	36,931	2022/07/20	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	10,800	10,724	18,339	2019/12/11	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	13,819	23,631	2023/01/25	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	36,160	32,816	56,116	2028/01/19	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	22,100	21,718	37,138	2020/05/27	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,300	23,200	39,672	2023/08/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	29,300	28,955	49,514	2021/08/18	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	24,000	23,820	40,732	2031/09/17	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	36,100	34,683	59,308	2026/09/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	39,000	38,142	65,222	2022/12/07	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	47,000	43,559	74,486	2033/03/23	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	35,600	33,538	57,350	2024/10/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	34,000	33,099	56,599	2021/12/15	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	21,000	19,376	33,134	2024/02/28	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	10,000	8,833	15,104	2034/05/10	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	7,000	6,186	10,578	2029/05/23	
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		469,310	449,761	769,092		
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.2260	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		2020/04/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	530	527	14,304	2020/04/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	800	803	21,782	2022/04/14	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,200	1,203	32,638	2027/07/26	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,000	1,010	27,381	2028/10/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,350	1,367	37,061	2021/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,510	1,509	40,925	2020/03/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,500	2,419	65,591	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,751	47,492	2024/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,350	1,338	36,287	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	1,740	1,743	47,272	2020/10/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	900	894	24,255	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,300	1,276	34,606	2026/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,197	32,463	2021/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,420	1,422	38,567	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,120	2,071	56,166	2027/11/16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,100	1,098	29,793	2037/04/07	
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		21,760	21,637	586,590		
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		2020/01/15	
				4,190	4,236	35,163		

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2018年11月30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	
				%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	10.5000	19,050	20,743	172,171	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.2500	10,220	7,351	61,017	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.7500	3,760	3,727	30,936	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.5000	5,280	3,715	30,838	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.0000	8,440	6,979	57,929	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.7500	5,880	5,786	48,025	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	14,020	12,608	104,646	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.5000	8,000	7,166	59,485	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.0000	7,100	6,446	53,508	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	11,100	9,987	82,894	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.2500	10,300	9,315	77,315	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.8750	5,100	4,770	39,598	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	9.0000	7,000	6,500	53,955	2040/01/31
通貨小計	銘 柄 数 額	14銘柄			119,440	109,335	907,487	
タイ					千タイ・パーツ	千タイ・パーツ		
	Thailand Government Bond		国債証券	4.8750	23,050	27,293	93,889	2029/06/22
	Thailand Government Bond		国債証券	3.6250	19,300	20,421	70,249	2023/06/16
	Thailand Government Bond		国債証券	3.8500	17,610	19,104	65,720	2025/12/12
	Thailand Government Bond		国債証券	3.6500	26,600	27,885	95,925	2021/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	3.6500	18,700	19,953	68,641	2031/06/20
	Thailand Government Bond		国債証券	2.5500	10,000	10,110	34,781	2020/06/26
	Thailand Government Bond		国債証券	1.8750	21,200	20,999	72,236	2022/06/17
	Thailand Government Bond		国債証券	3.4000	19,100	19,827	68,206	2036/06/17
	Thailand Government Bond		国債証券	2.1250	23,400	22,567	77,631	2026/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	2.0000	20,000	19,840	68,251	2022/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	3.7750	15,000	16,206	55,750	2032/06/25
	Thailand Government Bond		国債証券	2.8750	15,000	13,924	47,901	2046/06/17
	Thailand Government Bond		国債証券	2.4000	6,000	6,022	20,719	2023/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	2.8750	7,000	7,101	24,428	2028/12/17
通貨小計	銘 柄 数 額	14銘柄			241,960	251,259	864,333	
ペルー					千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
	Peru Government Bond		国債証券	5.7000	1,130	1,175	39,416	2024/08/12
	Peru Government Bond		国債証券	6.3500	1,470	1,546	51,862	2028/08/12
	Peru Government Bond		国債証券	6.1500	1,450	1,481	49,689	2032/08/12
	Peru Government Bond		国債証券	8.2000	1,565	1,844	61,871	2026/08/12
	Peru Government Bond		国債証券	7.8400	310	335	11,254	2020/08/12
	Peru Government Bond		国債証券	6.9000	1,165	1,245	41,783	2037/08/12
	Peru Government Bond		国債証券	6.9500	1,520	1,656	55,560	2031/08/12
通貨小計	銘 柄 数 額	7銘柄			8,610	9,285	311,438	
ポーランド					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	Poland Government Bond		国債証券	5.7500	2,210	2,498	75,295	2022/09/23
	Poland Government Bond		国債証券	1.5000	2,210	2,210	66,637	2020/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	2,640	2,567	77,369	2026/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.0000	2,260	2,277	68,647	2021/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	1.7500	2,230	2,232	67,286	2021/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	2,890	2,774	83,623	2027/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.2500	2,300	2,315	69,793	2022/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	3,000	3,026	91,224	2023/01/25
	Poland Government Bond		国債証券	-	1,000	976	29,434	2020/07/25

2018年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.2500	千ポーランド・ズロチ 1,720	千ポーランド・ズロチ 1,839	千円 55,428	2020/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.7500	1,820	2,019	60,880	2021/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	4.0000	2,530	2,716	81,870	2023/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.7500	1,300	1,263	38,090	2028/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	3.2500	1,850	1,905	57,432	2025/07/25
通貨小計	銘 柄 数 金 額	14銘柄			29,960	30,624	923,014	
ハンガリー	Hungary Government Bond		国 債 証 券	3.5000	千ハンガリー・フォリント 66,300	千ハンガリー・フォリント 69,339	27,680	2020/06/24
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	3.0000	98,500	101,146	40,377	2024/06/26
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	3.0000	128,000	125,516	50,106	2027/10/27
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	2.5000	39,000	40,318	16,095	2021/10/27
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	1.0000	14,000	14,149	5,648	2020/09/23
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	1.7500	140,000	139,358	55,632	2022/10/26
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	2.7500	40,000	38,740	15,465	2026/12/22
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	0.5000	60,000	58,940	23,529	2021/04/21
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	6.7500	50,000	64,380	25,700	2028/10/22
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	7.5000	99,500	113,009	45,113	2020/11/12
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	6.0000	131,800	156,090	62,311	2023/11/24
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	7.0000	125,000	147,340	58,818	2022/06/24
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	5.5000	142,500	166,019	66,275	2025/06/24
通貨小計	銘 柄 数 金 額	13銘柄			1,134,600	1,234,350	492,752	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond		国 債 証 券	9.8750	千ウルグアイ・ペソ 5,300	千ウルグアイ・ペソ 5,220	18,428	2022/06/20
	Uruguay Government International Bond		国 債 証 券	8.5000	2,800	2,394	8,450	2028/03/15
通貨小計	銘 柄 数 金 額	2銘柄			8,100	7,614	26,879	
合 計	銘 柄 数 金 額	206銘柄					10,060,492	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第19期 (決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果を FTSE 世界国債インデックス (除く日本、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
株式組入制限	純資産総額の30%以下

大和投資信託

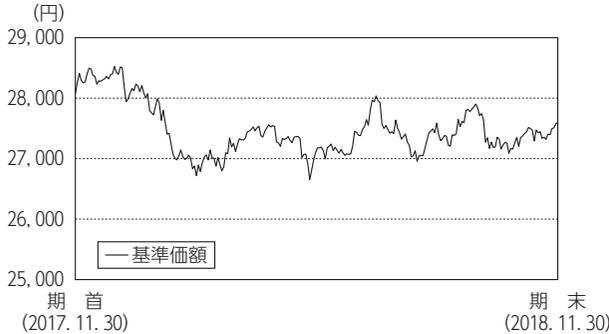
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

《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：28,075円 期末：27,598円 騰落率：△1.7%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、債券市場で金利が上昇（債券価格は下落）したことや、ユーロなどの対円為替レートの下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆ 投資環境について

○ 海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通じて多くの国で上昇しました。当作成期首より、米国の税制改革法が成立したことを背景に市場のリスク選好度が強まったことや、日本およびユーロ圏などの主要先進国において金融政策の正常化観測が高まったことなどから、主要国の国債金利は上昇しました。2018年2月半ば以降は、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことを受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期年限を中心に金利は低下傾向となりました。4月に入ると、米国と中国の貿易摩擦への懸念が後退し、市場のリスク選好度が強まったことなどから、金利は上昇傾向となりました。5月後半以降は、イタリアの政治情勢や米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、金利は低下傾向となりました。その後レンジ内での推移が続きましたが、9月以降はリスク資産の価格が堅調に推移したことなどから、金利は上昇基調となりました。10月以降は株価が下落し市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、金利は低下しました。

○ 為替相場

為替相場は、当作成期を通じてみると、米ドルは対円で上昇したものの、ユーロなど他の通貨は下落しました。当作成期首より円安が進みましたが、2018年に入ると、米国のムニウーン財務長官による米ドル安容認発言などから米ドルが下落しました。また、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。4月以降は、米国の金利が上昇したことやそれまでの米ドル安の反動もあり、米ドルが上昇傾向となりました。一方、イタリアの政治情勢への懸念が高まったことなどがユーロの下落材料となりました。8月にはトルコ情勢への警戒感が高まり、市場のリスク回避姿勢が強まる中で円高傾向となりましたが、9月以降は新興国通貨安への懸念が後退し、市場のリスク回避姿勢が和らいだことを受けて円安傾向となりました。10月以降は、株価が下落し市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから円高傾向となりました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

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

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△1.7%となりました。当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.03%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

年 月 日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率 %	円	騰落率 %		
(期首) 2017年11月30日	28,075	—	28,323	—	98.4	—
12月末	28,426	1.3	28,671	1.2	98.3	—
2018年1月末	27,724	△ 1.3	28,004	△ 1.1	98.0	—
2月末	27,013	△ 3.8	27,350	△ 3.4	97.8	—
3月末	27,193	△ 3.1	27,514	△ 2.9	98.5	—
4月末	27,522	△ 2.0	27,818	△ 1.8	98.4	—
5月末	26,815	△ 4.5	27,092	△ 4.3	98.2	—
6月末	27,212	△ 3.1	27,459	△ 3.0	98.3	—
7月末	27,415	△ 2.4	27,702	△ 2.2	98.2	—
8月末	27,399	△ 2.4	27,753	△ 2.0	98.0	—
9月末	27,855	△ 0.8	28,116	△ 0.7	97.9	—
10月末	27,351	△ 2.6	27,550	△ 2.7	98.2	—
(期末) 2018年11月30日	27,598	△ 1.7	27,840	△ 1.7	98.3	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(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。

外国債券インデックスマザーファンド

《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、ベンチマークに運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)
(その他)	(0)
合 計	7

(注1) 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) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 183,853	千アメリカ・ドル 118,101 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 9,423	千カナダ・ドル 9,529 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 6,631	千オーストラリア・ドル 4,566 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,541	千シンガポール・ドル 1,016 (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 8,326	千イギリス・ポンド 6,837 (—)
	スイス	千スイス・フラン —	千スイス・フラン 2,536 (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 4,310	千デンマーク・クローネ 6,010 (—)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 4,276	千ノルウェー・クローネ 8,171 (—)

		買付額	売付額
外	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 1,623	千スウェーデン・クローネ 8,781 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 43,524	千メキシコ・ペソ 22,262 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,669	千マレーシア・リンギット 3,700 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 18,298	千南アフリカ・ランド 3,003 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 3,382	千ポーランド・ズロチ 4,258 (—)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,491	千ユーロ 1,649 (—)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 2,458	千ユーロ 2,700 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 3,735	千ユーロ 3,496 (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 20,559	千ユーロ 14,751 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 11,984	千ユーロ 11,891 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 16,350	千ユーロ 10,981 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 16,110	千ユーロ 14,050 (—)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,362	千ユーロ 434 (—)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 2,184	千ユーロ 2,322 (—)
ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 76,238	千ユーロ 62,280 (—)	

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2028/8/15	673,948	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2019/5/31	439,644
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2028/2/15	668,168	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2019/6/30	439,566
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2028/5/15	609,932	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.75% 2019/10/25	439,441
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/11/15	590,244	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2019/4/25	408,061
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2021/6/15	555,205	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2018/10/31	406,508
FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 0.75% 2028/5/25	474,251	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2019/9/30	382,988
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2048/8/15	463,906	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2019/7/31	374,938
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2048/5/15	440,654	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.5% 2019/3/1	369,211
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2020/11/15	405,018	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 3.75% 2019/1/4	366,384
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2023/8/31	404,302	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2019/5/15	344,853

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

区 分	当 期			組入比率	未 う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	額 面 金 額	評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額					
アメリカ	千アメリカ・ドル 692,133	千アメリカ・ドル 675,826	千円 76,686,011	% 45.2	% —	% 18.3	% 17.8	% 9.1
カナダ	千カナダ・ドル 37,327	千カナダ・ドル 39,025	3,333,538	2.0	—	0.9	0.5	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 40,248	千オーストラリア・ドル 42,548	3,534,959	2.1	—	1.4	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,643	千シンガポール・ドル 7,826	648,755	0.4	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 62,282	千イギリス・ポンド 75,569	10,958,405	6.5	—	4.8	1.1	0.5
デンマーク	千デンマーク・クローネ 47,272	千デンマーク・クローネ 58,105	1,005,801	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 28,882	千ノルウェー・クローネ 29,783	395,522	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 44,065	千スウェーデン・クローネ 49,622	620,773	0.4	—	0.2	0.2	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 247,035	千メキシコ・ペソ 230,626	1,293,812	0.8	—	0.4	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 27,913	千マレーシア・リンギット 27,722	751,557	0.4	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 133,945	千南アフリカ・ランド 121,117	1,005,273	0.6	—	0.5	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 31,265	千ポーランド・ズロチ 32,086	967,089	0.6	—	0.2	0.3	0.1

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	額 面 金 額	当 期			末				
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
		千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
ユ	アイルランド	8,673	9,523	1,230,284	0.7	—	0.5	0.1	0.1
	オランダ	22,798	26,808	3,463,419	2.0	—	1.3	0.6	0.2
	ベルギー	26,571	31,303	4,044,133	2.4	—	1.8	0.5	0.1
イ	フランス	113,965	131,955	17,047,346	10.1	—	6.3	2.6	1.2
	ドイツ	76,121	89,090	11,509,642	6.8	—	4.0	1.9	0.9
	スペイン	66,328	76,226	9,847,645	5.8	—	3.8	1.3	0.7
ロ	イタリア	109,311	114,286	14,764,662	8.7	—	4.9	2.8	1.0
	フィンランド	7,817	8,443	1,090,767	0.6	—	0.4	0.2	0.1
	オーストリア	16,583	19,236	2,485,214	1.5	—	0.9	0.4	0.1
	小計	448,167	506,874	65,483,117	38.6	—	23.9	10.3	4.5
合 計	—	—	166,684,616	98.3	—	51.6	31.5	15.3	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,044	458,909	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,322	490,449	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,103	352,180	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,845	322,868	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,492	509,753	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,146	470,505	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,570	291,621	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,487	282,253	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,102	238,611	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,141	356,509	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,370	268,994	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,433	276,085	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	872	99,002	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,022	342,944	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,329	150,885	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,861	211,226	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,344	152,552	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,201	476,703	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,931	219,137	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,134	128,771	2020/03/31
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,466	506,770	2023/05/15	

