

# ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ

- ダイワファンドラップ TOPIXインデックス  
ダイワファンドラップ 日経225インデックス  
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)  
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)  
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし)  
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス  
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)  
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)  
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし)  
ダイワファンドラップ J-REITインデックス  
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)  
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

---

---

## 運用報告書 (全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日~2019年6月17日)

---

---

#### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」は、このたび、第3期の決算を行ないました。

ここに、当作成期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)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<4641>  
<4642>  
<2731>  
<2732>  
<2730>  
<4643>  
<2734>  
<2735>  
<2733>  
<4640>  
<2736>  
<2737>

# ダイワファンドラップ TOP I Xインデックス

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17日)

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を東証株価指数（TOP I X）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、分配を行な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、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOP I X）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）

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

<4641>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(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 6 月15日)	円 11,964	円 0	% 19.6	1,588.09	% 17.7	% 98.8	% 1.2	百万円 4,959
2 期末(2018年 6 月15日)	円 13,726	円 0	% 14.7	1,789.04	% 12.7	% 98.7	% 1.2	百万円 8,562
3 期末(2019年 6 月17日)	円 12,045	円 0	% △12.2	1,539.74	% △13.9	% 98.5	% 1.5	百万円 8,839

(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。

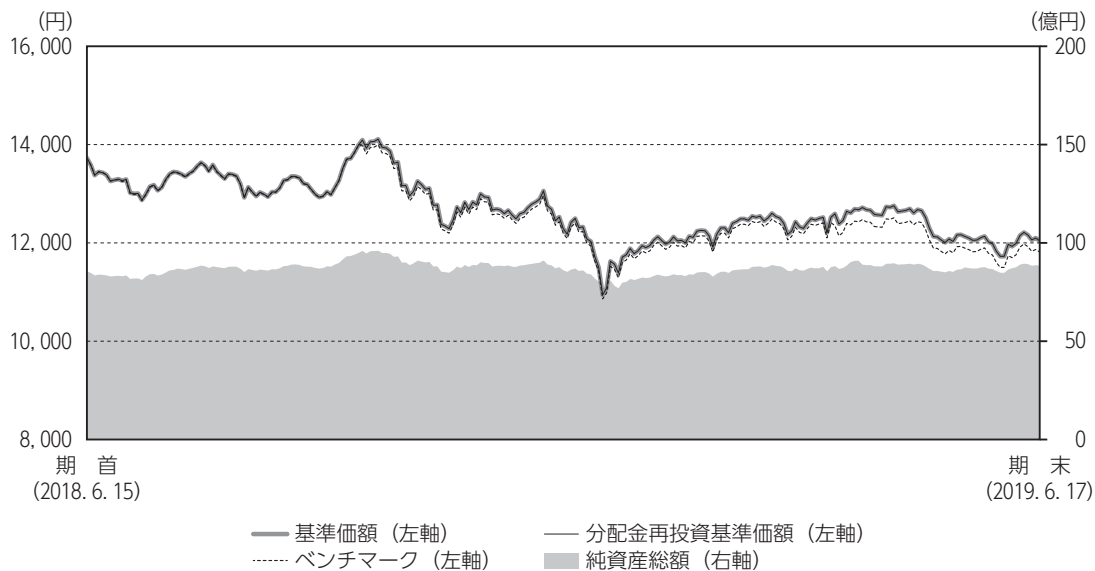
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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TOPIXです。

### ■ 基準価額・騰落率

期首：13,726円

期末：12,045円（分配金0円）

騰落率：△12.2%（分配金込み）

### ■ 基準価額の主な変動要因

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の株式に投資した結果、株式市況が下落したことを反映して、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %		
(期首)2018年6月15日	13,726	—	1,789.04	—	98.7	1.2
6月末	13,293	△ 3.2	1,730.89	△ 3.3	99.4	0.6
7月末	13,462	△ 1.9	1,753.29	△ 2.0	99.3	0.7
8月末	13,322	△ 2.9	1,735.35	△ 3.0	98.7	1.3
9月末	14,058	2.4	1,817.25	1.6	98.7	1.3
10月末	12,727	△ 7.3	1,646.12	△ 8.0	98.4	1.6
11月末	12,892	△ 6.1	1,667.45	△ 6.8	98.7	1.3
12月末	11,568	△ 15.7	1,494.09	△ 16.5	99.3	0.9
2019年1月末	12,135	△ 11.6	1,567.49	△ 12.4	99.1	0.8
2月末	12,446	△ 9.3	1,607.66	△ 10.1	99.5	0.7
3月末	12,453	△ 9.3	1,591.64	△ 11.0	97.9	2.1
4月末	12,657	△ 7.8	1,617.93	△ 9.6	98.7	1.3
5月末	11,830	△ 13.8	1,512.28	△ 15.5	98.4	1.6
(期末)2019年6月17日	12,045	△ 12.2	1,539.74	△ 13.9	98.5	1.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

## 投資環境について

(2018.6.16～2019.6.17)

### 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、米国の保護主義的な政策への警戒感が強い一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったことなどから、横ばい圏で推移しました。2018年9月半ばからは、米中通商協議に関していったん悪材料は出尽くした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が、10月には、米国長期金利の上昇に対する懸念などが嫌気されて、株価は下落しました。12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、さらに下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことを好感し、株価は反発しました。5月に入ると、米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したことなどにより不透明感が高まり、株価は不安定な動きとなりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

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

### トピックス・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマーク（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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■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、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TOPIXと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定するシステムの手法）を用いて構築しています。

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

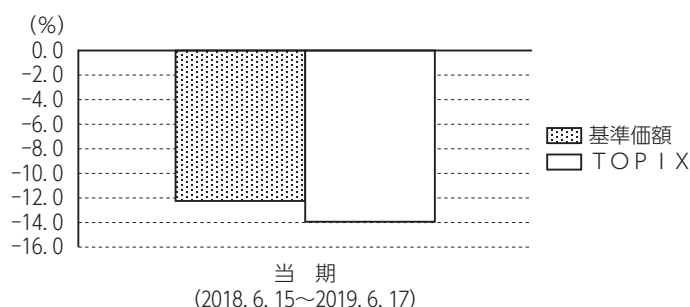
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマーク（TOPIX）の騰落率は△13.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△12.2%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TOPIXの騰落率との差異、先物取引の影響、信託報酬等のコストがかい離の要因として挙げられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、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	
	2018年6月16日 ～2019年6月17日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,045

- (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 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	43円	0.337%	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12,686円です。
(投信会社)	(26)	(0.206)	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)	(14)	(0.109)	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	44	0.344	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17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	2,430,355	2,524,784	1,116,941	1,132,160

(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

(2018年6月16日から2019年6月17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	26,866,703千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	138,726,966千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.19