区 分	銘 柄	種 類	当 期		末			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,417	160,874	2020/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,410	273,533	2020/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,100	238,317	2020/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,789	316,567	2020/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,494	509,985	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	1,969	223,477	2020/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,857	210,780	2020/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,298	260,784	2020/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,994	566,701	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,461	279,287	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	1,988	225,610	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,194	589,388	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,623	184,167	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,703	193,266	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,784	315,969	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,912	3,834	435,118	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,375	269,579	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,677	303,834	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,425	388,645	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	704	79,980	2020/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,413	273,830	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	751	85,242	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,023	116,154	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	787	89,334	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	880	99,927	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	843	95,748	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	877	99,533	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	563	63,956	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,258	142,797	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	991	1,221	138,618	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,626	1,919	217,755	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	547	687	77,987	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	641	72,761	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	616	70,001	2038/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,249	1,301	147,669	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,292	146,606	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,261	143,121	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,417	160,820	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,710	2,068	234,689	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,730	196,388	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,740	197,455	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,691	191,975	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,162	245,345	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,601	181,675	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,466	166,455	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,409	159,929	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,576	178,837	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,284	145,799	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,731	1,570	178,200	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,630	2,381	270,192	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,326	2,249	255,268	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,798	3,513	398,667	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,064	3,220	365,379	2043/08/15	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未 評 価 額			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額			
					千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	3,841	435,856	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	3,802	431,483	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,657	3,691	418,847	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,791	316,772	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,162	5,019	569,530	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,329	3,216	364,932	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,272	144,388	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,555	403,451	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,155	358,023	2019/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,112	239,758	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,706	647,548	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,488	395,857	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,807	318,570	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,272	484,755	2019/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,101	351,916	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,177	247,106	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,894	441,933	2020/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,328	264,246	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,439	617,237	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,218	365,206	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,740	310,941	2020/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,747	198,323	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,740	310,966	2020/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,791	316,711	2022/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,512	625,462	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	3,616	410,405	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,555	289,991	2020/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,519	285,847	2022/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,734	310,267	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	2,955	335,338	2020/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	2,945	334,271	2020/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,750	312,144	2022/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,074	348,891	2020/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,114	239,890	2022/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,413	614,285	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,286	372,864	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,359	267,765	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,798	317,523	2020/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,372	269,233	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,803	318,076	2020/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,582	633,408	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,032	344,125	2020/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,494	396,559	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,464	279,688	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,024	343,205	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,084	690,421	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	2,978	338,003	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,492	3,393	385,027	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,031	343,980	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	4,902	556,315	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,449	277,903	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	2,917	331,052	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,187	361,684	2021/02/28	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					未		
					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	1.5000	4,262	4,029	457,233	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,897	328,792	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,005	227,534	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,029	4,578	519,505	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,367	268,660	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	1,963	222,845	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	2,910	330,267	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,605	295,692	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,369	268,847	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,395	271,840	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,808	318,654	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,035	571,342	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	2,800	317,748	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,534	401,009	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,538	401,534	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,584	293,239	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,240	254,242	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,335	265,055	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,902	329,370	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,115	580,442	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,867	325,357	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,357	267,451	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,350	3,073	348,733	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,377	156,281	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,403	272,693	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,325	263,858	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,440	1,419	161,117	2019/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,951	221,389	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,425	275,275	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,477	167,617	2020/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,340	5,049	572,979	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,922	331,564	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,405	273,005	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	3,333	378,208	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,094	237,676	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,919	331,322	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,214	251,314	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,871	212,400	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,550	2,453	278,451	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,811	318,983	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	835	94,787	2020/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,435	616,710	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	3,287	373,066	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	2,905	329,717	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,865	325,169	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	3,926	445,560	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,891	328,042	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,909	216,621	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,700	2,647	300,370	2020/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,888	327,777	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,290	259,858	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,000	1,958	222,249	2020/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,554	630,295	2027/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,300	1,272	144,335	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,801	317,904	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,877	326,551	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,800	3,392	384,967	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,060	347,272	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,892	214,705	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,500	2,438	276,682	2020/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,411	273,613	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,257	369,579	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,000	978	111,017	2020/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,421	274,719	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,166	586,296	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,100	2,764	313,721	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,374	382,871	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,600	3,526	400,207	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,800	2,772	314,599	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,963	222,816	2020/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,060	347,243	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,000	990	112,410	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,300	1,251	142,001	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,261	256,606	2021/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,280	258,726	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,433	389,634	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,300	6,158	698,826	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,800	1,788	202,944	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,469	280,228	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,269	371,024	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,538	288,015	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,673	303,326	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,600	3,376	383,181	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,200	3,168	359,512	2021/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,500	1,489	168,999	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,857	324,278	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,849	323,278	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,500	2,474	280,758	2021/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,900	3,748	425,384	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	5,500	5,428	615,940	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,000	2,985	338,799	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,200	1,193	135,370	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,489	282,432	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,893	214,868	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,400	1,393	158,149	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,892	214,784	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,489	282,455	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	5,000	4,975	564,530	2021/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,475	280,838	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,300	3,284	372,649	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,966	336,631	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,282	372,503	2021/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,289	373,293	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,487	282,299	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,000	5,918	671,560	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,200	3,939	447,007	2048/08/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,494	283,042	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,490	282,588	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,491	282,753	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,583	406,637	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,557	403,671	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	3,491	396,227	2021/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,300	3,295	373,994	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,509	284,738	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,001	340,566	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,002	340,740	2021/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,509	284,738	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,300	3,303	374,814	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,001	340,621	2023/10/31
通貨小計	銘柄数 金 額	246銘柄		692,133	675,826	76,686,011	
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	425	468	40,035	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	555	47,415	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,294	110,551	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,593	136,153	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,540	131,609	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,732	147,996	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,876	1,913	163,441	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	979	83,706	2021/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,781	152,135	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	1,892	161,646	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,213	103,692	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,422	121,538	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,197	1,281	109,466	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,154	98,640	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,706	145,744	2020/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,831	1,786	152,609	2020/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,068	91,264	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,197	102,317	2021/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,480	1,422	121,515	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,116	95,378	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	794	67,878	2022/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,338	114,327	2022/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	500	496	42,404	2019/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,168	99,844	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,568	134,006	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,600	1,584	135,362	2020/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	696	59,474	2020/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	593	50,706	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	272	23,235	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	300	297	25,449	2020/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	298	25,466	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,200	2,192	187,256	2020/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	600	600	51,267	2024/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	33銘柄		37,327	39,025	3,333,538	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,634	218,868	2021/05/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,489	206,862	2020/04/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,434	202,265	2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,351	195,359	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,021	251,027	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,526	209,933	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,074	2,195	182,363	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,517	209,179	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,358	1,637	136,013	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,189	264,957	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,240	103,048	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	547	45,459	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,184	181,472	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	712	738	61,319	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,522	2,557	212,500	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,078	2,017	167,574	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,132	1,105	91,835	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,795	149,198	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,227	185,099	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	750	752	62,504	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,517	126,111	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	600	591	49,133	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	290	275	22,868	2041/05/21
通貨小計	銘柄数 金 額	23銘柄			40,248	42,548	3,534,959	
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	710	58,915	2020/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	842	69,814	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	454	37,692	2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	650	53,912	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	372	30,897	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	497	41,272	2021/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	401	33,255	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	491	504	41,831	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	368	401	33,295	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	130	10,791	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	528	43,825	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	223	18,567	2020/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	568	565	46,879	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	247	20,515	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	460	450	37,336	2021/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	198	16,428	2022/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	150	141	11,705	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	197	16,377	2023/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	300	306	25,441	2028/05/01
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄			7,643	7,826	648,755	
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,327	337,466	2020/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,821	1,934	280,567	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,517	365,012	2021/01/22

区 分		当 期				末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千円	千円	千円			
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,582	1,871	271,410	2065/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,505	218,292	2026/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,300	1,285	186,407	2022/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,210	1,077	156,178	2047/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800	782	113,537	2037/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,330	1,264	183,432	2057/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,110	2,112	306,396	2027/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	1,500	1,488	215,861	2023/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,200	1,231	178,565	2028/10/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	930	844	122,452	2071/10/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	200	200	29,006	2024/04/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	70	65	9,552	2049/01/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,302	188,827	2021/06/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,368	198,467	2028/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,772	256,960	2032/06/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,827	265,012	2025/03/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,766	401,238	2036/03/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,154	312,440	2038/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,811	262,622	2020/03/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,744	398,041	2055/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,082	447,051	2046/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,552	225,171	2027/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,596	2,367	343,242	2042/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,480	2,015	292,262	2030/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,316	335,935	2049/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,743	252,774	2039/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,524	221,133	2022/03/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,620	2,238	324,583	2034/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	1,980	287,130	2060/01/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	1,889	274,041	2020/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,227	323,034	2040/12/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	803	868	125,954	2021/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	1,945	282,179	2052/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,317	336,114	2022/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,966	2,445	354,651	2044/01/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,063	299,210	2023/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,441	354,025	2068/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,392	1,529	221,786	2024/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	2,760	400,370	2045/01/22		
通貨小計	銘柄数	42銘柄							
	金額			62,282	75,569	10,958,405			
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	11,512	19,801	342,767	2039/11/15		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	8,985	155,547	2019/11/15		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	5,550	6,129	106,103	2021/11/15		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,261	91,077	2023/11/15		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,363	9,363	162,085	2025/11/15		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	6,900	7,037	121,811	2027/11/15		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,525	26,409	2020/11/15		
通貨小計	銘柄数	7銘柄							
	金額			47,272	58,105	1,005,801			

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,436	98,759	2021/05/25	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,204	5,333	70,833	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,403	58,476	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,422	45,457	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,300	43,824	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,449	45,808	2027/02/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,400	2,436	32,362	2028/04/26	
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金 額			28,882	29,783	395,522		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	9,095	10,092	126,254	2020/12/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,884	73,616	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,575	119,786	2022/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,564	94,628	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,095	5,862	73,342	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,983	74,855	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,550	4,659	58,288	2028/05/12	
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金 額			44,065	49,622	620,773		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	21,447	20,719	116,238	2019/12/11	
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	13,290	10,965	61,514	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	7,000	5,847	32,803	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	9,615	53,944	2021/12/09	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	13,133	12,654	70,989	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	23,149	129,868	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	22,668	20,513	115,081	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,141	51,283	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	8,398	47,114	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	8,687	48,734	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	18,822	105,593	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	26,534	148,855	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	11,428	64,113	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	24,599	22,906	128,503	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	18,654	15,315	85,918	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	5,927	33,253	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金 額			247,035	230,626	1,293,812		
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	544	14,768	2027/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	794	21,541	2028/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,189	32,251	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,940	52,599	2021/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,538	41,712	2026/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,270	34,445	2031/06/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	863	23,407	2022/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	714	19,370	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	593	16,095	2032/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,044	1,043	28,295	2020/03/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	983	26,660	2023/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	927	854	23,176	2033/04/15	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		

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	
					当 期	末		
					%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	586	567	15,374	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	659	17,886	2020/07/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	598	16,217	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,064	28,850	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	865	23,460	2021/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	730	19,810	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	701	19,017	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,159	31,436	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	775	21,031	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	697	18,919	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	901	24,441	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	638	17,303	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	351	9,522	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	502	13,612	2022/03/10
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	751	20,369	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	590	576	15,631	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050	1,049	28,439	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,188	32,211	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	500	497	13,490	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	700	707	19,184	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	400	406	11,018	2038/06/08
通貨小計	銘柄数	33銘柄						
	金額				27,913	27,722	751,557	
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	5,768	5,832	48,405	2020/01/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	16,434	17,894	148,528	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,612	8,352	69,328	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,581	38,028	2021/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,265	52,005	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,999	7,441	61,766	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	5,539	5,450	45,240	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	17,652	15,874	131,756	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	11,021	9,873	81,949	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	11,862	10,770	89,396	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	11,944	10,746	89,197	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	8,243	7,454	61,874	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	6,166	5,768	47,874	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	5,179	4,809	39,919	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				133,945	121,117	1,005,273	
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,610	78,668	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,478	2,479	74,718	2020/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,283	98,968	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,143	64,607	2021/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	3,054	92,058	2021/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,370	2,275	68,576	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,335	70,400	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,150	2,169	65,377	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	300	292	8,830	2020/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,020	30,743	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,412	72,701	2020/10/25

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,203	36,260	2021/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,225	2,388	72,000	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,749	52,741	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,668	80,436	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄			31,265	32,086	967,089	
ユーロ (アイルランド)		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	千ユーロ 1,131	千ユーロ 1,480	191,254	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	844	109,072	2020/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	588	76,088	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	708	91,583	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	864	111,715	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	532	68,778	2022/03/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	781	815	105,307	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,104	142,690	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	350	356	46,018	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	50	50	6,473	2022/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	499	64,543	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	700	689	89,056	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	200	202	26,174	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	735	785	101,526	2020/04/18
国小計	銘柄数 金 額	14銘柄			8,673	9,523	1,230,284	
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 726	93,801	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,815	234,518	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,075	268,120	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	925	119,556	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,223	158,076	2020/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,349	2,138	276,253	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,609	207,935	2021/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,576	203,706	2022/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,446	186,818	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,513	195,493	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,249	1,767	228,352	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,689	218,264	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,388	179,415	2020/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,305	168,645	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,368	176,761	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,216	157,178	2022/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,200	1,241	160,365	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	804	103,959	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	950	976	126,195	2028/07/15
国小計	銘柄数 金 額	19銘柄			22,798	26,808	3,463,419	
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	千ユーロ 1,399	千ユーロ 1,446	186,829	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	918	118,598	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	594	76,829	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,334	172,359	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	944	906	117,055	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	340	346	44,747	2066/06/22

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	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	490	495	63,988	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,421	183,580	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	650	662	85,537	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	460	489	63,220	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	298	38,568	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	940	943	121,917	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	550	553	71,495	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,449	316,447	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,627	339,459	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	1,004	129,827	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,873	242,047	2020/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,511	324,476	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,638	211,714	2021/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,297	167,602	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,544	199,581	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	926	119,690	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,484	191,728	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,081	139,733	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,712	221,293	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	741	95,804	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	26銘柄			26,571	31,303	4,044,133	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,362	176,040	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	4,223	545,595	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,023	4,491	580,285	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,558	588,968	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,209	3,414	441,075	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,364	2,194	283,558	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,558	459,733	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,624	3,874	500,522	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,489	579,992	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,084	4,926	636,399	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,573	461,678	2020/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	1,923	248,485	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,893	503,036	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,294	425,647	2020/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	3,929	507,646	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	4,043	522,355	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,199	3,824	494,033	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	2,957	382,138	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,238	3,064	395,887	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,634	469,498	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,465	447,729	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,299	426,284	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,399	3,736	482,778	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,346	303,170	2019/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,292	3,361	434,271	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,070	3,096	400,095	2020/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,601	2,735	353,419	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,227	287,790	2020/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,920	4,186	540,851	2031/05/25

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,773	358,292	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,269	2,266	292,865	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	887	857	110,838	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,770	2,801	361,943	2021/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,800	2,766	357,445	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,021	261,098	2022/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,120	1,196	154,623	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	705	91,111	2020/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,607	336,798	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,950	2,109	272,517	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,415	312,058	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,100	4,147	535,817	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	313,271	2021/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	950	966	124,823	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,100	1,106	142,948	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,098	141,921	2024/03/25	
国 小 計	銘柄数 金 額	45銘柄		113,965	131,955	17,047,346		
ユ ー ロ (ド イ ツ)				千ユーロ	千ユーロ			
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,298	167,769	2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,367	2,111	272,814	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,029	262,170	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,250	1,783	230,382	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,561	201,771	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,314	299,041	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	2,864	370,018	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,220	416,073	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,029	262,222	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,494	322,257	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,165	279,794	2020/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,041	263,689	2020/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,474	2,224	287,391	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,518	196,168	2020/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,487	321,310	2021/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,841	237,866	2021/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,525	197,069	2021/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	3,027	391,099	2022/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,399	310,019	2022/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,038	2,768	357,617	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,764	227,977	2022/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,522	196,664	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,967	254,198	2023/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,774	229,244	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,724	222,725	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,409	3,313	428,028	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,743	225,203	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,645	212,621	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,277	294,216	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,285	295,268	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,244	290,012	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,834	366,192	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,615	208,742	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,361	305,112	2027/08/15	

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	853	110,257	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,226	158,509	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,192	154,024	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,006	130,085	2019/12/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	705	91,202	2020/03/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	808	104,415	2020/06/12
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	350	353	45,731	2020/09/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,731	1,747	225,709	2020/04/17
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,472	190,209	2020/10/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,600	206,756	2021/04/09
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,421	183,673	2021/10/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	360	365	47,272	2022/04/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,133	275,675	2022/10/07
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	507	65,576	2023/04/14
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	911	117,783	2023/10/13
国 小 計	銘柄数	49銘柄						
	金 額				76,121	89,090	11,509,642	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (スペイン)		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,352	3,342	431,762	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,826	236,011	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,098	271,118	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,932	249,598	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,650	1,688	218,160	2020/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,837	237,449	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,785	230,626	2021/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,452	1,529	197,550	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	850	950	122,760	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,730	1,745	225,483	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	1,380	1,393	180,089	2022/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,828	236,183	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,450	1,505	194,477	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,800	1,812	234,172	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,300	1,304	168,563	2021/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,000	1,009	130,426	2022/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,100	2,093	270,428	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	650	650	84,002	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	700	697	90,067	2023/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	700	693	89,618	2028/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	200	200	25,847	2021/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,902	374,943	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,151	277,948	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,308	1,867	241,209	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,041	263,742	2024/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,850	239,115	2019/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,873	2,618	338,232	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,229	288,061	2020/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,716	350,891	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,842	238,077	2020/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,854	368,776	2021/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,649	342,239	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,339	302,285	2022/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,158	408,039	2023/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,902	245,759	2023/10/31

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 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	5.1500	1,770	2,362	305,239	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,499	2,237	289,081	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,297	296,823	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,338	302,174	2024/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,939	250,605	2020/01/31
国 小 計	銘柄数	40銘柄						
	金 額				66,328	76,226	9,847,645	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,446	186,831	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,447	187,062	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,022	390,422	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,806	233,359	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,454	187,958	2019/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,323	171,039	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,604	207,249	2022/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,568	202,680	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,452	187,635	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,512	195,442	2020/05/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,515	195,747	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,475	190,666	2022/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	770	99,593	2020/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,213	156,772	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,248	290,502	2023/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,184	153,208	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,641	212,118	2021/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	778	100,513	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,568	1,396	180,384	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	649	83,947	2023/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,315	169,971	2021/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	648	531	68,655	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,200	1,065	137,601	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	2,010	1,894	244,717	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,257	162,476	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,250	1,225	158,385	2022/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	970	965	124,791	2020/06/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,450	1,365	176,425	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,300	1,206	155,834	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	674	87,130	2022/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,200	1,125	145,348	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	1,900	1,877	242,571	2020/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	800	719	92,959	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,382	178,619	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	900	857	110,763	2023/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,204	155,638	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	500	486	62,887	2021/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	550	532	68,799	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	400	402	52,008	2023/10/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	600	588	76,014	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	200	203	26,335	2021/10/15
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,454	2,898	374,503	2029/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,595	464,546	2031/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,655	2,057	265,780	2033/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,008	259,493	2020/02/01

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	2,928	378,378	2034/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	2,943	380,260	2037/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	2,893	373,790	2021/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,034	2,384	308,063	2039/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,499	322,967	2023/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,398	309,863	2025/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,387	308,490	2040/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,675	345,622	2020/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,333	301,494	2020/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,295	296,500	2026/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,266	292,854	2021/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,474	319,680	2021/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,212	285,847	2022/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,864	240,920	2022/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,153	278,149	2022/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,750	355,394	2028/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,076	268,307	2023/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,413	1,620	209,324	2044/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,408	311,157	2024/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,828	236,273	2021/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,334	301,644	2024/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	1,975	255,257	2030/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,619	209,203	2021/12/15
国 小 計	銘柄数	68銘柄						
	金 額			109,311	114,286	14,764,662		
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (フィンランド)		Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	439	56,744	2020/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	411	53,128	2031/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	292	37,724	2025/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	417	53,922	2026/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	200	200	25,959	2023/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	770	778	100,581	2022/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	300	38,831	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	378	48,921	2034/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	495	63,971	2028/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	835	107,892	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	666	86,097	2020/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	502	64,922	2021/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	469	60,597	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	656	84,760	2022/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	478	61,859	2023/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	534	69,111	2042/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	586	75,742	2024/04/15
国 小 計	銘柄数	17銘柄						
	金 額			7,817	8,443	1,090,767		
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (オーストリア)		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	932	120,413	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,158	149,676	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	734	749	96,812	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	150	137	17,808	2086/11/02

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	905	116,991	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	580	581	75,185	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	340	381	49,263	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	404	52,223	2022/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,000	1,017	131,406	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,230	158,995	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,339	173,024	2020/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,486	192,029	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,610	208,054	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,165	150,555	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	906	117,048	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,000	129,259	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	546	70,610	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	872	112,710	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,047	135,308	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	743	96,031	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,020	131,801	2024/10/21
国 小 計	銘 柄 数	21銘柄					
	金 額			16,583	19,236	2,485,214	
通 貨 小 計	銘 柄 数	299銘柄					
	金 額			448,167	506,874	65,483,117	
合 計	銘 柄 数	761銘柄					
	金 額					166,684,616	

(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

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	166,684,616	98.1
コール・ローン等、その他	3,182,003	1.9
投資信託財産総額	169,866,619	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1シンガポール・ドル=82.89円、1イギリス・ポンド =145.01円、1デンマーク・クローネ=17.31円、1ノルウェー・クローネ=13.28円、1スウェーデン・クローネ=12.51円、1メキシコ・ペソ=5.61円、1マレーシア・リンギット=27.11円、1南アフリカ・ランド=8.30円、1ポーランド・ズロチ=30.14円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (168,411,756千円) の投資信託財産総額 (169,866,619千円) 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

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	171,051,196,579円
コール・ローン等	1,814,914,131
公社債(評価額)	166,684,616,502
未収入金	1,251,007,303
未収利息	1,269,292,926
前払費用	31,365,717
(B)負債	1,471,443,113
未払金	1,355,746,060
未払解約金	115,688,147
その他未払費用	8,906
(C)純資産総額(A-B)	169,579,753,466
元本	61,445,933,589
次期繰越損益金	108,133,819,877
(D)受益権総口数	61,445,933,589口
1万口当り基準価額(C/D)	27,598円

*期首における元本額は59,383,778,765円、当作成期間中における追加設定元本額は6,447,535,619円、同解約元本額は4,385,380,795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 694, 267, 908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) 26,063,629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) 173,213,023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) 53,368,772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) 565,112,790円、外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) 2,177,730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) 365,893,917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) 1,077,780,230円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) 706,169,298円、D-1's 外国債券インデックス731,384円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 27,109円、iFree 外国債券インデックス496,757,292円、iFree 8資産 バランス484,130,513円、iFree 年金 バランス4,278,927円、DCダイワ外国債券インデックス42,443,714,064円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 739,083,378円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 367,446,516円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 237,136,801円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 329,247,490円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) 263,447,011円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 82,424,940円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 10,493,771円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 18,731,042円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,851,074円、ダイワつみたてインデックス外国債券1,192,484円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 249,101,467円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 154,628,203円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 5,694,073,062円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 17,320,918円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 8,186,659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) 328,670,549円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券142,930,521円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド28,480,694円、ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用) 27,731,702円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,534,667,082円、ダイワライフスタイル2 5 35,273,760円、ダイワライフスタイル5 0 62,560,835円、ダイワライフスタイル7 5 17,567,044円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は27,598円です。

■損益の状況

当期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,056,186,163円
受取利息	4,058,192,654
支払利息	△ 2,006,491
(B) 有価証券売買損益	△ 6,766,335,398
売買益	1,450,741,134
売買損	△ 8,217,076,532
(C) その他費用	△ 42,438,987
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,752,588,222
(E) 前期繰越損益金	107,337,283,080
(F) 解約差損益金	△ 7,680,292,049
(G) 追加信託差損益金	11,229,417,068
(H) 合計(D+E+F+G)	108,133,819,877
次期繰越損益金(H)	108,133,819,877

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

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

《お知らせ》

■運用において参照している指数の名称変更について

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第8期（決算日 2018年7月5日）

（計算期間 2017年7月6日～2018年7月5日）

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの第8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JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットツ グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
運用方法	①主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットツ グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。 ②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

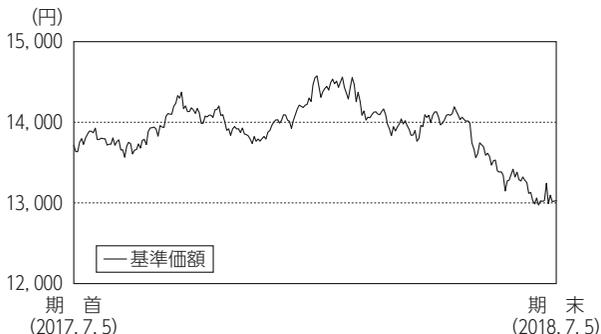
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



《運用経過》

【基準価額・騰落率】

期首：13,715円 期末：13,029円 騰落率：△5.0%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の利息収入はプラス要因となったものの、債券価格の下落（金利は上昇）および新興国通貨の対円為替レート下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券市況は、個別国要因でまちまちの展開となりました。米国の利上げを受けて、米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことが、新興国債券の金利上昇の材料となりました。国別では、財政難が懸念されたアルゼンチン、外国投資家による国債保有比率が高いインドネシア、高インフレ率と中央銀行の独立性が脅かされる懸念が高まったトルコ、NAFTA（北米自由貿易協定）再交渉が停滞しているメキシコの国債が売られ、金利は上昇しました。南アフリカは政権交代が好感されたことから国債が買われ、金利は低下しました。

○為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で下落しました。米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことに加えて、米ドル円の円高傾向も、新興国通貨の下落要因になりました。通貨別では、財政難が懸念されたアルゼンチン・ペソ、資金流出懸念が高まったインドネシア・ルピア、高インフレ率と中央銀行の独立性が脅かされる懸念が高まったトルコ・リラ、NAFTA再交渉が停滞しているメキシコ・ペソ、年金改革の頓挫に加えてトラック運転手によるストライキの影響が経済に幅広く悪影響を与えたブラジル・レアル、米国による経済制裁が強化されたロシア・ルーブルなどが下落しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は△4.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.0%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金や売買に伴う費用などが主な要因です。

《今後の運用方針》

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

年 月 日	基準価額		JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）（ベンチマーク）		公社債組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2017年 7月 5日	円	%	円	%	%
	13,715	—	14,485	—	97.1
7月末	13,717	0.0	14,506	0.1	95.9
8月末	13,930	1.6	14,743	1.8	96.6
9月末	14,134	3.1	14,950	3.2	96.9
10月末	13,837	0.9	14,673	1.3	96.6
11月末	13,897	1.3	14,755	1.9	96.5
12月末	14,257	4.0	15,141	4.5	93.4
2018年 1月末	14,288	4.2	15,165	4.7	96.2
2月末	14,094	2.8	14,962	3.3	95.7
3月末	14,060	2.5	14,906	2.9	96.4
4月末	14,012	2.2	14,873	2.7	96.2
5月末	13,272	△ 3.2	14,075	△ 2.8	96.7
6月末	12,991	△ 5.3	13,827	△ 4.5	95.9
(期末) 2018年 7月 5日	13,029	△ 5.0	13,861	△ 4.3	96.8

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）は、JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（米ドルベース）は、信頼性が高いとみならず情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	24 (23)
(その他)	(1)
合 計	24

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

		買付額	売付額
外	トルコ	千トルコ・リラ 12,593	千トルコ・リラ 2,125 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 87,209	千メキシコ・ペソ 7,510 (—)
	フィリピン	千フィリピン・ペソ 5,000	千フィリピン・ペソ — (—)
	アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 12,765	千アルゼンチン・ペソ — (—)
	チリ	千チリ・ペソ 1,465,129	千チリ・ペソ 706,251 (—)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 8,819,017	千コロンビア・ペソ 847,944 (—)
国	インドネシア	千インドネシア・ルピア 54,665,440	千インドネシア・ルピア 5,441,540 (—)
	ブラジル	千ブラジル・レアル 21,690	千ブラジル・レアル 7,313 (—)
	チェコ	千チェコ・コルナ 44,230	千チェコ・コルナ 990 (—)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 5,052	千ルーマニア・レイ 1,630 (—)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 233,406	千ロシア・ルーブル 31,040 (—)

		買付額	売付額
外	マレーシア	千マレーシア・リンギット 12,442	千マレーシア・リンギット 7,462 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 39,957	千南アフリカ・ランド 3,230 (—)
	タイ	千タイ・バーツ 117,256	千タイ・バーツ 26,835 (—)
	ペルー	千ペルー・ソル 4,169	千ペルー・ソル — (—)
国	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 13,057	千ポーランド・ズロチ 3,622 (—)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 509,503	千ハンガリー・フォリント 88,042 (—)
	ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 5,373	千ウルグアイ・ペソ — (—)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1	174,075	Chile Government International Bond (チリ) 5.5% 2020/8/5	112,427
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2021/7/1	118,736	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1	75,625
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	79,801	Thailand Government Bond (タイ) 3.875% 2019/6/13	63,441
Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2022/6/9	78,228	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/4/1	58,048
Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7.7% 2033/3/23	74,288	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/10/1	41,060
Colombian TES (コロンビア) 7.5% 2026/8/26	72,745	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/7/1	40,131
BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 5% 2035/3/1	70,798	Mexican Bonos (メキシコ) 8.5% 2018/12/13	40,109
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	69,410	Poland Government Bond (ポーランド) 2018/10/25	38,774
Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2021/6/10	68,353	Poland Government Bond (ポーランド) 3.25% 2019/7/25	37,452
BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 4.5% 2026/3/1	65,818	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7.875% 2019/4/15	31,229

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

作 成 期	当 期				末				
	区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
				千円	%	%	%	%	%
トルコ	千トルコ・リラ 25,910	千トルコ・リラ 19,824		468,052	5.1	—	2.0	2.5	0.6
メキシコ	千メキシコ・ペソ 163,040	千メキシコ・ペソ 164,808		936,112	10.2	—	5.8	2.8	1.6
フィリピン	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 14,947		30,941	0.3	—	—	0.3	—
アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 21,900	千アルゼンチン・ペソ 19,795		77,795	0.8	0.8	0.7	0.2	—
チリ	千チリ・ペソ 1,330,000	千チリ・ペソ 1,368,734		231,726	2.5	—	1.8	0.7	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 17,515,000	千コロンビア・ペソ 18,749,500		712,481	7.7	—	5.0	2.2	0.5
インドネシア	千インドネシア・ルピア 107,949,000	千インドネシア・ルピア 107,170,158		825,210	9.0	—	7.0	1.9	—
ブラジル	千ブラジル・レアル 36,400	千ブラジル・レアル 32,046		904,358	9.8	—	2.1	4.0	3.8
チェコ	千チェコ・コルナ 73,900	千チェコ・コルナ 77,219		382,238	4.2	—	2.3	1.5	0.4
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 8,210	千ルーマニア・レイ 8,184		226,137	2.5	—	0.8	1.2	0.4
ロシア	千ロシア・ルーブル 388,310	千ロシア・ルーブル 389,810		678,270	7.4	—	4.6	2.2	0.6
マレーシア	千マレーシア・リンギット 19,040	千マレーシア・リンギット 18,948		517,475	5.6	—	3.0	1.3	1.3
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 100,940	千南アフリカ・ランド 92,765		747,686	8.1	—	6.9	0.8	0.4
タイ	千タイ・バーツ 205,160	千タイ・バーツ 215,352		717,123	7.8	—	4.0	3.1	0.7

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分	当 期				未 期			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ペルー	千ペルー・ソル 7,210	千ペルー・ソル 7,758	千円 260,309	% 2.8	% —	% 2.7	% 0.1	% —
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 26,390	千ポーランド・ズロチ 26,948	791,753	8.6	—	3.1	4.5	1.0
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 912,600	千ハンガリー・フォリント 961,505	380,563	4.1	—	2.0	1.8	0.4
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 5,100	千ウルグアイ・ペソ 4,681	16,478	0.2	—	0.1	0.1	—
合計	—	—	8,904,714	96.8	0.8	53.9	31.1	11.8