(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) 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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 18,540	百万円 1,028	% 5.5	百万円 8,326	百万円 1,256	% 15.1
株式先物取引	21,722	2,464	11.3	21,235	1,398	6.6
コール・ローン	3,746,325	—	—	—	—	—

平均保有割合6.2%  
※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

(2018年6月16日から2019年6月17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 27	百万円 19	百万円 227

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2018年6月16日から2019年6月17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 15	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	101千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10千円
(B) / (A)	10.1%

(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	当 期 末		
	期 首 口 数	口 数	評 価 額
トピックス・インデックス・マザーファンド	千口 7,617,246	千口 8,930,660	千円 8,838,674

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
トピックス・インデックス・マザーファンド	千円 8,838,674	% 99.8
コール・ローン等、その他	15,158	0.2
投資信託財産総額	8,853,833	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

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,853,833,202円
コール・ローン等	15,008,455
トピックス・インデックス・マザーファンド (評価額)	8,838,674,747
未収入金	150,000
(B) 負債	14,533,665
未払信託報酬	14,300,569
その他未払費用	233,096
(C) 純資産総額 (A - B)	8,839,299,537
元本	7,338,540,787
次期繰越損益金	1,500,758,750
(D) 受益権総口数	7,338,540,787口
1万口当り基準価額 (C / D)	12,045円

\* 期首における元本額は6,237,886,759円、当作成期間中における追加設定元本額は2,901,918,904円、同解約元本額は1,801,264,876円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,045円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 9,637円
受取利息	1,391
支払利息	△ 11,028
(B) 有価証券売買損益	△ 939,193,472
売買益	170,072,079
売買損	△ 1,109,265,551
(C) 信託報酬等	△ 29,704,570
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 968,907,679
(E) 前期繰越損益金	648,706,533
(F) 追加信託差損益金	1,820,959,896
(配当等相当額)	( 619,133,434)
(売買損益相当額)	( 1,201,826,462)
(G) 合計 (D + E + F)	1,500,758,750
次期繰越損益金 (G)	1,500,758,750
追加信託差損益金	1,820,959,896
(配当等相当額)	( 619,133,434)
(売買損益相当額)	( 1,201,826,462)
分配準備積立金	648,712,408
繰越損益金	△ 968,913,554

(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	852,061,854
(d) 分配準備積立金	648,712,408
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,500,774,262
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,500,774,262
(h) 受益権総口数	7,338,540,787口

## &lt;補足情報&gt;

当ファンド（ダイワファンドラップ TOPIXインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（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（2019年6月17日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を7～13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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
武田薬品	328.4	1,473,539	4,487	トヨタ自動車	66.7	436,887	6,550
ソフトバンク	635.5	868,645	1,366	ソフトバンクグループ	22.8	206,118	9,040
トヨタ自動車	55.5	379,990	6,846	N T T ドコモ	59.2	145,089	2,450
日本郵政	176.9	230,019	1,300	三井住友フィナンシャルG	30	128,039	4,267
三菱UFJフィナンシャルG	367.9	225,860	613	本田技研	37.4	115,165	3,079
ソニー	39	223,970	5,742	任天堂	3	113,062	37,687
ソフトバンクグループ	18.8	178,044	9,470	日本電信電話	23.1	110,480	4,782
キーエンス	2.7	164,114	60,783	リクルートホールディングス	36	106,962	2,971
日本電信電話	33.3	161,352	4,845	アステラス製薬	60.8	104,744	1,722
みずほフィナンシャルG	761.9	139,148	182	日本たばこ産業	34.4	104,441	3,036

(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、2019年6月17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（137,575,273千円）の内容です。