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期		未 期		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	% 10.5000	千トルコ・リラ 680	千トルコ・リラ 607	千円 14,344	2020/01/15	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	1,660	1,300	30,715	2022/01/12	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	583	13,765	2022/09/14	
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	1,280	862	20,359	2023/03/08	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	1,390	987	23,317	2023/09/27	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	511	12,065	2024/03/20	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,138	26,881	2024/07/24	
	Turkey Government Bond	国債証券	7.4000	2,070	1,761	41,590	2020/02/05	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	1,490	962	22,715	2025/03/12	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.4000	1,180	999	23,608	2020/07/08	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,610	1,353	31,945	2021/02/17	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	1,865	44,039	2026/02/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.2000	1,010	790	18,659	2021/09/22	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	1,400	1,141	26,955	2022/03/02	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	1,470	1,072	25,318	2027/02/24	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,516	35,815	2022/08/17	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	1,700	1,198	28,305	2027/08/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,171	27,649	2023/01/18	
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		25,910	19,824	468,052		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	千メキシコ・ペソ 9,800	千メキシコ・ペソ 9,432	53,573	2019/12/11	
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	10,400	9,267	52,637	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,500	4,619	26,237	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	5,000	4,928	27,991	2021/12/09	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,250	4,309	24,475	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	18,350	20,560	116,785	2024/12/05	

区 分		当 期				未		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	10,230	10,140	57,599	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,026	51,269	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	7,230	7,681	43,632	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	4,100	4,409	25,045	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	16,990	17,088	97,062	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	21,950	21,253	120,721	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,950	7,994	45,410	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	19,450	18,656	105,969	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	11,320	11,297	64,170	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,130	4,142	23,529	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		163,040	164,808	936,112		
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	4.9500	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 14,947	30,941	2021/01/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄		15,000	14,947	30,941		
アルゼンチン	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	18.2000	千アルゼンチン・ペソ 4,700	千アルゼンチン・ペソ 4,110	16,152	2021/10/03	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	9,400	8,470	33,289	2023/10/17	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	7,800	7,214	28,352	2026/10/17	
通貨小計	銘柄数 金 額	3銘柄		21,900	19,795	77,795		
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 325,000	千チリ・ペソ 331,899	56,190	2021/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	370,000	369,315	62,525	2026/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	325,000	324,662	54,965	2035/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	260,000	290,901	49,249	2043/01/01	
	Chile Government International Bond	国債証券	5.5000	50,000	51,956	8,796	2020/08/05	
通貨小計	銘柄数 金 額	5銘柄		1,330,000	1,368,734	231,726		
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ 90,000	千コロンビア・ペソ 113,134	4,299	2027/06/28	
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	100,386	3,814	2021/04/14	
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	42,982	1,633	2023/03/21	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	1,235,000	1,266,418	48,123	2019/09/11	
	Colombian TES	国債証券	11.0000	1,865,000	2,080,892	79,073	2020/07/24	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	2,935,000	3,074,588	116,834	2022/05/04	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	2,650,000	3,165,902	120,304	2024/07/24	
	Colombian TES	国債証券	6.0000	1,290,000	1,242,695	47,222	2028/04/28	
	Colombian TES	国債証券	7.5000	3,310,000	3,529,585	134,124	2026/08/26	
	Colombian TES	国債証券	7.7500	1,700,000	1,838,635	69,868	2030/09/18	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	1,800,000	1,798,110	68,328	2032/06/30	
	Colombian TES	国債証券	6.2500	500,000	496,170	18,854	2025/11/26	
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		17,515,000	18,749,500	712,481		

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

		当 期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	5,750,000	5,672,605	43,679	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000	4,174,960	32,147	2031/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	2,800,000	2,619,680	20,171	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	4,300,000	4,031,078	31,039	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000	2,580,648	19,870	2020/11/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	1,600,000	1,819,056	14,006	2021/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,700,000	1,981,571	15,258	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,533,988	19,511	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	7,210,000	7,342,808	56,539	2021/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,251,615	25,037	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000	10,478,782	80,686	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	4,715,610	36,310	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	7,330,000	6,910,797	53,213	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	6,160,000	6,039,264	46,502	2022/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	5,910,000	5,447,956	41,949	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000	7,769,100	59,822	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	4,975,000	4,326,459	33,313	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,020,000	9,996,352	76,971	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	9,150,000	9,306,648	71,661	2024/03/15
Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	5,820,000	6,171,178	47,518	2029/03/15	
通貨小計	銘柄数	20銘柄					
	金額			107,949,000	107,170,158	825,210	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,030	3,075	86,801	2021/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,410	4,334	122,322	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,990	3,804	107,366	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,750	2,572	72,583	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	500	461	13,025	2029/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	3,650	3,240	91,439	2020/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	9,640	8,151	230,037	2020/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,030	3,819	107,797	2021/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	2,400	1,719	48,522	2022/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,000	866	24,462	2020/04/01
	通貨小計	銘柄数	10銘柄				
	金額			36,400	32,046	904,358	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	6,500	6,857	33,945	2020/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	8,200	8,885	43,983	2021/09/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	10,600	10,925	54,080	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	10,621	52,576	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.5000	6,000	6,045	29,925	2019/10/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	10,200	11,565	57,250	2022/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	6,100	6,308	31,224	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	4,900	4,539	22,468	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	5,000	4,260	21,089	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	—	1,900	1,882	9,316	2020/02/10

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	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	千チェコ・コルナ 2,900	千チェコ・コルナ 2,736	千円 13,543	2023/10/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,592	12,832	2027/02/10
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額				73,900	77,219	382,238	
		Romania Government Bond	国債証券	5.8500	千ルーマニア・レイ 1,430	千ルーマニア・レイ 1,493	41,263	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	5.9500	940	977	26,997	2021/06/11
		Romania Government Bond	国債証券	5.7500	770	793	21,918	2020/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,132	31,291	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	630	612	16,911	2021/03/22
		Romania Government Bond	国債証券	5.8000	700	729	20,161	2027/07/26
		Romania Government Bond	国債証券	2.2500	700	681	18,840	2020/02/26
		Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,034	28,573	2022/12/19
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	800	730	20,180	2024/04/29
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額				8,210	8,184	226,137	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	千ロシア・ルーブル 14,880	千ロシア・ルーブル 15,092	26,260	2021/04/14
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	31,760	32,912	57,267	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	11,910	12,057	20,980	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	10,800	10,801	18,793	2019/12/11
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,239	24,777	2023/01/25
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	36,160	34,931	60,781	2028/01/19
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	22,100	21,898	38,102	2020/05/27
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,300	24,037	41,824	2023/08/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	29,300	29,645	51,583	2021/08/18
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	24,000	25,670	44,667	2031/09/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	36,100	36,533	63,568	2026/09/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	29,000	29,160	50,738	2022/12/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	47,000	47,141	82,025	2033/03/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	35,600	35,038	60,967	2024/10/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	15,000	14,910	25,943	2021/12/15
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	6,000	5,740	9,988	2024/02/28
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金 額				388,310	389,810	678,270	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.2260	千マレーシア・リンギット 530	千マレーシア・リンギット 526	14,378	2020/04/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	800	802	21,921	2022/04/14
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,200	1,187	32,431	2027/07/26
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,570	1,589	43,406	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,350	1,368	37,380	2021/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,510	1,510	41,258	2020/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,747	47,715	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	910	912	24,928	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,350	1,327	36,252	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	1,040	1,041	28,443	2020/10/15

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

		当 期			末			
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	900	894	24,416	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	800	779	21,285	2026/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,200	32,791	2021/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	920	917	25,059	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,120	2,062	56,325	2027/11/16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,100	1,079	29,480	2037/04/07	
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		19,040	18,948	517,475		
南アフリカ				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド			
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	4,190	4,183	33,717	2020/01/15	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	13,550	14,929	120,330	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	10,220	7,461	60,142	2036/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	3,760	3,671	29,593	2021/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	5,280	3,793	30,577	2041/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,440	7,070	56,989	2031/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	5,880	5,794	46,705	2023/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	11,520	10,564	85,149	2048/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	8,000	7,313	58,943	2037/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	7,100	6,536	52,682	2030/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	8,100	7,454	60,080	2044/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	5,300	4,874	39,287	2032/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	5,100	4,851	39,100	2035/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	4,500	4,266	34,387	2040/01/31	
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		100,940	92,765	747,686		
タイ				千タイ・バーツ	千タイ・バーツ			
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	19,050	22,701	75,597	2029/06/22	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	19,300	20,631	68,702	2023/06/16	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	16,610	18,186	60,560	2025/12/12	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	26,600	28,156	93,759	2021/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	15,700	16,733	55,721	2031/06/20	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.5500	18,200	18,500	61,605	2020/06/26	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	21,200	21,116	70,319	2022/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	14,100	14,522	48,359	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	23,400	22,638	75,384	2026/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	16,000	15,967	53,171	2022/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	15,000	16,198	53,941	2032/06/25	
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		205,160	215,352	717,123		
ペルー				千ペルー・ソル	千ペルー・ソル			
	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	1,130	1,173	39,383	2024/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,470	1,538	51,632	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	950	976	32,773	2032/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,065	1,254	42,083	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	7.8400	310	342	11,485	2020/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	1,165	1,257	42,188	2037/08/12	

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	
					千ペルー・ソル	千円	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,120	1,214	40,763	2031/08/12
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		7,210	7,758	260,309	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,210	2,513	73,858	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	880	926	27,224	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,210	2,208	64,890	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,522	74,123	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	1,560	1,565	45,988	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	2,230	2,216	65,124	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,090	1,975	58,048	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	1,650	1,652	48,564	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,000	2,008	59,012	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	1,000	967	28,425	2020/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	920	993	29,183	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,820	2,035	59,816	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,530	2,711	79,649	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	800	769	22,600	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,850	1,880	55,242	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		26,390	26,948	791,753	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.5000	66,300	69,056	27,332	2020/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	99,671	39,449	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	128,000	121,529	48,101	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	23,000	23,408	9,265	2019/10/30
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	39,000	39,608	15,677	2021/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	14,000	13,879	5,493	2020/09/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	90,000	87,842	34,768	2022/10/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	40,000	37,711	14,926	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	0.5000	60,000	57,887	22,911	2021/04/21
	Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	99,500	113,176	44,795	2020/11/12
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	81,800	95,967	37,984	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	80,000	94,452	37,384	2022/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	92,500	107,312	42,474	2025/06/24
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		912,600	961,505	380,563	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	9.8750	2,300	2,276	8,011	2022/06/20
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,405	8,466	2028/03/15
通貨小計	銘柄数 金 額	2銘柄		5,100	4,681	16,478	
合 計	銘柄数 金 額	200銘柄				8,904,714	

(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

2018年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	8,904,714	94.7
コール・ローン等、その他	493,676	5.3
投資信託財産総額	9,398,391	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.43円、1トルコ・リラ=23.61円、1メキシコ・ペソ=5.68円、1フィリピン・ペソ=2.07円、1アルゼンチン・ペソ=3.93円、100チリ・ペソ=16.93円、100コロンビア・ペソ=3.80円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・レアル=28.22円、1チェコ・コルナ=4.95円、1ルーマニア・レイ=27.63円、1ロシア・ルーブル=1.74円、1マレーシア・リンギット=27.31円、1南アフリカ・ランド=8.06円、1タイ・バツ=3.33円、1ペルー・ソル=33.55円、1ポーランド・ズロチ=29.38円、100ハンガリー・フォリント=39.58円、1ウルグアイ・ペソ=3.52円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(9,125,733千円)の投資信託財産総額(9,398,391千円)に対する比率は、97.1%です。

■損益の状況

当期 自 2017年7月6日 至 2018年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	440,445,335円
受取利息	440,535,976
支払利息	△ 90,641
(B) 有価証券売買損益	△ 970,371,973
売買益	66,848,561
売買損	△ 1,037,220,534
(C) その他費用	△ 13,552,975
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 543,479,613
(E) 前期繰越損益金	1,563,217,047
(F) 解約差損益金	△ 192,538,573
(G) 追加信託差損益金	1,311,862,560
(H) 合計 (D + E + F + G)	2,139,061,421
次期繰越損益金 (H)	2,139,061,421

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,486,484,310円
コール・ローン等	336,142,857
公社債 (評価額)	8,904,714,872
未収入金	88,283,880
未収利息	132,046,280
前払費用	25,296,421
(B) 負債	285,784,712
未払金	284,770,107
未払解約金	999,241
その他未払費用	15,364
(C) 純資産総額 (A - B)	9,200,699,598
元本	7,061,638,177
次期繰越損益金	2,139,061,421
(D) 受益権総口数	7,061,638,177口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,029円

* 期首における元本額は4,207,490,765円、当期中における追加設定元本額は3,347,001,155円、同解約元本額は492,853,743円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 184,828,745円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 339,584,075円、D-I's 新興国債券インデックス46,907,341円、i F r e e 新興国債券インデックス1,371,592,775円、i F r e e 8資産バランス783,201,691円、D Cダイワ新興国債券インデックスファンド4,125,461,369円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券181,938,399円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド28,123,782円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,029円です。

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年11月30日）

（作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30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。

当ファンドは、わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証REIT指数（配当込み）に連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果を東証REIT指数（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
	ダイワJ-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率			
1 期末 (2017年11月30日)	円 9,372	円 0	% △ 6.3	3,189.89	% △ 6.1	% 98.0	% 1.6	百万円 564
2 期末 (2018年11月30日)	10,585	0	12.9	3,610.49	13.2	98.2	1.5	1,027

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

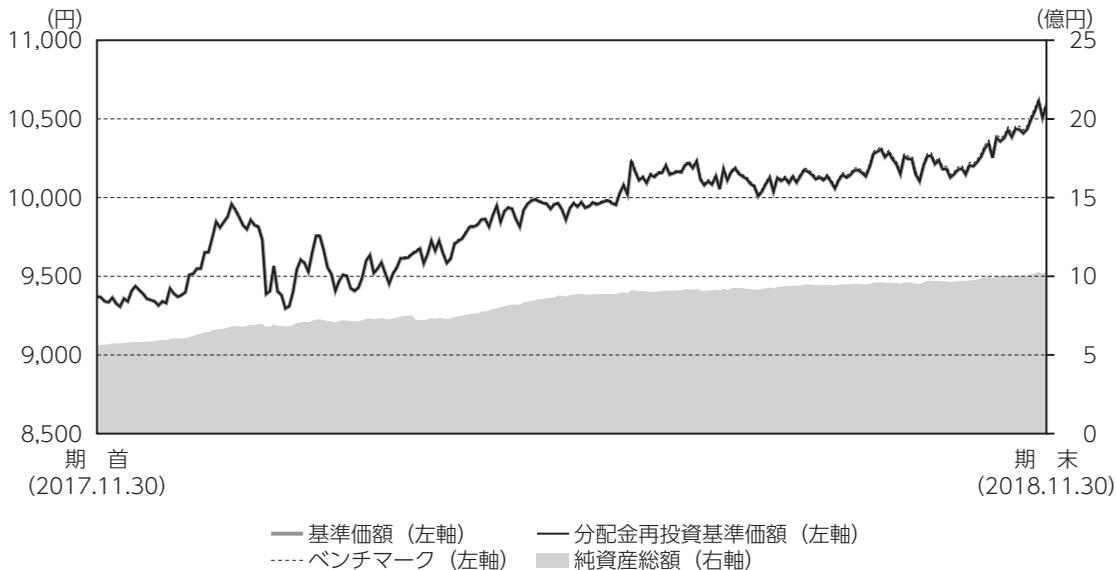
(注3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(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。

- *分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- *分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- *ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

■基準価額・騰落率

期首：9,372円

期末：10,585円（分配金0円）

騰落率：12.9%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、オフィス市況など事業環境の良好さが継続していることなどを背景に、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券 組入比率	不動産投信指数 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2017年11月30日	円 9,372	% -	3,189.89	% -	% 98.0	% 1.6
12月末	9,369	△ 0.0	3,189.59	△ 0.0	98.2	1.4
2018年 1 月末	9,857	5.2	3,357.09	5.2	98.1	1.4
2 月末	9,663	3.1	3,291.44	3.2	97.8	1.5
3 月末	9,614	2.6	3,274.92	2.7	97.8	1.6
4 月末	9,860	5.2	3,358.59	5.3	97.8	1.6
5 月末	9,922	5.9	3,379.45	5.9	98.0	1.6
6 月末	10,129	8.1	3,450.92	8.2	97.9	1.5
7 月末	10,180	8.6	3,468.88	8.7	97.4	1.5
8 月末	10,145	8.2	3,457.71	8.4	97.9	1.5
9 月末	10,306	10.0	3,513.39	10.1	98.2	1.4
10月末	10,147	8.3	3,459.73	8.5	97.9	1.4
(期末) 2018年11月30日	10,585	12.9	3,610.49	13.2	98.2	1.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より横ばいで推移しましたが、2018年に入ると、事業環境が良好なことから国内外投資家からの資金が継続的に流入し、好調な推移となりました。しかし2月には、米国長期金利が急上昇したことなどをを受けて国内外で株式市場が下落する中で、国内リート市場も下落しました。3月以降は、オフィス市況など事業環境の良好さが継続していることや日本の長期金利が低位安定推移となったことなどを背景に上昇しました。7月以降は、公募増資による需給悪化や、日銀の金融政策調整観測からの長期金利上昇などをを受けて、軟調な推移となりました。11月に入ると、国内長期金利が低下したことなどを背景に上昇して当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワJ-REITマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を組み入れることにより行いました。

■ダイワJ-REITマザーファンド

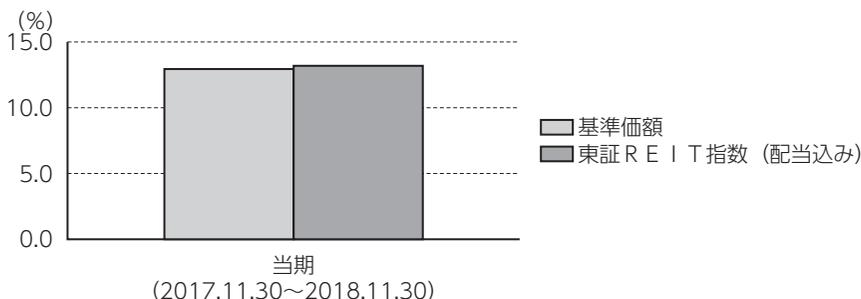
ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度としました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は13.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は12.9%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳 (1万口当り)

項 目	当 期	
	2017年12月1日 ～2018年11月30日	
当期分配金 (税込み) (円)	—	
対基準価額比率 (%)	—	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	924	

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワJ-REITマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2017.12.1~2018.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	22円	0.227%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,904円です。
(投 信 会 社)	(15)	(0.151)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	23	0.233	

(注1) 当作成期中の費用(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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワJ-REIT マザーファンド	170,416	423,011	25,740	64,055

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ-REITマザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
投資信託証券	百万円 410	百万円 686	百万円 4,049

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

種 類	当 期	
	ダイワJ-REITマザーファンド	
	買 付 額	
投資信託証券	百万円 1,222	

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成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

当作成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、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワJ-REITマザーファンド	237,994	382,670	1,025,366

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワJ-REITマザーファンド	1,025,366	99.6
コール・ローン等、その他	4,296	0.4
投資信託財産総額	1,029,662	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,029,662,675円
コール・ローン等	4,296,540
ダイワJ-REITマザーファンド(評価額)	1,025,366,135
(B) 負債	2,259,370
未払解約金	1,166,092
未払信託報酬	1,067,907
その他未払費用	25,371
(C) 純資産総額(A-B)	1,027,403,305
元本	970,641,025
次期繰越損益金	56,762,280
(D) 受益権総口数	970,641,025口
1万口当り基準価額(C/D)	10,585円

* 期首における元本額は602,124,068円、当作成期間中における追加設定元本額は587,481,644円、同解約元本額は218,964,687円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,585円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,199円
受取利息	220
支払利息	△ 2,419
(B) 有価証券売買損益	94,449,036
売買益	103,221,415
売買損	△ 8,772,379
(C) 信託報酬等	△ 1,906,173
(D) 当期損益金(A + B + C)	92,540,664
(E) 前期繰越損益金	△ 2,768,329
(F) 追加信託差損益金	△ 33,010,055
(配当等相当額)	(△ 887)
(売買損益相当額)	(△ 33,009,168)
(G) 合計(D + E + F)	56,762,280
次期繰越損益金(G)	56,762,280
追加信託差損益金	△ 33,010,055
(配当等相当額)	(△ 887)
(売買損益相当額)	(△ 33,009,168)
分配準備積立金	89,774,534
繰越損益金	△ 2,199

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」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	89,774,534
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	89,774,534
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	89,774,534
(h) 受益権総口数	970,641,025口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2018年9月18日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年11月30日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を264～265ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

買				付				売				付			
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価	
		千口	千円	円			千口	千円	円			千口	千円	円	
GLP投資法人		19,689	2,247,389	114,144	日本ビルファンド		5,104	3,039,422	595,498	ジャパンリアルエステイト		4,765	2,664,226	559,124	
大和ハウスリート投資法人		6,492	1,676,953	258,310	日本リートールファンド		10,947	2,242,784	204,876	野村不動産マスターF		14,304	2,121,256	148,298	
ジャパンリアルエステイト		2,301	1,314,584	571,310	ユニテッド・アーバン投資法人		11,627	1,960,776	168,639	オリックス不動産投資		9,291	1,550,722	166,905	
インヴィンシブル投資法人		21,225	1,040,479	49,021	日本プロロジスリート		6,332	1,470,832	232,285	大和ハウスリート投資法人		5,076	1,320,013	260,049	
野村不動産マスターF		5,046	760,869	150,786	投資法人みらい		3,652	685,844	187,799	日本プライムリアルティ		3,289	1,262,221	383,770	
日本ビルファンド		1,176	756,334	643,141	インベスコ・オフィス・Jリート		44,578	639,570	14,347	アドバンス・レジデンス		4,487	1,249,235	278,412	
日本プロロジスリート		3,321	749,689	225,742											
API投資法人		1,431	694,808	485,540											

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年11月30日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（83,907,324千口）の内容です。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	2018年11月30日現在		
	口数	評価額	比率
不動産投信	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	8,306	4,576,606	2.0
MCUBS MidCity投資法人	28,167	2,526,579	1.1
森ヒルズリート	28,667	4,030,580	1.8
産業ファンド	29,122	3,232,542	1.4
アドバンス・レジデンス	24,36	7,636,860	3.4
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	14,829	2,538,724	1.1
API投資法人	11,978	5,713,506	2.5
GLP投資法人	61,938	7,073,319	3.1
コンフォリア・レジデンシャル	9,533	2,714,045	1.2
日本プロロジスリート	33,528	7,882,432	3.5
星野リゾート・リート	3,803	2,019,393	0.9
Oneリート投資法人	3,643	928,600	0.4
イオンリート投資	25,657	3,255,873	1.4
ヒューリックリート投資法人	20,206	3,354,196	1.5
日本リート投資法人	8,069	2,997,633	1.3

ファンド名	2018年11月30日現在		
	口数	評価額	比率
インベスコ・オフィス・Jリート	148,169	2,443,306	1.1
日本ヘルスケア投資法	1,145	195,680	0.1
積水ハウス・リート投資	64,492	4,507,990	2.0
トーセイ・リート投資法人	4,812	525,470	0.2
ケネディクス商業リート	9,161	2,233,451	1.0
ヘルスケア&メディカル投資	3,31	374,692	0.2
サムティ・レジデンシャル	5,003	458,775	0.2
野村不動産マスターF	74,087	11,231,589	5.0
いちごホテルリート投資	4,371	597,078	0.3
ラサールロジポート投資	18,857	2,034,670	0.9
スターアジア不動産投	7,759	820,902	0.4
マリモ地方創生リート	2,149	237,034	0.1
三井不ロジパーク	4,268	1,397,770	0.6
大江戸温泉リート	4,034	339,662	0.2
さくら総合リート	5,408	470,496	0.2

ダイワJ-REITマザーファンド

ファンド名	2018年11月30日現在		
	口数	評価額	比率
	千口	千円	%
投資法人みらい	6.732	1,232,629	0.5
森トラスト・ホテルリート投	5.865	785,910	0.3
三菱地所物流REIT	2.645	656,224	0.3
CREロジスティクスファンド	2.503	266,068	0.1
ザイマックス・リート	2.305	263,231	0.1
タカラレーベン不動産投	3.741	329,956	0.1
伊藤忠アドバンスロジ	3.867	342,616	0.2
日本ビルファンド	24.205	17,112,935	7.6
ジャパンリアルエステイト	24.996	15,672,492	7.0
日本リテールファンド	47.242	10,284,583	4.6
オリックス不動産投資	49.804	9,198,798	4.1
日本プライムリアルティ	15.823	7,017,500	3.1
プレミア投資法人	23.765	2,920,718	1.3
東急リアル・エステート	16.759	2,803,780	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人	15.982	1,901,858	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	55.128	9,961,629	4.4
森トラスト総合リート	17.864	2,940,414	1.3
インヴィンシブル投資法人	87.471	4,119,884	1.8
フロンティア不動産投資	8.503	3,754,074	1.7
平和不動産リート	15.566	1,813,439	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	16.493	3,737,313	1.7
福岡リート投資法人	12.927	2,179,492	1.0
ケネディクス・オフィス投資法人	7.732	5,760,340	2.6
いちごオフィスリート投資法人	20.737	1,924,393	0.9
大和証券オフィス投資法人	5.769	4,049,838	1.8
阪急阪神リート投資法人	10.369	1,527,353	0.7
スタートアップロード投資法人	3.938	659,615	0.3
大和ハウスリート投資法人	31.295	8,052,203	3.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人	72.375	5,717,625	2.5
日本賃貸住宅投資法人	28.115	2,437,570	1.1
ジャパンエクセレント投資法人	22.383	3,482,794	1.5
合計	1,331.73	221,256,748	
	口数、金額 銘柄数<比率>	61銘柄	<98.4%>

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別		2018年11月30日現在	
		買建額	売建額
国内	東証REIT	百万円 3,270	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書 第29期（決算日 2018年9月18日）

（計算期間 2018年3月16日～2018年9月18日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの第29期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

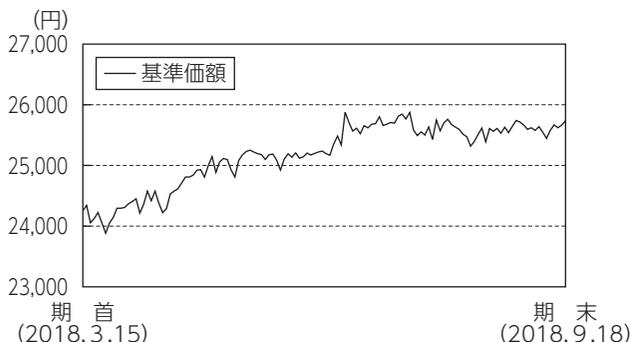
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数先物 比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率		
(期首)2018年3月15日	24,252	% -	3,269.20	% -	% 98.2	% 1.6
3月末	24,294	0.2	3,274.92	0.2	98.0	1.6
4月末	24,921	2.8	3,358.59	2.7	97.9	1.6
5月末	25,084	3.4	3,379.45	3.4	98.2	1.6
6月末	25,614	5.6	3,450.92	5.6	98.1	1.5
7月末	25,747	6.2	3,468.88	6.1	97.6	1.5
8月末	25,665	5.8	3,457.71	5.8	98.1	1.5
(期末)2018年9月18日	25,737	6.1	3,467.41	6.1	98.1	1.5

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,252円 期末：25,737円 騰落率：6.1%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の動きに連動した投資成果をめざした運用を行なった結果、オフィス市況など事業環境の良好さが継続していることなどを背景に、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は、期首より、オフィス市況など事業環境の良好さが継続していることや、日本の長期金利が低位安定推移となったことなどを背景に、上昇しました。2018年7月中旬以降は、公募増資による需給悪化や、日銀の金融政策調整観測からの長期金利上昇などを受けて、期末にかけて軟調な推移となりました。

◆前期における「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、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は6.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率も6.1%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2018年3月16日から2018年9月18日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内	161.7194	12,427,485	108.6384 (-)	17,900,535 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2018年3月16日から2018年9月18日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	6,196	6,608	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2018年3月16日から2018年9月18日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	□ 数	金 額	平均単価	銘	柄	□ 数	金 額	平均単価
		千□	千円	円			千□	千円	円
大和ハウスリート投資法人		5.569	1,439,340	258,455	日本ビルファンド		2.253	1,386,179	615,259
GLP投資法人		9.982	1,135,624	113,767	ジャパンリアルエステイト		1.957	1,118,514	571,545
インヴィンシブル投資法人		18.65	919,288	49,291	日本リテールファンド		5.294	1,078,927	203,801
ジャパンリアルエステイト		1.552	873,302	562,694	野村不動産マスターF		6.773	1,035,530	152,891
インベスコ・オフィス・Jリート		40.543	570,398	14,068	ユナイテッド・アーバン投資法人		5.132	874,690	170,438
投資法人みらい		2.58	492,154	190,757	オリックス不動産投資		4.412	752,788	170,622
日本リート投資法人		1.349	446,935	331,309	日本プロロジスリート		2.891	653,772	226,140
ケネディクス・オフィス投資法人		0.561	380,685	678,582	日本プライムリアルティ		1.428	565,718	396,161
アドバンス・レジデンス		1.221	351,830	288,149	大和ハウスリート投資法人		2.103	546,925	260,069
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		2.023	337,190	166,678	ジャパン・ホテル・リート投資法人		6.487	519,945	80,151

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
不動産投信	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	8.223	4,119,723	1.9
MCUBS MidCity投資法人	27.886	2,431,659	1.1
森ビルズリート	28.381	4,095,378	1.9
産業ファンド	28.831	3,358,811	1.6
アドバンス・レジデンス	24.117	6,882,991	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	14.681	2,561,834	1.2
A P I 投資法人	11.858	5,863,781	2.7
G L P 投資法人	61.318	6,738,848	3.1
コンフォリア・レジデンシャル	9.438	2,465,205	1.1
日本プロロジスリート	33.194	7,203,098	3.4
星野リゾート・リート	3.765	2,059,455	1.0
Oneリート投資法人	2.888	695,719	0.3
イオンリート投資	25.401	3,076,061	1.4
ヒューリックリート投資法	17.847	2,853,735	1.3
日本リート投資法人	7.988	2,935,590	1.4
インベスコ・オフィス・Jリート	146.691	2,391,063	1.1
日本ヘルスケア投資法	1.133	202,807	0.1
積水ハウス・リート投資	63.848	4,571,516	2.1
トーセイ・リート投資法人	3.978	447,922	0.2
ケネディクス商業リート	9.07	2,211,266	1.0
ヘルスケア&メディカル投資	3.277	376,855	0.2
サムティ・レジデンシャル	4.953	449,237	0.2
野村不動産マスターF	73.347	11,222,091	5.2
いちごホテルリート投資	4.327	604,049	0.3
ラサールロジポート投資	18.669	1,907,971	0.9
スターアジア不動産投	7.682	788,173	0.4
マリモ地方創生リート	2.128	237,910	0.1
三井不ロジパーク	4.225	1,330,875	0.6
大江戸温泉リート	3.994	341,087	0.2
さくら総合リート	5.354	479,183	0.2
投資法人みらい	5.757	1,092,678	0.5
森トラスト・ホテルリート投	5.806	812,259	0.4
三菱地所物流R E I T	2.616	648,768	0.3
C R E ロジスティクスファンド	2.478	268,119	0.1
ザイマックス・リート	2.282	256,268	0.1
タカラレーベン不動産投	3.682	330,275	0.2
日本ビルファンド	23.964	15,456,780	7.2
ジャパンリアルエステイト	24.746	14,501,156	6.8
日本リテールファンド	46.77	9,648,651	4.5
オリックス不動産投資	49.307	8,609,002	4.0
日本プライムリアルティ	15.665	6,344,325	3.0
プレミア投資法人	23.528	2,724,542	1.3
東急リアル・エステート	16.591	2,599,809	1.2