## (1) 国内株式

銘柄	2019年6月17日現在		銘柄	2019年6月17日現在		銘柄	2019年6月17日現在		銘柄	2019年6月17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	鉄建建設	4.1	12,423	東京エネシス	6.9	6,327	亀田製菓	3.8	18,221
極洋	2.7	7,279	西松建設	14.6	31,127	トーエネック	1.9	5,738	寿スピリッツ	6.5	33,930
日本水産	82.5	55,027	三井住友建設	49.2	30,012	住友電設	4.7	8,154	カルビー	27.8	82,593
マルハニチロ	11.9	37,663	大豊建設	4.6	12,544	日本電設工業	11.6	25,705	森永乳業	12.2	53,436
カネコ種苗	2.4	3,064	前田建設	48.5	42,292	協和エクシオ	26.7	71,422	六甲バター	4.4	8,544
サカタのタネ	10.1	32,976	佐田建設	4.6	1,697	新日本空調	5.7	9,769	ヤクルト	45.2	287,924
ホフト	6.9	12,530	ナカノフドー建設	5	2,160	九電工	13.4	42,813	明治ホールディングス	43.2	331,776
ホクリヨウ	1.1	658	奥村組	11.2	37,464	三機工業	15.3	19,094	雪印メグミルク	14.7	34,530
鉱業 (0.3%)			東鉄工業	8.2	24,764	日揮	58.6	83,387	アリマハム	8.6	17,303
住石ホールディングス	18.1	2,172	イチケン	1.2	1,963	中外炉工業	1.9	3,097	日本ハム	25.2	118,440
日鉄鉱業	1.9	8,569	富士ピー・エス	2.7	1,225	ヤマト	6.1	3,483	林兼産業	1.8	1,090
三井松島 HLDGS	3.4	4,511	浅沼組	2.4	8,364	太平洋電業	4.6	9,600	丸大食品	6.5	12,421
国際石油開発帝石	331.1	305,770	戸田建設	78.8	47,043	高砂熱学	16.5	28,825	S Foods	5.5	20,212
石油資源開発	11.9	27,524	熊谷組	9.7	29,730	三晃金属	0.8	1,944	伊藤ハム米久 HLDGS	39.3	27,195
K&O エナジーグループ	4	6,456	青木あすなろ建設	3.6	2,919	朝日工業社	1.4	3,719	サッポロホールディングス	22.3	50,754
建設業 (2.9%)			北野建設	1.4	3,725	明星工業	12.3	8,154	アサヒグループホールディングス	127.7	627,900
ヒノキヤグループ	2.3	5,050	植木組	0.8	1,708	大気社	9.3	30,364	キリンHD	275.9	632,500
ショーボンドHD	5.9	45,843	矢作建設	9.1	6,697	ダイダン	4.5	9,846	宝ホールディングス	45.7	51,869
ミライト・ホールディングス	23.2	38,720	ピーエス三菱	7	4,347	日比谷総合設備	6.1	11,370	オエノンホールディングス	17.1	6,190
タマホーム	4.4	4,769	日本ハウス HLDGS	12.9	5,276	東芝プラントシステム	14.7	30,032	養命酒	1.9	3,832
サンヨーホームズ	1.4	919	大東建託	24.2	336,622	OSJB HD	29.9	8,043	コカ・コーラボトランスHD	46.7	126,603
日本アクア	2.6	1,300	新日本建設	8.2	7,355	東洋エンジニア	8	3,744	サントリー食品インター	40.8	186,660
ファーストコーポレーション	2.4	1,860	NIPPO	18	38,502	千代田化工建	49	15,778	ダイドールグループHD	3.4	15,606
ベステラ	1.6	2,072	東亜道路	1.2	3,762	新興プラントテック	12.2	16,323	伊藤園	18.5	96,755
スペースバリューHD	10	4,980	前田道路	21.3	46,199	食料品 (4.2%)			キーコーヒー	6	12,612
ダイセキ環境ソリューション	1.5	925	日本道路	1.8	11,358	日本製粉	19.3	34,083	ユニカフェ	1.8	1,767
第一カッター興業	1	1,777	東亜建設	5.9	8,891	日清製粉G本社	69	173,949	ジャパンフーズ	0.8	957
安藤・岡	52.9	39,992	日本国土開発	11.1	5,638	日本甜菜糖	0.4	2,244	日清オйлオグループ	7.8	24,414
東急建設	24.1	17,858	若築建設	3.4	4,535	昭和産業	5.6	17,248	不二製油グループ	14.9	46,413
コムシスホールディングス	29.3	79,403	東洋建設	24.9	10,482	鳥越製粉	5.3	4,441	かどや製油	0.7	2,733
ミサワホーム	6.8	6,942	五洋建設	80.9	41,501	中部飼料	7.4	8,843	J-オイルミルズ	3.1	12,632
ビーアールホールディングス	8.8	2,904	世紀東急	9.9	6,088	フィード・ワン	40.9	7,321	キッコーマン	40.3	186,992
高松コンストラクションGP	5.1	11,577	福田組	2.2	10,065	東洋精糖	0.9	886	味の素	134.7	254,919
東建コーポレーション	2.5	16,600	住友林業	48.3	60,568	日新製糖	3.4	6,514	キューピー	34	81,464
ソネック	0.8	625	日本基礎技術	6.8	2,414	三井製糖	4.8	11,179	ハウス食品G本社	22.8	95,760
ヤマウラ	3	2,544	巴コーポレーション	8.3	3,037	塩水港精糖	6.5	1,345	カゴメ	24.4	60,097
大成建設	67.8	274,590	大和ハウス	188.5	631,852	焼津水産化工	2.9	5,307	焼津水産化工	2.9	3,178
大林組	204.1	211,651	ライト工業	13.1	18,785	森永製菓	15.3	80,019	アリアケジャパン	5.6	38,976
清水建設	208.2	190,503	積水ハウス	208.3	374,315	中村屋	1.6	6,720	ピエトロ	0.7	1,127
飛鳥建設	5.8	7,679	日特建設	5.7	3,397	江崎グリコ	18.3	88,663	エバラ食品工業	1.4	2,986
長谷工コーポレーション	85.1	93,269	北陸電気工事	3.3	2,900	名糖産業	2.9	4,120	ニチレイ	31.7	87,301
松井建設	7.4	4,676	ユアテック	11	8,283	井村屋グループ	2.6	5,449	東洋水産	31.4	136,747
銭高組	0.8	3,460	四電工	1	2,685	不二家	3.4	6,701	イートアンド	2.1	3,469
鹿島建設	159.6	240,517	中電工	8.8	20,037	山崎製パン	49.9	76,596	大冷	0.7	1,276
不動テトラ	5	6,720	関電工	31	27,714	第一屋製パン	1.1	1,111	ヨシムラ・フード・HLDGS	1.6	1,504
大木建設	2.4	2,215	きんでん	45.3	75,243	モロゾフ	1	4,860	日清食品HD	25.9	174,825















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

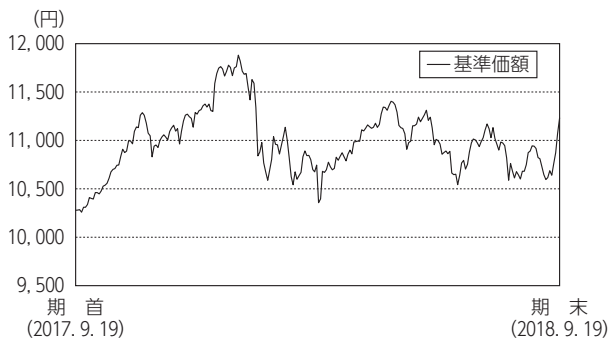
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

## ■当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		TOPIX (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先比率
	円	%	円	%		
(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議決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まいります。

## ◆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もの要因に分解し、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まいります。

## ■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。











銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																					
	株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																			
小田急電鉄	88.6	87.5	236,775	インターネットアジアティブ	9.1	10.6	23,913	山下医科器械	4	—	—	アルコニックス	8.6	7.4	11,692	神戸物産	3.9	4.5	24,570	ベッパーフードサービス	—	4.8	19,032	あいホールディングス	8.2	9.6	24,192	ディー・ブイエックス	5.4	5.7	8,082	ダイワボウHD	52	5.1	36,363	マクニカ・富士エレクトロニクス	10.3	11	21,967	パイタルKSKHD	9.5	10.7	13,621	UKCホールディングス	4.6	4.1	11,057	TOKAIホールディングス	25.1	31.6	34,602	三洋貿易	4.7	3.9	8,338	ウイン・パートナーズ	6.3	5.4	7,014	シッパヘルスケアHD	10.2	11.6	47,502	メダホールディングス	10.4	11.8	26,432	小野建	5.5	6	10,674	佐島電機	8.5	7.5	7,342	伯東	5.3	4.3	6,819	コンドーテック	7.7	10.4	11,263	ナガイレーベン	7.4	8.4	21,646	三菱食品	5.5	5.8	17,603	松田産業	4.6	5.5	8,591	第一興商	8.9	8.4	44,604	メディアパルHD	55.1	56.2	128,417	萩原電気HLDGS	3.5	2.9	9,657	アズワン	4.2	4.7	39,433	シモジマ	4.9	—	—	ドウシシャ	6.8	6.5	14,885	小津産業	4	5.5	10,983	黒田電気	7.3	—	—	丸文	5.8	7	6,006	ハビネット	5.8	5.3	10,070	日本ライフライン	6.7	16.8	36,456	エクセル	4.2	3.5	6,520	マルカキカイ	4	3.9	8,084	IDOM	17	21	8,022	進和	5.4	4.4	9,319	ダイトロン	—	4.1	9,110	シークス	3.6	7.4	14,866	伊藤忠	405	422.7	884,499	丸紅	546.1	472.9	471,670	高島	32	4.2	8,660	長瀬産業	30	32.3	62,532	蝶理	4.8	4.3	8,819	豊田通商	61.9	62.8	256,852	兼松	121	24.5	41,821	ツカモトコーポレーション	—	6.1	7,405	三井物産	499	474	931,647	日本紙パルプ	27	2.7	12,177	日立ハイテクノロジーズ	19.3	19.8	79,299	カメイ	7.6	7.2	10,627	OUGホールディングス	27	—	—	スターゼン	2.5	2.6	12,454	山善	20.6	22.1	29,591	住友商事	344.9	361.5	678,354	内田洋行	3.2	3.3	9,824	三菱商事	414.6	404.1	1,403,439	第一実業	17	3.2	12,256	キャノンマーケティングJPN	16	16.6	39,093	西華産業	22	4.2	8,404	菱洋エレクトロ	5.2	6	10,542	ユアサ商事	5.6	5.4	21,600	神鋼商事	2.6	2	6,300	阪和興業	56	10.5	39,742	正栄食品	—	3.4	11,798	カナデン	8.9	7.1	8,612	菱電商事	10	5.3	8,957	岩谷産業	59	12.5	49,812	すてきなグループ	45	8.1	10,481	極東貿易	—	19	7,885	イワキ	—	13.3	6,889	三菱石油	15.1	14.6	20,483	稲畑産業	12.7	13.7	23,536	ワキタ	12.8	12.9	17,969	東邦ホールディングス	16.8	15.7	46,833	サンゲツ	17.7	16.7	36,957	ミツウロコグループ	9.5	8.7	7,360	シナネンホールディングス	2.7	2.4	6,715	伊藤忠エネクス	10.2	10.4	12,032	サンリオ	16.4	16	35,856	サンワテクノス	—	5.4	7,619	リョーサン	7.3	6.2	26,071	新光商事	6.9	7.3	12,278	トーヨー	3.2	4.5	9,418	三信電気	6.9	5.9	11,853	東陽テクニカ	7.4	11.5	10,603	モスフードサービス	7.2	7.2	21,348	加賀電子	5.4	5.2	12,220





## ■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
	千円	%
株式	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切捨て。

## ■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
<b>(A) 資産</b>	<b>162,304,424,316円</b>
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>(B) 負債</b>	<b>12,536,765,839</b>
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
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>149,767,658,477</b>
元本	133,322,724,900
次期繰越損益金	16,444,933,577
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>133,322,724,900口</b>
1万円当り基準価額(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-I'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 A 337,828円、ダイワ世界分  
散バランスファンド20V A 347,186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 A 4,016,770円、  
ダイワ世界分散バランスファンド30V A 8,380,481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、ダイワ世界バランスファンド40V A  
212,247,455円、ダイワ世界バランスファンド60V A 168,882,290円、ダイワ・バ  
ランスファンド35V A 9,877,017,535円、ダイワ・ワールド・バ ラ ン スファン  
ド50V A 21,077,804円、ダイワ・ワールド・バ ラ ン スファン  
ド75V A 25,269,263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・ノー  
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  
ク  
ス・  
イ  
ン  
デ  
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
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>2,926,174,471円</b>
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>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>9,540,946,202</b>
売買益	16,201,631,737
売買損	△ 6,660,685,535
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>156,581,600</b>
取引益	383,035,059
取引損	△ 226,453,459
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 788,366</b>
<b>(E) 当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>12,622,913,907</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>3,715,498,201</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 1,623,726,298</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>1,730,247,767</b>
<b>(I) 合計(E+F+G+H)</b>	<b>16,444,933,577</b>
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 日経225インデックス

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17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、投資成果を日経平均株価（日経225）の動きに連動させることをめざして運用を行ないました。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／株式／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を日経平均株価（日経225）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券	
	ストックインデックス225・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄	
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。		

## 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）

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

<4642>



## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2017年 6 月15日)	円 12,007	円 0	% 20.1	円 19,831.82	% 18.4	% 98.2	% 1.8	百万円 3,303
2 期末(2018年 6 月15日)	円 14,057	円 0	% 17.1	円 22,851.75	% 15.2	% 98.3	% 1.7	百万円 6,623
3 期末(2019年 6 月17日)	円 13,227	円 0	% △ 5.9	円 21,124.00	% △ 7.6	% 97.7	% 2.3	百万円 8,152

(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。

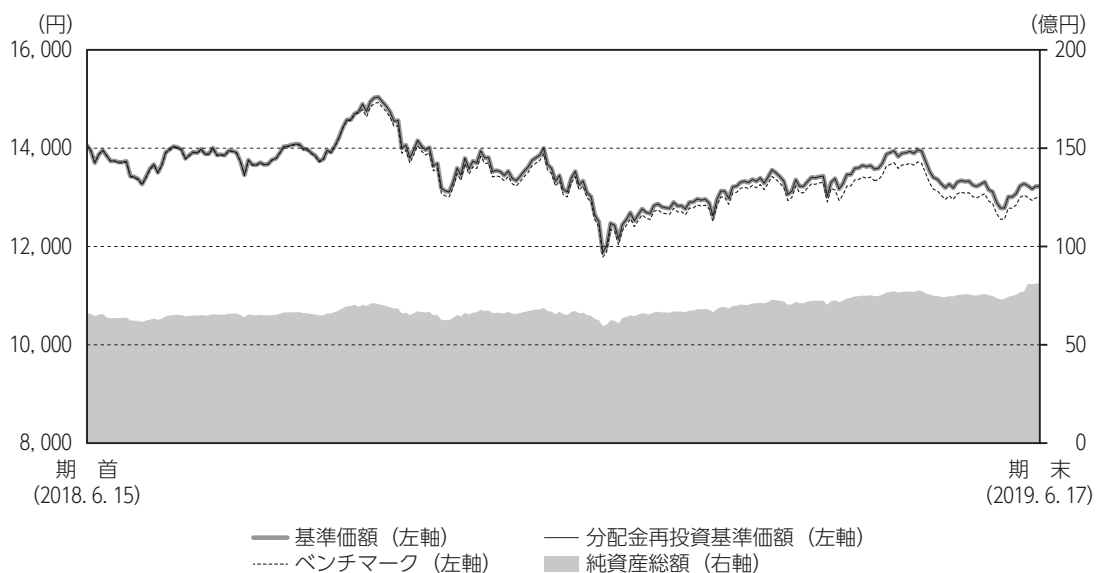
(注 3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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。