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
グローバル・ワン不動産投資法人	15.823	1,835,468	0.9
ユナイテッド・アーバン投資法人	54.578	9,611,185	4.5
森トラスト総合リート	17.686	2,859,826	1.3
インヴィンシブル投資法人	86.598	4,026,807	1.9
フロンティア不動産投資	8.418	3,687,084	1.7
平和不動産リート	15.41	1,730,543	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	16.328	3,623,183	1.7
福岡リート投資法人	12.798	2,225,572	1.0
ケネディクス・オフィス投資法人	7.655	5,419,740	2.5
いちごオフィスリート投資法人	20.53	1,886,707	0.9
大和証券オフィス投資法人	5.712	3,901,296	1.8
阪急阪神リート投資法人	10.266	1,437,240	0.7
スタートアップリート投資法人	3.899	665,169	0.3
大和ハウスリート投資法人	30.983	7,869,682	3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人	71.653	6,004,521	2.8
日本賃貸住宅投資法人	27.834	2,507,843	1.2
ジャパンエクセレント投資法人	22.16	3,246,440	1.5
合 計	□ 数、金 額	1,310,015	210,734,845
	銘柄数<比率>	60銘柄	<98.1%>

※森ビルズリート、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト、A P I 投資法人、G L P 投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、日本プロロジスリート、One リート投資法人、イオンリート投資、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、日本ヘルスケア投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、サムティ・レジデンシャル、マリモ地方創生リート、三井不ロジパーク、投資法人みらい、三菱地所物流R E I T、C R E ロジスティクスファンド、日本ビルファンド、ジャパンリアルエステイト、オリックス不動産投資、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、フロンティア不動産投資、平和不動産リート、日本ロジスティクスファンド投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急阪神リート投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等をいいます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメント、ミカサ・アセット・マネジメントが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。
 (注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 東証R E I T	百万円 3,139	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年9月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	210,734,845	97.7
コール・ローン等、その他	4,879,762	2.3
投資信託財産総額	215,614,608	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年9月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	215,986,703,305円
コール・ローン等	1,490,567,281
投資信託証券(評価額)	210,734,845,400
未収入金	1,019,326,582
未収配当金	2,369,869,042
差入委託証拠金	372,095,000
(B) 負債	1,186,680,766
未払解約金	800,902,860
差入委託証拠金代用有価証券	385,775,000
その他未払費用	2,906
(C) 純資産総額(A - B)	214,800,022,539
元本	83,458,696,180
次期繰越損益金	131,341,326,359
(D) 受益権総口数	83,458,696,180口
1万口当り基準価額(C / D)	25,737円

*期首における元本額は87,243,538,784円、当期中における追加設定元本額は4,235,268,269円、同解約元本額は8,020,110,873円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン7,972,943,958円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）67,556,291,527円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）409,937,566円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 30,010円、i F r e e J - R E I T インデックス135,522,535円、i F r e e 8資産バランス460,170,436円、DC・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン3,700,023,662円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 2,871,349円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 5,244,205円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,465,311円、ダイワ・ノーロード J - R E I T ファンド51,111,721円、ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス968,374,980円、ダイワ J - R E I T インデックス（ダイワ S M A 専用）361,747,040円、ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス369,072,531円、ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T 1,463,889,349円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は25,737円です。

■損益の状況

当期 自2018年3月16日 至2018年9月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,114,087,429円
受取配当金	4,060,094,098
受取利息	127
その他収益金	54,818,227
支払利息	△ 825,023
(B) 有価証券売買損益	8,370,175,830
売買益	10,319,519,924
売買損	△ 1,949,344,094
(C) 先物取引等損益	200,062,800
取引益	200,062,800
(D) その他費用	△ 202,786
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	12,684,123,273
(F) 前期繰越損益金	124,341,475,742
(G) 解約差損益金	△ 12,141,310,717
(H) 追加信託差損益金	6,457,038,061
(I) 合計(E + F + G + H)	131,341,326,359
次期繰越損益金(I)	131,341,326,359

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

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

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書 (全体版) 第2期

(決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30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。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、海外リート市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）	
信託期間	無期限	
運用方針	海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資 信託証券 組入比率	不動産 投信指数 先物比率	純資産 総額
	(分配)	税 込 分 配	み 金	期 騰 落	中 率				
1期末 (2017年11月30日)	円 10,301	円 0	% 3.0	10,550	% 5.5	% 0.3	% 97.6	% 0.5	百万円 451
2期末 (2018年11月30日)	10,317	0	0.2	10,866	3.0	0.8	98.9	1.0	767

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。同指数の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

(注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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 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6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■基準価額・騰落率

期首：10,301円

期末：10,317円（分配金0円）

騰落率：0.2%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートに投資し為替ヘッジした結果、海外リート市場の上昇が主な要因となり、当ファンドの基準価額はやや上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)

年 月 日	基準価額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース) (参考指数)		投資信託 組入比率	投資信託 組入比率	資産 比率	不動産 先行物 指数
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率				
(期首) 2017年11月30日	10,301	—	10,550	—	0.3	97.6	0.5	
12月末	10,378	0.7	10,660	1.0	1.0	97.7	1.2	
2018年 1 月末	9,858	△4.3	10,131	△4.0	0.9	95.1	1.1	
2 月末	9,358	△9.2	9,621	△8.8	0.6	95.7	1.1	
3 月末	9,607	△6.7	9,900	△6.2	0.8	97.4	1.0	
4 月末	9,632	△6.5	9,947	△5.7	0.8	100.1	1.0	
5 月末	10,093	△2.0	10,458	△0.9	0.7	96.8	1.0	
6 月末	10,358	0.6	10,763	2.0	0.6	99.1	1.0	
7 月末	10,309	0.1	10,738	1.8	1.0	97.7	1.0	
8 月末	10,634	3.2	11,114	5.4	1.1	96.3	1.6	
9 月末	10,241	△0.6	10,737	1.8	1.6	99.7	1.0	
10月末	10,148	△1.5	10,668	1.1	1.2	96.6	1.0	
(期末) 2018年11月30日	10,317	0.2	10,866	3.0	0.8	98.9	1.0	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■海外リート市況

海外リート市況は、北米やアジア・オセアニア地域を中心に上昇しました。

北米リート市況は、当作成期首よりしばらくは方向感のない動きとなりました。2018年に入ると、好調な経済指標の発表により早期利上げ観測が高まったことから長期金利が上昇し、利回り資産としてのリートに売り圧力が強まりました。5月からは、主要リートの好調な決算発表や長期金利が安定的に推移したことを受けて、上昇に転じました。その後は、長期金利が再び上昇したことや米中貿易摩擦が悪材料となり下落する局面もありましたが、当作成期末にかけて再び上昇する展開となりました。

欧州リート市況は、当作成期首より、好調な不動産ファンダメンタルズや大手商業施設リートに対する買収観測などが好材料となり、フランスやドイツを中心として総じて堅調に推移しました。しかし2018年に入ると、堅調な景気を受けた長期金利の上昇や米国株式の急落から、売られる展開となりました。4月からは急落の反動で緩やかな上昇に転じました。8月以降は、英国のEU（欧州連合）離脱方法に関する政治懸念が強まったことや、フランスリートの業績懸念が強まったことで売られる展開となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、2018年に入るとリスク回避の動きから売られましたが、4月以降はリートの好業績に支えられて緩やかな上昇に転じました。その後は、中国株の下落や商業施設リートの業績懸念などもあり軟調な展開となりましたが、当作成期末にかけて再び上昇する展開となりました。シンガポールについては、不動産の供給増が悪材料となり同地域の中では軟調な推移となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、マザーファンドの保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資を90～110%の範囲で行いました。また、マザーファンド保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

なお、マザーファンドの組入比率が100%程度にならないのは、為替の売りヘッジ予約による評価損益が発生する影響が主要因です。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）および不動産投信指数先物を組み入れました。

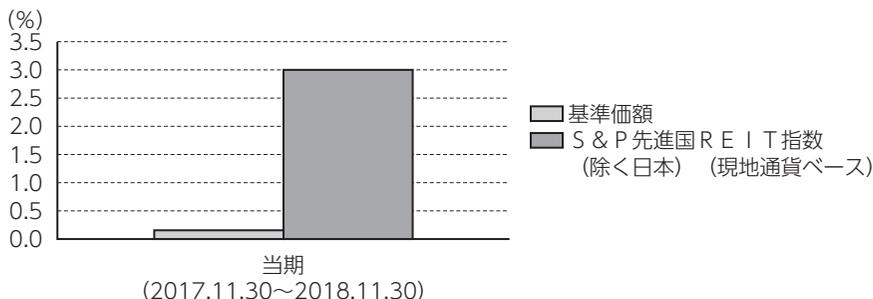
ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。

マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

なお、為替ヘッジを行う時に通貨間の金利差等による損益（為替ヘッジコスト）が発生します。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年12月1日 ～2018年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	378

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、マザーファンドの保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017.12.1~2018.11.30)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	32円	0.318%	信託報酬=当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,068円です。
(投信会社)	(24)	(0.243)	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、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(5)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0.018	売買委託手数料=当作成期中の売買委託手数料/当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(出資証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(1)	(0.013)	
有価証券取引税	2	0.022	有価証券取引税=当作成期中の有価証券取引税/当作成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
(出資証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(2)	(0.022)	
その他費用	15	0.147	その他費用=当作成期中のその他費用/当作成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(8)	(0.083)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(6)	(0.059)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	51	0.506	

(注1) 当作成期中の費用(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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	172,034	369,039	34,134	76,460

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	金 額	評 価 額	□ 数	金 額	評 価 額
	千□	千円	千円	千□	千円	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	197,879	335,779	774,541			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	774,541	99.8
コール・ローン等、その他	1,919	0.2
投資信託財産総額	776,460	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1香港ドル=14.51円、1シンガポール・ドル=82.89円、1ニュージーランド・ドル=77.87円、1イギリス・ポンド=145.01円、1イスラエル・シケル=30.60円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(19,772,852千円)の投資信託財産総額(19,918,127千円)に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,528,038,307円
コール・ローン等	1,871,955
ダイワ・グローバルREITイン デックス・マザーファンド(評価額)	774,541,523
未収入金	751,624,829
(B) 負債	760,886,443
未払金	759,248,387
未払解約金	447,186
未払信託報酬	1,171,106
その他未払費用	19,764
(C) 純資産総額(A-B)	767,151,864
元本	743,572,984
次期繰越損益金	23,578,880
(D) 受益権総口数	743,572,984口
1万口当り基準価額(C/D)	10,317円

* 期首における元本額は438,056,631円、当作成期間中における追加設定元本額は460,818,025円、同解約元本額は155,301,672円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,317円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 941円
受取利息	53
その他収益金	195
支払利息	△ 1,189
(B) 有価証券売買損益	15,202,516
売買益	93,613,370
売買損	△78,410,854
(C) 信託報酬等	△ 2,054,888
(D) 当期損益金(A + B + C)	13,146,687
(E) 前期繰越損益金	6,905,606
(F) 追加信託差損益金	3,526,587
(配当等相当額)	(8,103,192)
(売買損益相当額)	(△ 4,576,605)
(G) 合計(D + E + F)	23,578,880
次期繰越損益金(G)	23,578,880
追加信託差損益金	3,526,587
(配当等相当額)	(8,103,192)
(売買損益相当額)	(△ 4,576,605)
分配準備積立金	20,053,234
繰越損益金	△ 941

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	13,147,359
(c) 収益調整金	8,103,192
(d) 分配準備積立金	6,905,875
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	28,156,426
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	28,156,426
(h) 受益権総口数	743,572,984口

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用報告書 第14期（決算日 2018年11月30日）

（作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券 組入制限	無制限

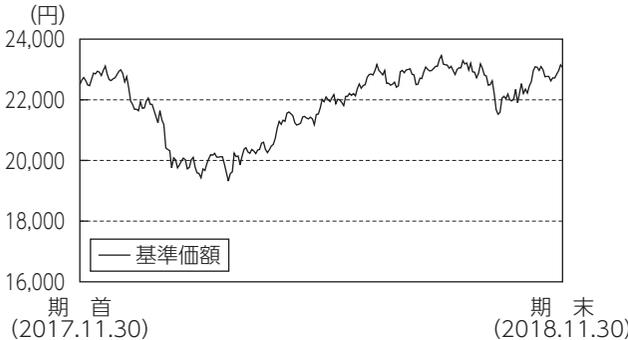
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率		投資信託 証券 組入比率		不動産 投信指数 先物比率	
	円	騰落率	円	騰落率	%	%	%	%	%	%
(期首)2017年11月30日	22,500	-	25,699	-	0.3	98.9	0.5			
12月末	22,987	2.2	26,288	2.3	1.0	97.0	1.2			
2018年1月末	21,241	△5.6	24,336	△5.3	1.0	97.7	1.1			
2月末	19,773	△12.1	22,698	△11.7	0.6	98.1	1.2			
3月末	20,126	△10.6	23,088	△10.2	0.8	97.7	1.0			
4月末	20,727	△7.9	23,773	△7.5	0.8	97.8	1.0			
5月末	21,516	△4.4	24,723	△3.8	0.7	97.7	1.0			
6月末	22,374	△0.6	25,681	△0.1	0.6	98.1	1.0			
7月末	22,461	△0.2	25,820	0.5	1.0	97.4	1.0			
8月末	23,174	3.0	26,753	4.1	1.1	97.0	1.6			
9月末	22,872	1.7	26,281	2.3	1.5	97.1	1.0			
10月末	22,533	0.1	25,862	0.6	1.2	97.5	1.0			
(期末)2018年11月30日	23,067	2.5	26,534	3.2	0.8	97.9	0.9			

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：22,500円 期末：23,067円 騰落率：2.5%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は、北米やアジア・オセアニア地域を中心に上昇しました。

北米リート市況は、当作成期首よりしばらくは方向感のない動きとなりました。2018年に入ると、好調な経済指標の発表により早

期利上げ観測が高まったことから長期金利が上昇し、利回り資産としてのリートに売り圧力が強まりました。5月からは、主要リートの好調な決算発表や長期金利が安定的に推移したことを受けて、上昇に転じました。その後は、長期金利が再び上昇したことや米中貿易摩擦が悪材料となり下落する局面もありましたが、当作成期末にかけて再び上昇する展開となりました。

欧州リート市況は、当作成期首より、好調な不動産ファンダメンタルズや大手商業施設リートに対する買収観測などが好材料となり、フランスやドイツを中心として総じて堅調に推移しました。しかし2018年に入ると、堅調な景気を受けた長期金利の上昇や米国株式の急落から、売られる展開となりました。4月からは急落の反動で緩やかな上昇に転じました。8月以降は、英国のEU (欧州連合) 離脱方法に関する政治懸念が強まったことや、フランスリートの業績懸念が強まったことで売られる展開となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、2018年に入るとリスク回避の動きから売られました。4月以降はリートの好業績に支えられて緩やかな上昇に転じました。その後は、中国株の下落や商業施設リートの業績懸念などもあり軟調な展開となりましたが、当作成期末にかけて再び上昇する展開となりました。シンガポールについては、不動産の供給増が悪材料となり同地域の中では軟調な推移となりました。

○為替相場

為替相場は、まちまちな展開となりました。

米ドルは、2018年に入ると、米国財務長官の米ドル安容認発言や株急落によるリスク回避の動きを受けて、米ドル安となりました。2018年3月下旬からは、米中貿易摩擦への懸念が後退したことでもリスク選好の動きが強まったことや米国の金利が上昇したことを受けて、上昇に転じました。その後は、米中貿易摩擦が悪材料となって下落する局面もありましたが、米国金利の上昇もあり底堅い推移となりました。

ユーロは、当作成期首からしばらくは、欧州金利の上昇を受けてやや上昇しました。しかし、2018年2月からはリスク回避の動きを受けて下落に転じ、5月にはイタリアの政局混迷を受けてさらに売られました。6月以降は、イタリアの政治情勢への懸念が和らぎ、市場のリスク選好度が強まったことから、ユーロ高に転じました。その後はトルコの債務危機などで上昇下落が続きました。英ポンドもユーロとほぼ同じ動きとなりました。

オーストラリア・ドルは、当作成期首から、原油価格の上昇を受けて買われました。2018年2月からは、リスク回避の動きにより円が買われた結果下落し、その後も、米中貿易摩擦の激化による中国の影響を受けやすいことから、上値の重い展開となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク (S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)) に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託 (ETF) ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

◆ポートフォリオについて

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

また、運用の効率化を図るため、外国投資信託 (ETF) および不動産投信指数先物を組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は3.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.5%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

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

《今後の運用方針》

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（E T F）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