\* ベンチマークは日経平均株価です。

### ■ 基準価額・騰落率

期首：14,057円

期末：13,227円（分配金0円）

騰落率：△5.9%（分配金込み）

### ■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（日経平均株価）への連動をめざした運用を行った結果、国内株式市況が下落したことを受け、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		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%	円	%	%	%
(期首)2018年6月15日	14,057	—	22,851.75	—	98.3	1.7
6月末	13,736	△ 2.3	22,304.51	△ 2.4	98.6	1.4
7月末	13,886	△ 1.2	22,553.72	△ 1.3	98.5	1.5
8月末	14,081	0.2	22,865.15	0.1	98.8	1.2
9月末	14,949	6.3	24,120.04	5.6	98.1	1.8
10月末	13,593	△ 3.3	21,920.46	△ 4.1	98.0	2.0
11月末	13,859	△ 1.4	22,351.06	△ 2.2	98.0	2.0
12月末	12,432	△ 11.6	20,014.77	△ 12.4	98.3	1.7
2019年1月末	12,900	△ 8.2	20,773.49	△ 9.1	98.8	1.2
2月末	13,286	△ 5.5	21,385.16	△ 6.4	99.0	1.0
3月末	13,277	△ 5.5	21,205.81	△ 7.2	97.2	2.7
4月末	13,939	△ 0.8	22,258.73	△ 2.6	97.7	2.3
5月末	12,902	△ 8.2	20,601.19	△ 9.8	97.9	2.1
(期末)2019年6月17日	13,227	△ 5.9	21,124.00	△ 7.6	97.7	2.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2018.6.16～2019.6.17)

### 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、米国の保護主義的な政策への警戒感が強い一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったことなどから、横ばい圏で推移しました。2018年9月半ばからは、米中通商協議に関していったん悪材料は出尽くした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が、10月には、米国長期金利の上昇に対する懸念などが嫌気されて、株価は下落しました。12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、さらに下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことを好感し、株価は反発しました。5月に入ると、米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したことなどにより不透明感が高まり、株価は不安定な動きとなりました。

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

### ストックインデックス225・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■当ファンド

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れて運用を行いました。

### ■ストックインデックス225・マザーファンド

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

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

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

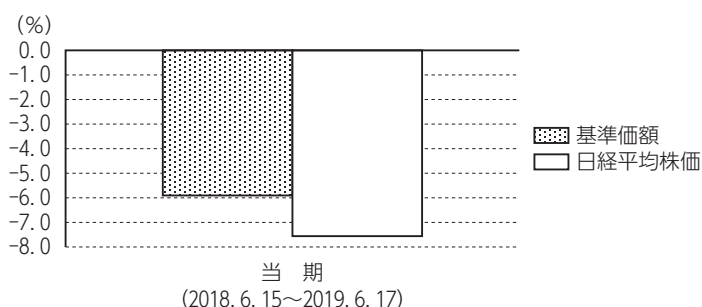
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△7.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.9%となりました。

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

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

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマーク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、収益の分配は見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2018年6月16日 ~2019年6月17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)	3,227

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ストックインデックス225・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	46円	0.337%	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13,528円です。
(投信会社)	(28)	(0.206)	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)	(15)	(0.109)	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	47	0.344	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ストックインデックス225・マザーファンド	1,011,633	2,694,150	292,181	806,590

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

項 目	当 期	
	口 数	金 額
(a) 期中の株式売買金額	73,359,367千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	163,130,568千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.44	

(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) 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

(2018年6月16日から2019年6月17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	49,843	2,433	4.9	23,515	1,156	4.9
株式先物取引	47,749	—	—	46,394	—	—
コール・ローン	388,761	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.1%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株式	50	23	137

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

種 類	当 期	
	買 付 額	期末保有額
株式	7	7

(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、大和証券グループ本社です。

■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
ストックインデックス225・マザーファンド	2,370,489	3,089,941	8,150,957

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ストックインデックス225・マザーファンド	8,150,957	99.7
コール・ローン等、その他	27,551	0.3
投資信託財産総額	8,178,508	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

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,178,508,853円
コール・ローン等	23,471,509
ストックインデックス225・マザーファンド(評価額)	8,150,957,344
未収入金	4,080,000
(B) 負債	26,167,010
未払解約金	14,077,007
未払信託報酬	11,896,259
その他未払費用	193,744
(C) 純資産総額(A-B)	8,152,341,843
元本	6,163,193,495
次期繰越損益金	1,989,148,348
(D) 受益権総口数	6,163,193,495口
1万口当り基準価額(C/D)	13,227円

\* 期首における元本額は4,712,067,908円、当作成期間中における追加設定元本額は2,731,635,338円、同解約元本額は1,280,509,751円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,227円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,837円
受取利息	554
支払利息	△ 7,391
(B) 有価証券売買損益	△ 330,690,442
売買益	57,026,138
売買損	△ 387,716,580
(C) 信託報酬等	△ 23,473,623
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 354,170,902
(E) 前期繰越損益金	608,925,229
(F) 追加信託差損益金	1,734,394,021
(配当等相当額)	( 634,621,293)
(売買損益相当額)	( 1,099,772,728)
(G) 合計 (D + E + F)	1,989,148,348
次期繰越損益金 (G)	1,989,148,348
追加信託差損益金	1,734,394,021
(配当等相当額)	( 634,621,293)
(売買損益相当額)	( 1,099,772,728)
分配準備積立金	608,929,059
繰越損益金	△ 354,174,732

- (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	1,380,229,956
(d) 分配準備積立金	608,929,059
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,989,159,015
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,989,159,015
(h) 受益権総口数	6,163,193,495口

【注記】

「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、「ダイワファンドラップ 日経225インデックス」について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日経 225インデックス）が投資対象としている「ストックインデックス 225・マザーファンド」の決算日（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（2019年6月17日）現在におけるストックインデックス 225・マザーファンドの組入資産の内容等を30～31ページに併せて掲載いたしました。

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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ファーストリテイリング	82	4,634,068	56,513	ファーストリテイリング	38	2,210,885	58,181
ソフトバンクグループ	246	2,237,826	9,096	ソフトバンクグループ	114	1,267,479	11,118
オムロン	308	1,587,816	5,155	ファナック	38	814,188	21,426
ファナック	82	1,562,539	19,055	東京エレクトロン	38	639,553	16,830
KDDI	492	1,367,032	2,778	KDDI	228	634,018	2,780
東京エレクトロン	82	1,245,934	15,194	ダイキン工業	38	533,244	14,032
ユニー・ファミリーマートHD	118	1,074,668	9,107	京セラ	76	510,539	6,717
ダイキン工業	82	1,060,438	12,932	テルモ	108	505,560	4,681
テルモ	188	1,032,662	5,492	ユニー・ファミリーマートHD	98	436,381	4,452
京セラ	164	1,005,125	6,128	TDK	38	408,178	10,741