S & P先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S & P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]および S & P[®]は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones[®]は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■ 1 万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	4円
（先物・オプション）	(1)
（出資証券）	(0)
（投資信託受益証券）	(0)
（投資信託証券）	(3)
有価証券取引税	5
（出資証券）	(0)
（投資信託受益証券）	(0)
（投資信託証券）	(5)
その他費用	31
（保管費用）	(18)
（その他）	(12)
合計	40

(注 1) 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) 項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	買		付		売		付	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額
外国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	153.3	12,354	141.1	11,311	(-)	(-)	(-)	(-)

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

(2) 投資信託証券

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	買		付		売		付	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額
外国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	1,275.9	44,010	89,783	2,487	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	95.3	1,674	25.9	416	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	1,546.05	6,049	255.6	2,258	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	510	9,641	106	327	(-)	(-)	(-)	(-)
シンガポール	2,232.6	3,058	(-)	(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ニュージーランド	266.95	373	23.13	35	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	1,075.11	2,779	13.85	52	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (アイルランド)	82.4	124	(-)	(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	6.02	206	1.23	37	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	6.99	455	5.59	3	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	33.34	3,455	0.45	13	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	15.49	182	(-)	(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	79.52	787	16.1	191	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (イタリア)	52.18	61	3.04	3	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ユーロ 通貨計)	275.94	5,272	26.41	250	(-)	(-)	(-)	(-)

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

(3) 出資証券

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	買		付		売		付	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額
外国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	(0.488)	(-)	0.488	9	(-)	(-)	(-)	(-)

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 不動産投信指数先物取引	百万円 1,139	百万円 1,021	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

当 期							
買 付			売 付				
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	153.3	1,384,212	9,029	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	141.1	1,266,877	8,978

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

当 期							
買 付			売 付				
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	15.5	285,433	18,415	WESTFIELD CORP (オーストラリア)	255.6	185,958	727
PROLOGIS INC (アメリカ)	28.8	204,416	7,097	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A (アメリカ)	31.913	72,464	2,270
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	7.67	188,596	24,588	LASALLE HOTEL PROPERTIES (アメリカ)	16.4	62,339	3,801
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	7.7	172,809	22,442	EDUCATION REALTY TRUST INC (アメリカ)	11.5	54,161	4,709
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	53.6	131,472	2,452	ALEXANDER & BALDWIN INC (アメリカ)	11.033	29,517	2,675
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	6.9	130,373	18,894	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST (カナダ)	4.7	19,954	4,245
WELLTOWER INC (アメリカ)	19.3	129,929	6,732	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA (スペイン)	7.03	14,549	2,069
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	18.6	128,924	6,931	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE (カナダ)	18.9	12,965	686
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	10.5	128,629	12,250	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN (アメリカ)	6.7	11,326	1,690
VENTAS INC (アメリカ)	17.7	108,217	6,113	ISTAR INC (アメリカ)	8.4	10,881	1,295

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

(1) 外国投資信託受益証券

フ ァ ン ド 名	当 期 末			比 率
	口 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
VANGUARD REAL ESTATE ETF	17	1,380	156,653	0.8

(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) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MANULIFE US REAL ESTATE INV (アメリカ)	168.727	129	14,741	0.1
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21	738	83,829	0.4
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	10.1	52	5,959	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	16.782	328	37,247	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	16.5	337	38,268	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	21.1	3,968	450,280	2.3
SIMON PROPERTY GROUP INC	47.247	8,721	989,662	5.0
BOSTON PROPERTIES INC	23.5	3,050	346,170	1.7
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	24.055	1,110	125,967	0.6
VORNADO REALTY TRUST	26.364	1,860	211,141	1.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	8.6	155	17,672	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8.3	227	25,852	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.1	112	12,818	0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	7.8	317	36,022	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	56.1	3,942	447,315	2.2
APPLE HOSPITALITY REIT INC	32.1	511	57,986	0.3
EPR PROPERTIES	11.3	797	90,511	0.5
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	31	3,610	0.0
CITY OFFICE REIT INC	5.3	57	6,507	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	10.133	203	23,145	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9.829	272	30,904	0.2
CHATHAM LODGING TRUST	6.3	125	14,189	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9.2	270	30,670	0.2
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	4.1	157	17,920	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7.6	567	64,350	0.3
FOREST CITY REALTY TRUST-A	40.8	1,031	117,081	0.6
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17.2	305	34,622	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.3	71	8,082	0.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4.113	40	4,545	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	112.9	2,178	247,247	1.2
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	39.108	800	90,837	0.5
CORESITE REALTY CORP	5.6	538	61,115	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	23.9	739	83,961	0.4
RLJ LODGING TRUST	26.671	538	61,132	0.3
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	18	2,092	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	27.2	477	54,227	0.3
CYRUSONE INC	15.9	887	100,745	0.5
KIMCO REALTY CORP	64.4	1,025	116,407	0.6
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1.8	17	1,944	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	31.55	880	99,917	0.5
WHITESTONE REIT	5.8	81	9,200	0.0
TIER REIT INC	8.1	187	21,295	0.1
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	21	2,393	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30.6	1,049	119,130	0.6
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	18.7	340	38,597	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	30.7	938	106,526	0.5
COLONY CAPITAL INC	72.211	433	49,244	0.2
INVITATION HOMES INC	45.397	971	110,184	0.6
JBG SMITH PROPERTIES	16.532	653	74,172	0.4

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
CLIPPER REALTY INC	1.4	18	2,068	0.0
GLADSTONE LAND CORP	0.9	11	1,341	0.0
INFRAREIT INC	5.6	126	14,348	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	8.5	229	26,002	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2.5	54	6,169	0.0
VICI PROPERTIES INC	53.6	1,182	134,229	0.7
SPIRIT MTA REIT	5.87	57	6,480	0.0
RETAIL VALUE INC	1.957	56	6,439	0.0
BRT APARTMENTS CORP	1.3	14	1,677	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7.3	63	7,198	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1.4	69	7,917	0.0
SAFETY INCOME & GROWTH INC	1.3	25	2,913	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	26.56	169	19,288	0.1
CORECIVIC INC	18.024	396	45,014	0.2
STORE CAPITAL CORP	27.8	826	93,813	0.5
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15.7	174	19,756	0.1
LIFE STORAGE INC	7	676	76,752	0.4
SELECT INCOME REIT	13.3	258	29,277	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5.9	240	27,287	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	11.882	116	13,212	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	5.3	79	9,002	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	30.5	430	48,832	0.2
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	20.2	320	36,352	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	13.9	456	51,764	0.3
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	17.3	369	41,871	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	15.9	422	47,954	0.2
VENTAS INC	54.279	3,389	384,631	1.9
CARETRUST REIT INC	12.103	240	27,301	0.1
GEO GROUP INC/THE	18.5	429	48,680	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	46.1	731	82,963	0.4
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	14.4	124	14,182	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	27.187	524	59,507	0.3
UMH PROPERTIES INC	4.2	53	6,119	0.0
IRON MOUNTAIN INC	43.6	1,471	166,971	0.8
TERRENO REALTY CORP	8.8	343	39,012	0.2
VEREIT INC	147.308	1,123	127,535	0.6
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63.6	468	53,114	0.3
SUN COMMUNITIES INC	13.1	1,346	152,807	0.8
ACADIA REALTY TRUST	11.911	338	38,356	0.2
ALEXANDER'S INC	0.6	184	20,955	0.1
PROLOGIS INC	96.202	6,462	733,339	3.7
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16.1	1,970	223,571	1.1
BRANDYWINE REALTY TRUST	26.8	377	42,786	0.2
SAUL CENTERS INC	1.7	88	9,990	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22.945	59	6,769	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	13.5	288	32,735	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	14.1	1,321	149,945	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	62.407	523	59,412	0.3
SITE CENTERS CORP	22.278	260	29,550	0.1
DUKE REALTY CORP	54.4	1,527	173,269	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	5.5	551	62,552	0.3

ファンド名	当 期 末			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10.067	2,610	296,244	1.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18.9	600	68,090	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11.2	1,465	166,343	0.8
GETTY REALTY CORP	4.903	148	16,796	0.1
WELL TOWER INC	56.9	4,064	461,183	2.3
HCP INC	71.5	2,059	233,657	1.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15.7	675	76,639	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	25	665	75,514	0.4
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	18.6	568	64,477	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	18.075	566	64,256	0.3
KILROY REALTY CORP	15.4	1,070	121,446	0.6
LIBERTY PROPERTY TRUST	22.6	1,003	113,885	0.6
LTC PROPERTIES INC	6	271	30,813	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	32	276	31,408	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17.328	1,771	200,985	1.0
MACERICH CO/THE	15.9	795	90,316	0.5
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13.6	1,324	150,322	0.8
NATL HEALTH INVESTORS INC	6.5	500	56,835	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	23.9	1,182	134,159	0.7
REALTY INCOME CORP	44.117	2,817	319,680	1.6
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16.4	402	45,666	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8.6	72	8,255	0.0
PUBLIC STORAGE	22.9	4,851	550,510	2.8
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3.1	430	48,809	0.2
REGENCY CENTERS CORP	25.82	1,622	184,049	0.9
RPT REALTY	11.7	164	18,692	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14.3	335	38,034	0.2
SL GREEN REALTY CORP	13.2	1,238	140,523	0.7
SENIOR HOUSING PROP TRUST	36.2	487	55,288	0.3
TAUBMAN CENTERS INC	9.1	476	54,014	0.3
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4.4	89	10,140	0.1
UDR INC	40.7	1,704	193,457	1.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.9	129	14,750	0.1
WP CAREY INC	24.6	1,667	189,226	1.0
WASHINGTON REIT	12	325	36,982	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17.7	502	57,019	0.3
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11.3	56	6,449	0.0
AGREE REALTY CORP	5.2	307	34,859	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30.45	1,135	128,877	0.6
CUBESMART	28.3	869	98,712	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	34.126	528	59,942	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	31.378	3,567	404,788	2.0
CEDAR REALTY TRUST INC	10.8	38	4,411	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	19.3	1,821	206,711	1.0
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5.275	99	11,336	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	16.6	87	9,907	0.0
KITE REALTY GROUP TRUST	11.95	192	21,898	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	13.4	185	21,104	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	58	6,585	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21	912	103,559	0.5
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3.6	68	7,802	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31.042	331	37,583	0.2

ファンド名	当 期 末			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	6.849	110	12,543	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	55.7	955	108,392	0.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16.3	124	14,093	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	24.6	891	101,186	0.5
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	32.9	401	45,507	0.2
アメリカ・ドル 通 貨 計	3,451.612	125,013	14,185,226	
		157銘柄		<71.3%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10.4	102	8,794	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	13.9	186	15,922	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	3.1	37	3,196	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6.4	105	9,009	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2.7	38	3,270	0.0
SLATE OFFICE REIT	5.1	36	3,093	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7.2	75	6,420	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4.5	43	3,693	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4.2	25	2,177	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3.4	186	15,924	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	7	70	6,021	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7.6	98	8,381	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	20.5	248	21,258	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1.7	29	2,532	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5.2	63	5,396	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10.3	322	27,538	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10.8	502	42,962	0.2
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13.79	146	12,497	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21.866	463	39,634	0.2
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23.8	586	50,093	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	129	11,038	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.2	134	11,450	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3.8	99	8,536	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6.5	84	7,206	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7.7	346	29,598	0.1
カナダ・ドル 通 貨 計	210.056	4,163	355,649	
		25銘柄		< 1.8%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	29.9	85	7,104	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	241.18	248	20,638	0.1
RURAL FUNDS GROUP	50.595	113	9,415	0.0
VIVA ENERGY REIT	65.55	140	11,708	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	27.82	118	9,822	0.0
PROPERTYLINK GROUP	65.67	77	6,437	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	136.26	367	30,565	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	39.307	145	12,115	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	91.935	159	13,213	0.1
INDUSTRIA REIT	11.76	32	2,686	0.0
GDI PROPERTY GROUP	69.12	87	7,235	0.0
SCENTRE GROUP	835.07	3,348	278,204	1.4
ARENA REIT	35.38	84	6,995	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21.3	67	5,609	0.0
BWP TRUST	71.56	254	21,164	0.1
DEXUS	158.28	1,714	142,413	0.7

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	オーストラリア・ドル	千円	%
GPT GROUP	279.9	1,505	125,107	0.6
INVESTA OFFICE FUND	76.69	427	35,552	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	48.78	222	18,480	0.1
MIRVAC GROUP	577.8	1,305	108,488	0.5
STOCKLAND	378.33	1,422	118,183	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP	45.88	148	12,349	0.1
GOODMAN GROUP	251.37	2,684	223,039	1.1
VICINITY CENTRES	501.13	1,368	113,660	0.6
CHARTER HALL GROUP	71.37	507	42,158	0.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP	28.46	87	7,258	0.0
オーストラリア・ドル 通 貨 計	口数、金額 26銘柄数<比率>	4,210,397 16,726	1,389,610	< 7.0%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	199	1,000	14,524	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	153	748	10,855	0.1
FORTUNE REIT	218	1,959	28,436	0.1
PROSPERITY REIT	158	456	6,625	0.0
LINK REIT	334	25,200	365,656	1.8
CHAMPION REIT	302	1,645	23,882	0.1
香 港 ド ル 通 貨 計	口数、金額 6銘柄数<比率>	1,364 31,011	449,980	< 2.3%>
(シンガポール)	千口	シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	139.728	190	15,751	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	81.2	82	6,865	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	316.7	361	29,926	0.2
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	89	121	10,033	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	242.25	254	21,084	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	434.475	764	63,383	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	396.1	1,025	85,036	0.4
CAPITALAND MALL TRUST	419.2	947	78,529	0.4
SUNTEC REIT	343.8	618	51,295	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	352.7	444	36,836	0.2
KEPPEL REIT	283.4	328	27,249	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	104.96	145	12,093	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	188.6	205	17,040	0.1
ESR-REIT	294.337	145	12,076	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	112.3	167	13,869	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	89.3	193	16,062	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	203.8	135	11,233	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	87.6	120	9,947	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	57.3	154	12,776	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267.2	52	4,363	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	191.08	359	29,776	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	145.2	102	8,485	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	294.3	488	40,494	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	127.1	77	6,426	0.0
SPH REIT	89.6	89	7,426	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	95	55	4,606	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	78.1	30	2,557	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	108.9	84	7,040	0.0
QUE HOSPITALITY TRUST	166.873	115	9,544	0.0
シンガポール・ドル 通 貨 計	口数、金額 29銘柄数<比率>	5,800.103 7,863	651,814	< 3.3%>

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	ニュージーランド・ドル	千円	%
(ニュージーランド)				
STRIDE PROPERTY GROUP	51.48	94	7,376	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	128.52	148	11,559	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	210.26	290	22,594	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	44.56	94	7,356	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	152.5	232	18,109	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	147	209	16,311	0.1
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	口数、金額 6銘柄数<比率>	734.32 1,069	83,307	< 0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	354.05	191	27,724	0.1
CAPITAL & REGIONAL PLC	59.27	21	3,171	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	86.57	81	11,837	0.1
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	97.17	80	11,638	0.1
REGIONAL REIT LTD	46.31	45	6,581	0.0
NEWRIVER REIT PLC	46.33	106	15,452	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	22.49	24	3,489	0.0
LXI REIT PLC	54.038	64	9,285	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54.33	55	8,114	0.0
RDI REIT PLC	205.18	65	9,521	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	116.581	970	140,720	0.7
HANSTEEN HOLDINGS PLC	60.79	57	8,347	0.0
SEGO PLC	156.63	963	139,684	0.7
HAMMERSON PLC	122.64	477	69,197	0.3
UNITE GROUP PLC	40.16	338	49,034	0.2
BRITISH LAND CO PLC	154.22	879	127,471	0.6
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	43.551	306	44,377	0.2
INTU PROPERTIES PLC	130.67	149	21,695	0.1
DERWENT LONDON PLC	17.13	499	72,384	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	107.56	117	17,001	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	19.36	165	24,003	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	30.81	163	23,746	0.1
SHAFTESBURY PLC	35.63	315	45,725	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	23.73	206	30,006	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	107.44	195	28,355	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	76.6	42	6,109	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	224.96	310	45,050	0.2
イギリス・ポンド 通 貨 計	口数、金額 27銘柄数<比率>	2,494.2 6,894	999,728	< 5.0%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シケル	千円	%
REIT 1 LTD	9.34	131	4,035	0.0
イスラエル・シケル 通 貨 計	口数、金額 1銘柄数<比率>	9.34 1銘柄	4,035	< 0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	49.01	70	9,054	0.0
GREEN REIT PLC	100.94	141	18,256	0.1
HIBERNIA REIT PLC	103.1	137	17,768	0.1
国 小 計	口数、金額 3銘柄数<比率>	253.05 348	45,079	< 0.2%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV	5.96	175	22,714	0.1
EUROCOMMERCIAL PROPRIETIE-CV	6.02	179	23,238	0.1
NSI NV	2.731	98	12,701	0.1