(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、2019年6月17日現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド（65,172,307千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2019年6月17日現在		銘柄	2019年6月17日現在		銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
<b>水産・農林業 (0.2%)</b>			日本製紙	29.2	54,487	ブリヂストン	292	1,233,408
日本水産	292	194,764	<b>化学 (8.5%)</b>			<b>ガラス・土石製品 (1.2%)</b>		
マルハニチロ	29.2	92,418	クラレ	292	371,716	AGC	58.4	209,656
<b>鉱業 (0.1%)</b>			旭化成	292	328,792	日本板硝子	29.2	20,761
国際石油開発帝石	116.8	107,864	昭和電工	29.2	89,352	日本電気硝子	87.6	230,650
<b>建設業 (2.3%)</b>			住友化学	292	140,160	住友大阪セメント	29.2	127,896
コムシスホールディングス	292	791,320	日産化学	292	1,394,300	太平洋セメント	29.2	94,754
大成建設	58.4	236,520	東ソー	146	208,926	東海カーボン	292	326,456
大林組	292	302,804	トクヤマ	58.4	145,007	OTTO	146	609,550
清水建設	292	267,180	デンカ	58.4	183,668	日本碍子	292	435,664
長谷工コーポレーション	58.4	64,006	信越化学	292	2,691,364	<b>鉄鋼 (0.1%)</b>		
鹿島建設	146	220,022	三井化学	58.4	150,555	日本製鉄	29.2	53,392
大和ハウス	292	978,784	三菱ケミカル HLDGS	146	106,828	神戸製鋼所	29.2	19,826
積水ハウス	292	524,724	宇部興産	29.2	61,407	JFEホールディングス	29.2	44,092
日揮	292	415,516	日本化薬	292	375,804	大太平洋金属	29.2	61,349
千代田化工建	292	94,024	花王	292	2,474,700	<b>非鉄金属 (0.9%)</b>		
<b>食料品 (4.5%)</b>			DIC	29.2	81,263	日本軽金属HD	292	68,328
日清製粉G本社	292	736,132	富士フイルム HLDGS	292	1,572,128	三井金属	29.2	71,014
明治ホールディングス	58.4	448,512	資生堂	292	2,497,476	東邦亜鉛	29.2	69,437
日本ハム	146	686,200	日東電工	292	1,472,556	三菱マテリアル	29.2	86,461
サッポロホールディングス	58.4	132,918	<b>医薬品 (7.7%)</b>			住友鉱山	146	423,400
アサヒグループホールディング	292	1,435,764	協和発酵キリン	292	591,884	DOWAホールディングス	58.4	202,356
キリンHD	292	669,410	武田薬品	292	1,079,524	古河電工	29.2	88,330
宝ホールディングス	292	331,420	アステラス製薬	1,460	2,132,330	住友電工	292	396,244
キッコーマン	292	1,354,880	大日本住友製薬	292	601,520	フジクラ	292	107,456
味の素	292	552,610	塩野義製薬	292	1,784,120	<b>金属製品 (0.4%)</b>		
ニチレイ	146	402,084	中外製薬	292	2,046,920	SUMCO	29.2	35,069
日本たばこ産業	292	729,708	エーザイ	292	1,828,796	東洋製罐グループHD	292	653,204
<b>繊維製品 (0.2%)</b>			第一三共	292	1,779,156	<b>機械 (4.9%)</b>		
東洋紡	29.2	35,653	大塚ホールディングス	292	1,047,988	日本製鋼所	58.4	105,178
ユニチカ	29.2	10,628	<b>石油・石炭製品 (0.3%)</b>			オークマ	58.4	307,768
帝人	58.4	104,828	出光興産	116.8	352,736	アマダホールディングス	292	338,720
東レ	292	236,140	JXTGホールディングス	292	149,182	小松製作所	292	709,560
<b>パルプ・紙 (0.1%)</b>			<b>ゴム製品 (0.9%)</b>			住友重機械	58.4	205,276
王子ホールディングス	292	175,492	横浜ゴム	146	285,868	日立建機	292	822,856

銘柄	2019年6月17日現在		銘柄	2019年6月17日現在		銘柄	2019年6月17日現在													
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額												
	千株	千円		千株	千円		千株	千円												
クボタ	292	513,190	大阪瓦斯	58.4	111,018	<b>保険業 (1.0%)</b>														
荏原製作所	58.4	167,549	<b>陸運業 (2.3%)</b>			SOMPOホールディングス	73	309,301												
ダイキン工業	292	4,045,660	東武鉄道	58.4	183,668	MS & AD	87.6	306,249												
日本精工	292	261,924	東京急行	146	284,992	SONY FH	58.4	152,190												
NTN	292	87,892	小田急電鉄	146	392,448	第一生命HLDGS	29.2	47,391												
ジェイテクト	292	355,364	京王電鉄	58.4	428,072	東京海上HD	146	808,548												
日立造船	58.4	20,848	京成電鉄	146	589,110	T&Dホールディングス	58.4	66,342												
三菱重工業	29.2	135,663	東日本旅客鉄道	29.2	299,738	<b>その他金融業 (0.2%)</b>														
IHI	29.2	75,277	西日本旅客鉄道	29.2	256,376	クレディセゾン	292	362,664												
<b>電気機器 (17.4%)</b>			東海旅客鉄道	29.2	664,008	<b>不動産業 (1.7%)</b>														
日清紡ホールディングス	292	235,644	日本通運	29.2	160,600	東急不動産HD	292	175,492												
コニカミノルタ	292	296,088	ヤマトホールディングス	292	648,532	三井不動産	292	773,800												
ミネベアミツミ	292	484,428	<b>海運業 (0.1%)</b>			三菱地所	292	597,432												
日立	58.4	231,672	日本郵船	29.2	46,661	東京建物	146	171,988												
三菱電機	292	397,996	商船三井	29.2	69,058	住友不動産	292	1,183,768												
富士電機	58.4	214,620	川崎汽船	29.2	33,550	<b>サービス業 (4.9%)</b>														
安川電機	292	956,300	<b>空運業 (0.1%)</b>			ディー・エヌ・エー	87.6	191,931												
オムロン	292	1,550,520	ANAホールディングス	29.2	106,317	電通	292	1,102,300												
ジーエス・ユアサコーポ	58.4	117,033	<b>倉庫・運輸関連業 (0.3%)</b>			サイバーエージェント	58.4	240,024												
日本電気	29.2	117,968	三菱倉庫	146	454,060	楽天	292	372,592												
富士通	29.2	220,606	<b>情報・通信業 (11.4%)</b>			リクルートホールディングス	876	3,053,736												
沖電気	29.2	37,872	ヤフー	116.8	35,740	日本郵政	292	347,772												
セイコーエプソン	584	963,016	トレンドマイクロ	292	1,443,940	東京ドーム	146	157,534												
パナソニック	292	250,419	スカパーJSATHD	29.2	12,147	セコム	292	2,748,596												
ソニー	292	1,645,420	日本電信電話	58.4	294,336	<table border="1"> <tr> <td></td> <td></td> <td>千株</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>株数、金額</td> <td>50,939.4</td> <td>168,003,484</td> </tr> <tr> <td></td> <td>銘柄数&lt;比率&gt;</td> <td>225銘柄</td> <td>&lt;97.7%&gt;</td> </tr> </table>					千株	千円	合計	株数、金額	50,939.4	168,003,484		銘柄数<比率>	225銘柄	<97.7%>
		千株	千円																	
合計	株数、金額	50,939.4	168,003,484																	
	銘柄数<比率>	225銘柄	<97.7%>																	
TDK	292	2,210,440	KDDI	1,752	4,785,588															
アルプスアルパイン	292	524,432	NTTドコモ	29.2	72,591															
横河電機	292	595,680	東宝	29.2	142,350															
アドバンテスト	584	1,476,936	NTTデータ	1,460	1,966,620															
カシオ	292	386,608	コナミホールディングス	292	1,497,960															
ファナック	292	5,629,760	ソフトバンクグループ	876	8,926,440															
京セラ	584	4,028,432	<b>卸売業 (2.1%)</b>																	
太陽誘電	292	524,140	双日	29.2	10,132															
SCREENホールディングス	58.4	228,344	伊藤忠	292	590,570															
キヤノン	438	1,379,262	丸紅	292	208,517															
リコー	292	312,440	豊田通商	292	946,080															
東京エレクトロン	292	4,165,380	三井物産	292	511,000															
<b>輸送用機器 (5.1%)</b>			住友商事	292	467,638															
デンソー	292	1,302,320	三菱商事	292	840,084															
三井E&SHD	29.2	27,126	<b>小売業 (15.2%)</b>																	
川崎重工業	29.2	72,562	J.フロントリテイリング	146	166,878															
日産自動車	292	221,306	三越伊勢丹HD	292	260,172															
いすゞ自動車	146	178,850	セブン&アイ・HLDGS	292	1,081,276															
トヨタ自動車	292	1,964,284	ユニ・ファミリーマートHD	1,168	3,112,720															
日野自動車	292	257,836	高島屋	146	161,768															
三菱自動車工業	29.2	14,600	丸井グループ	292	679,484															
マツダ	58.4	64,473	イオン	292	542,390															
本田技研	584	1,620,600	ファーストリテイリング	292	19,543,560															
スズキ	292	1,511,684	<b>銀行業 (0.7%)</b>																	
SUBARU	292	750,002	コンコルディア・フィナンシャル	292	115,340															
ヤマハ発動機	292	549,544	新生銀行	29.2	48,326															
<b>精密機器 (3.5%)</b>			あおぞら銀行	29.2	74,606															
テルモ	1,168	3,780,816	三菱UFJフィナンシャルG	292	147,080															
ニコン	292	437,416	りそなホールディングス	29.2	12,848															
オリンパス	1,168	1,440,144	三井住友トラストHD	29.2	113,296															
シチズン時計	292	153,300	三井住友フィナンシャルG	29.2	109,967															
<b>その他製品 (1.2%)</b>			千葉銀行	292	155,052															
凸版印刷	146	239,294	ふくおかフィナンシャルG	58.4	112,186															
大日本印刷	146	351,276	静岡銀行	292	234,184															
ヤマハ	292	1,495,040	みずほフィナンシャルG	292	44,208															
<b>電気・ガス業 (0.2%)</b>			<b>証券・商品先物取引業 (0.3%)</b>																	
東京電力HD	29.2	16,614	大和証券G本社	292	137,094															
中部電力	29.2	44,719	野村ホールディングス	292	101,820															
関西電力	29.2	36,354	松井証券	292	299,592															
東京瓦斯	58.4	154,088																		

(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	2019年6月17日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	3,919	—

(注) 単位未満は切捨て。



# ストックインデックス225・マザーファンド

## 運用報告書 第17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)

ストックインデックス225・マザーファンドの第17期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

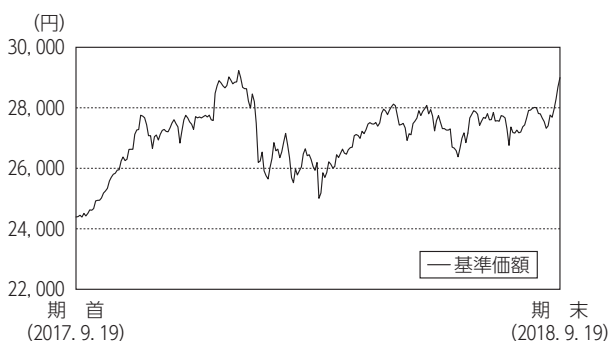
運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
運用方法	投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。 ロ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。
株式組入制限	無制限

### 大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

#### ■当期中の基準価額と市況の推移



#### 《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：24,389円 期末：28,999円 騰落率：18.9%

###### 【基準価額の主な変動要因】

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

##### ◆投資環境について

###### ○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、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。9月中旬に米中貿易摩擦への懸念が和らぐと、上昇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、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

##### ◆ポートフォリオについて

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

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

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

##### ◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は16.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.9%となりました。

- ・ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークである日経平均株価では配当金の影響が考慮されないことが、プラス要因となりました。
- ・資金の流出入に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担等が、マイナス要因となりました。

#### 《今後の運用方針》

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

年月日	基準価額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	円	%	円	%		
(期首)2017年9月19日	24,389	—	20,299.38	—	97.2	1.8
9月末	24,613	0.9	20,356.28	0.3	97.2	2.8
10月末	26,626	9.2	22,011.61	8.4	98.1	1.9
11月末	27,495	12.7	22,724.96	11.9	97.6	2.4
12月末	27,580	13.1	22,764.94	12.1	97.7	2.3
2018年1月末	27,989	14.8	23,098.29	13.8	98.0	1.9
2月末	26,765	9.7	22,068.24	8.7	97.8	2.2
3月末	26,214	7.5	21,454.30	5.7	98.0	2.1
4月末	27,462	12.6	22,467.87	10.7	98.0	2.0
5月末	27,143	11.3	22,201.82	9.4	97.6	2.5
6月末	27,303	11.9	22,304.51	9.9	98.6	1.4
7月末	27,609	13.2	22,553.72	11.1	98.5	1.5
8月末	28,005	14.8	22,865.15	12.6	98.8	1.2
(期末)2018年9月19日	28,999	18.9	23,672.52	16.6	97.9	1.1

(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。

■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	1

(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 9,299.6 (△ 7,336.8)	千円 30,367,771 ( ー)	千株 8,566.9	千円 27,206,861