ファンド名	当 期 末			比 率
	口 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額	
VASTNED RETAIL NV	千口 2.45	千ユーロ 81	千円 10,571	% 0.1
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	17.161 535	69,225	< 0.3%>
ユーロ (ベルギー)	千口 2.798	千ユーロ 208	千円 26,929	% 0.1
AEDIFICA	2.798	208	26,929	0.1
COFINIMMO	3.21	345	44,580	0.2
BEFIMMO	3.46	175	22,707	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3.31	66	8,543	0.0
RETAIL ESTATES	1.14	83	10,839	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2.56	296	38,364	0.2
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	16.478 6銘柄	151,965	< 0.8%>
ユーロ (フランス)	千口 21.34	千ユーロ 3,300	千円 426,384	% 2.1
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21.34	3,300	426,384	2.1
ICADE	6.95	495	63,973	0.3
ALTAREA	0.54	100	12,920	0.1
GECINA SA	8.501	1,066	137,719	0.7
KLEPIERRE	32.16	939	121,401	0.6
COVIVIO	8.36	730	94,340	0.5
MERCIALYS	8.07	104	13,511	0.1
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	85.921 7銘柄	870,251	< 4.4%>
ユーロ (ドイツ)	千口 24.32	千ユーロ 299	千円 38,708	% 0.2
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	24.32	299	38,708	0.2
HAMBORNER REIT AG	11.98	106	13,697	0.1
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	36.3 2銘柄	52,405	< 0.3%>
ユーロ (スペイン)	千口 10.53	千ユーロ 90	千円 11,631	% 0.1
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10.53	90	11,631	0.1
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	45.393	402	52,016	0.3
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	56.8	639	82,662	0.4
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	112.723 3銘柄	146,310	< 0.7%>
ユーロ (イタリア)	千口 143.4	千ユーロ 105	千円 13,662	% 0.1
BENI STABILI SPA	143.4	105	13,662	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	38	4,911	0.0
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	149.64 2銘柄	18,573	< 0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	671.273 27銘柄	1,353,810	< 6.8%>
合 計	口数、金額 銘柄数<比率>	18,945.301 304銘柄	19,473,164	<97.9%>

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	167	-
STOXX 600 REAL (ドイツ)	21	-

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 156,653	% 0.8
投資信託証券	19,473,164	97.8
コール・ローン等、その他	288,310	1.4
投資信託財産総額	19,918,127	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1香港ドル=14.51円、1シンガポール・ドル=82.89円、1ニュージーランド・ドル=77.87円、1イギリス・ポンド=145.01円、1イスラエル・シケル=30.60円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (19,772,852千円) の投資信託財産総額 (19,918,127千円) に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	19,991,790,465円
コール・ローン等	202,238,842
投資信託受益証券(評価額)	156,653,278
投資信託証券(評価額)	19,473,164,421
未収入金	75,216,262
未収配当金	35,496,598
差入委託証拠金	49,021,064
(B) 負債	110,419,498
未払金	106,340,028
未払解約金	4,078,000
その他未払費用	1,470
(C) 純資産総額(A - B)	19,881,370,967
元本	8,618,915,071
次期繰越損益金	11,262,455,896
(D) 受益権総口数	8,618,915,071口
1万口当り基準価額(C/D)	23,067円

*期首における元本額は5,927,845,320円、当作成期間中における追加設定元本額は3,311,357,547円、同解約元本額は620,287,796円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) 4,302,051,362円、ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) 603,629,393円、ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) 335,779,045円、ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) 243,291,029円、D-1's グローバル R E I T インデックス1,218,954円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 33,252円、iFree 外国 R E I T インデックス76,659,750円、iFree 8資産バランス582,998,251円、DCダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド 1,729,141,932円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,185,268円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,196,103円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,417,273円、ダイワ・インデックスセレクト グローバル R E I T 263,443,683円、ダイワ・ノーロード グローバル R E I T ファンド 26,470,390円、ダイワ外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワ S M A 専用) 222,841,400円、ダイワ外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワ S M A 専用) 220,557,986円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は23,067円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	662,602,957円
受取配当金	662,322,991
受取利息	144,861
その他収益金	216,933
支払利息	△ 81,828
(B) 有価証券売買損益	62,511,068
売買益	1,107,323,975
売買損	△ 1,044,812,907
(C) 先物取引等損益	△ 6,357,605
取引益	15,801,864
取引損	△ 22,159,469
(D) その他費用	△ 23,191,549
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	695,564,871
(F) 前期繰越損益金	7,409,829,776
(G) 解約差損益金	△ 755,210,204
(H) 追加信託差損益金	3,912,271,453
(I) 合計(E + F + G + H)	11,262,455,896
次期繰越損益金(I)	11,262,455,896

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

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

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書 (全体版) 第2期

(決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30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。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/不動産投信（リート）/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産 投信指数 先物比率	純資産額
	(分配)	税 分 配 金	期 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 率				
1期末 (2017年11月30日)	円 10,273	円 0	% 2.7	10,407	% 4.1	% 0.3	% 98.9	% 0.5	百万円 312
2期末 (2018年11月30日)	10,501	0	2.2	10,745	3.2	0.8	97.9	0.9	561

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 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。

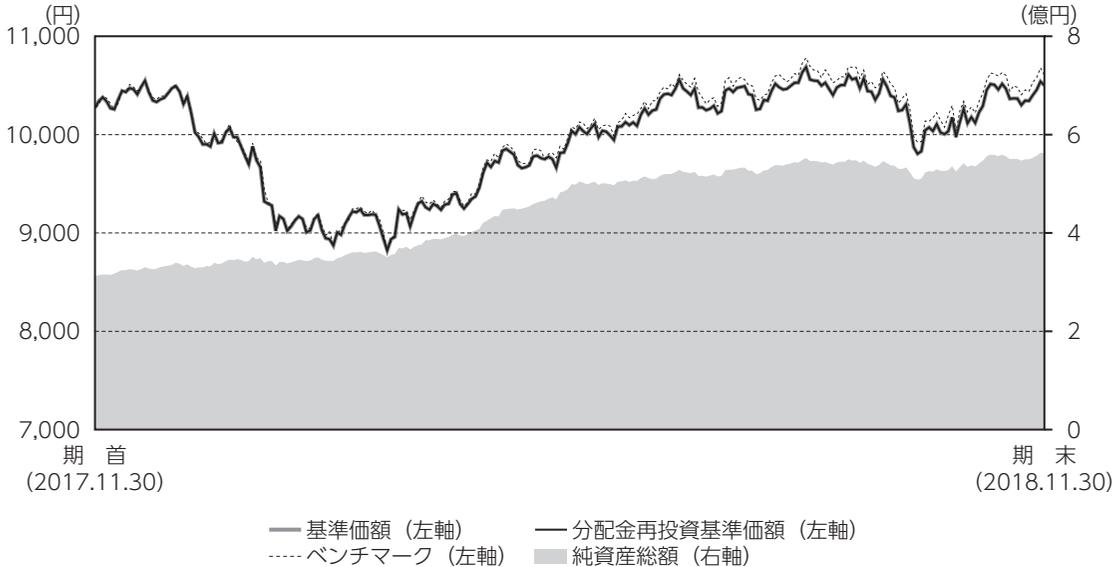
(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

S & P先進国REIT指数 (除く日本) (「当インデックス」) はS&P Dow Jones Indices LLC (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®はStandard & Poor's Financial Services LLC (「S & P」) の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数 (除く日本) の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- * ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,273円

期末：10,501円（分配金0円）

騰落率：2.2%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投 資 信 託 組 入 証 比 率	投 信 託 証 組 入 証 比 率	不 動 産 投 信 物 指 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2017年11月30日	円 10,273	% -	10,407	% -	0.3	98.9	0.5
12月末	10,493	2.1	10,646	2.3	1.0	96.9	1.2
2018年 1 月末	9,697	△ 5.6	9,855	△ 5.3	1.0	97.7	1.2
2 月末	9,029	△12.1	9,192	△11.7	0.6	98.1	1.1
3 月末	9,188	△10.6	9,350	△10.2	0.8	97.7	1.0
4 月末	9,461	△ 7.9	9,627	△ 7.5	0.8	97.8	1.0
5 月末	9,814	△ 4.5	10,012	△ 3.8	0.7	97.7	1.0
6 月末	10,201	△ 0.7	10,400	△ 0.1	0.6	98.1	1.0
7 月末	10,238	△ 0.3	10,456	0.5	1.0	97.4	1.0
8 月末	10,560	2.8	10,834	4.1	1.1	97.0	1.6
9 月末	10,420	1.4	10,643	2.3	1.5	97.1	1.0
10月末	10,262	△ 0.1	10,473	0.6	1.2	97.5	1.0
(期末) 2018年11月30日	10,501	2.2	10,745	3.2	0.8	97.9	0.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.12.1～2018.11.30)

■海外リート市況

海外リート市況は、北米やアジア・オセアニア地域を中心に上昇しました。

北米リート市況は、当作成期首よりしばらくは方向感のない動きとなりました。2018年に入ると、好調な経済指標の発表により早期利上げ観測が高まったことから長期金利が上昇し、利回り資産としてのリートに売り圧力が強まりました。5月からは、主要リートの好調な決算発表や長期金利が安定的に推移したことを受けて、上昇に転じました。その後は、長期金利が再び上昇したことや米中貿易摩擦が悪材料となり下落する局面もありましたが、当作成期末にかけて再び上昇する展開となりました。

欧州リート市況は、当作成期首より、好調な不動産ファンダメンタルズや大手商業施設リートに対する買収観測などが好材料となり、フランスやドイツを中心として総じて堅調に推移しました。しかし2018年に入ると、堅調な景気を受けた長期金利の上昇や米国株式の急落から、売られる展開となりました。4月からは急落の反動で緩やかな上昇に転じました。8月以降は、英国のEU（欧州連合）離脱方法に関する政治懸念が強まったことや、フランスリートの業績懸念が強まったことで売られる展開となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、2018年に入るとリスク回避の動きから売られましたが、4月以降はリートの好業績に支えられて緩やかな上昇に転じました。その後は、中国株の下落や商業施設リートの業績懸念などもあり軟調な展開となりましたが、当作成期末にかけて再び上昇する展開となりました。シンガポールについては、不動産の供給増が悪材料となり同地域の中では軟調な推移となりました。

■為替相場

為替相場は、まちまちな展開となりました。

米ドルは、2018年に入ると、米国財務長官の米ドル安容認発言や株急落によるリスク回避の動きを受けて、米ドル安となりました。3月下旬からは、米中貿易摩擦への懸念が後退したことでリスク選好の動きが強まったことや米国の金利が上昇したことを受けて、上昇に転じました。その後は、米中貿易摩擦が悪材料となって下落する局面もありましたが、米国金利の上昇もあり底堅い推移となりました。

ユーロは、当作成期首からしばらくは、欧州金利の上昇を受けてやや上昇しました。しかし、2018年2月からはリスク回避の動きを受けて下落に転じ、5月にはイタリアの政局混迷を受けてさらに売られました。6月以降は、イタリアの政治情勢への懸念が和らぎ、市場のリスク選好度が強まったことから、ユーロ高に転じました。その後はトルコの債務危機などで上昇下落が続きました。英ポンドもユーロとほぼ同じ動きとなりました。

オーストラリア・ドルは、当作成期首から、原油価格の上昇を受けて買われました。2018年2月からは、リスク回避の動きにより円が買われた結果下落し、その後も、米中貿易摩擦の激化による中国の影響を受けやすいことから、上値の重い展開となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

今後の運用につきましては、引き続き、主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

ポートフォリオについて

(2017.12.1～2018.11.30)

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）および不動産投信指数先物を組み入れました。

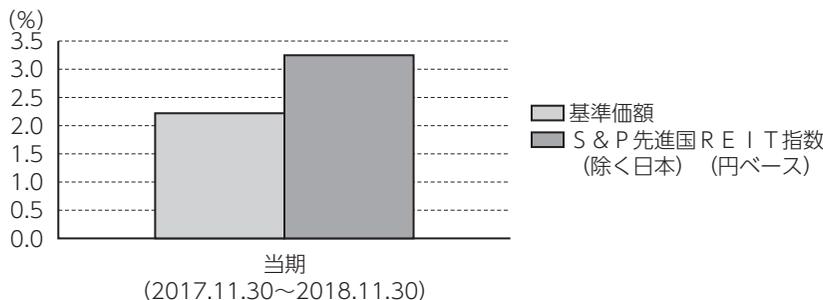
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））の騰落率は3.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.2%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年12月1日 ～2018年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	763

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

今後の運用につきましては、引き続き、主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2017.12.1~2018.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	32円	0.318%	信託報酬=当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,974円です。
(投 信 会 社)	(24)	(0.243)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	2	0.018	売買委託手数料=当作成期中の売買委託手数料/当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(出 資 証 券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(1)	(0.013)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0.022	有価証券取引税=当作成期中の有価証券取引税/当作成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
(出 資 証 券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(2)	(0.022)	
そ の 他 費 用	15	0.146	その他費用=当作成期中のその他費用/当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(8)	(0.083)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(6)	(0.057)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	50	0.504	

(注1) 当作成期中の費用(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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	112,265	240,447	7,743	17,410

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	金 額	評 価 額	□ 数	金 額	評 価 額
	千□	千円	千円	千□	千円	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	138,768	243,291	561,199			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	561,199	99.8
コール・ローン等、その他	1,273	0.2
投資信託財産総額	562,473	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=113.47円、1カナダ・ドル=85.42円、1オーストラリア・ドル=83.08円、1香港ドル=14.51円、1シンガポール・ドル=82.89円、1ニュージーランド・ドル=77.87円、1イギリス・ポンド=145.01円、1イスラエル・シケル=30.60円、1ユーロ=129.19円です。

(注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(19,772,852千円)の投資信託財産総額(19,918,127千円)に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	562,473,164円
コール・ローン等	1,273,748
ダイワ・グローバルREITイン デックス・マザーファンド(評価額)	561,199,416
(B) 負債	1,216,290
未払解約金	357,215
未払信託報酬	844,840
その他未払費用	14,235
(C) 純資産総額(A-B)	561,256,874
元本	534,454,266
次期繰越損益金	26,802,608
(D) 受益権総口数	534,454,266□
1万口当り基準価額(C/D)	10,501円

* 期首における元本額は303,982,175円、当作成期間中における追加設定元本額は333,551,014円、同解約元本額は103,078,923円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,501円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月1日 至2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 547円
受取利息	15
その他収益金	37
支払利息	△ 599
(B) 有価証券売買損益	25,613,470
売買益	27,779,238
売買損	△ 2,165,768
(C) 信託報酬等	△ 1,450,234
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	24,162,689
(E) 前期繰越損益金	7,546,464
(F) 追加信託差損益金	△ 4,906,545
(配当等相当額)	(9,115,307)
(売買損益相当額)	(△14,021,852)
(G) 合計(D + E + F)	26,802,608
次期繰越損益金(G)	26,802,608
追加信託差損益金	△ 4,906,545
(配当等相当額)	(9,115,307)
(売買損益相当額)	(△14,021,852)
分配準備積立金	31,709,700
繰越損益金	△ 547

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」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	24,163,176
(c) 収益調整金	9,115,307
(d) 分配準備積立金	7,546,524
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	40,825,007
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	40,825,007
(h) 受益権総口数	534,454,266口

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第14期にかかる運用状況については281～289ページをご参照ください。