(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 42,950	百万円 44,114	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9月20日から2018年9月19日まで)

銘 柄	当 期			期			
	買 付	株 数	金 額	売 付	株 数	金 額	
		千株	千円		千株	千円	
			円			円	
ファーストリテイリング	48	2,167,229	45,150	ファーストリテイリング	46	1,900,611	41,317
リクルートホールディングス	864	2,163,470	2,504	ソフトバンクグループ	138	1,327,666	9,620
ソフトバンクグループ	144	1,248,434	8,669	ファナック	46	1,106,318	24,050
ファナック	48	1,219,059	25,397	東京エレクトロン	46	857,742	18,646
東京エレクトロン	48	941,421	19,612	KDDI	276	831,705	3,013
KDDI	288	808,922	2,808	京セラ	92	653,865	7,107
京セラ	96	604,820	6,300	ダイキン工業	46	580,818	12,626
ダイキン工業	48	601,392	12,529	信越化学	46	488,696	10,623
テルモ	96	544,624	5,673	テルモ	92	478,152	5,197
信越化学	48	524,609	10,929	日東電工	46	432,894	9,410

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内株式

銘 柄	期 首		当 期 末		銘 柄	期 首		当 期 末		銘 柄	期 首		当 期 末	
	株 数	株 数	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	
<b>水産・農林業 (0.2%)</b>					<b>味の素</b>					<b>日本化薬</b>				
日本水産	250	252	161,532		ニチレイ	250	252	481,950		花王	250	252	2,281,860	
マルハニチロ	25	25.2	102,438		日本たばこ産業	250	252	753,480		富士フィルム HLDGS	250	252	1,287,468	
<b>鉱業 (0.1%)</b>					<b>繊維製品 (0.2%)</b>					資生堂	250	252	1,997,856	
国際石油開発帝石	100	100.8	138,448		東洋紡	250	25.2	47,527		日東電工	250	252	2,146,032	
<b>建設業 (2.5%)</b>					ユニチカ	250	25.2	17,791		<b>医薬品 (8.5%)</b>				
コムシスホールディングス	250	252	817,740		帝人	50	50.4	111,535		協和発酵キリン	250	252	528,444	
大成建設	250	50.4	252,504		東レ	250	252	218,383		武田薬品	250	252	1,180,872	
大林組	250	252	274,176		<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>					アステラス製薬	1,250	1,260	2,528,190	
清水建設	250	252	252,252		王子ホールディングス	250	252	205,632		大日本住友製薬	250	252	611,604	
長谷工コーポレーション	50	50.4	75,297		日本製紙	25	25.2	51,206		塩野義製薬	250	252	1,818,432	
鹿島建設	250	252	202,356		北越コーポレーション	250	—	—		中外製薬	250	252	1,758,960	
大和ハウス	250	252	831,852		<b>化学 (8.8%)</b>					エーザイ	250	252	2,657,340	
積水ハウス	250	252	436,716		クラレ	250	252	413,784		第一三共	250	252	1,154,160	
日揮	250	252	605,556		旭化成	250	252	425,880		大塚ホールディングス	250	252	1,364,076	
千代田化工建	250	252	213,948		昭和電工	25	25.2	136,080		<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>				
<b>食料品 (4.5%)</b>					住友化学	250	252	162,540		昭和シエル石油	250	252	611,604	
日清製粉G本社	250	252	583,128		日産化学	250	252	1,512,000		JXTGホールディングス	250	252	210,420	
明治ホールディングス	50	50.4	375,480		東ソー	250	126	216,972		<b>ゴム製品 (0.9%)</b>				
日本ハム	250	126	510,300		トクヤマ	250	50.4	154,980		横浜ゴム	125	126	300,384	
サッポロホールディングス	50	50.4	117,784		デンカ	250	50.4	192,024		ブリヂストン	250	252	1,069,740	
アサヒグループホールディングス	250	252	1,241,352		信越化学	250	252	2,477,916		<b>ガラス・土石製品 (1.5%)</b>				
キリンHD	250	252	732,564		三井化学	250	50.4	143,035		A G C	50	50.4	238,392	
宝ホールディングス	250	252	383,544		三菱ケミカル HLDGS	125	126	127,323		日本板硝子	25	25.2	30,567	
キッコーマン	250	252	1,670,760		宇部興産	250	25.2	71,895		日本電気硝子	75	75.6	261,954	



■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	160,769,568 千円	96.6 %
コール・ローン等、その他	5,681,961	3.4
投資信託財産総額	166,451,530	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19日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>167,241,390,410円</b>
コール・ローン等	1,698,693,137
株式(評価額)	160,769,568,960
未収入金	3,877,834,313
未収配当金	105,434,000
差入委託証拠金	789,860,000
<b>(B) 負債</b>	<b>2,956,147,788</b>
未払解約金	2,089,819,500
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000
その他未払費用	28,288
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>164,285,242,622</b>
元本	56,651,695,845
次期繰越損益金	107,633,546,777
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>56,651,695,845口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	28,999円

\* 期首における元本額は56,891,999,288円、当期中における追加設定元本額は14,141,470,208円、同解約元本額は14,381,773,651円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ストックインデックスファンド225 27,895,175,418円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225V A729,679,107円、大和ストックインデックス225 ファンド9,955,023,672円、D-1's 日経225インデックス124,378,246円、iFree 日経225インデックス833,850,889円、DC・ダイワ・ストックインデックス225(確定拠出年金専用ファンド)5,332,826,806円、ダイワ・ノーロード 日経225ファンド251,076,604円、ダイワファンドラップ 日経225インデックス2,399,270,132円、ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)9,740,271円、ダイワ・インデックスセレクト 日経225 9,120,674,700円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は28,999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
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>2,657,009,415円</b>
受取配当金	2,657,812,812
受取利息	1,123
その他収益金	398,728
支払利息	△ 1,203,248
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>22,714,236,311</b>
売買益	28,423,577,616
売買損	△ 5,709,341,305
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>547,105,405</b>
取引益	902,243,165
取引損	△ 355,137,760
<b>(D) その他費用</b>	<b>817,994</b>
<b>(E) 当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>25,917,533,137</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>81,864,245,513</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 23,893,274,665</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>23,745,042,792</b>
<b>(I) 合計(E+F+G+H)</b>	<b>107,633,546,777</b>
次期繰越損益金(I)	107,633,546,777

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

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

# ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17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/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。		

### 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)

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

<2731>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配前)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
1 期末 (2017年 6月15日)	円 11,194	円 0	% 11.9	(ベンチマーク) 11,071	% 10.7	% 93.4	% 3.8	% 0.0	% 2.4	百万円 16,740
2 期末 (2018年 6月15日)	円 12,400	円 0	% 10.8	(ベンチマーク) 12,054	% 8.9	% 95.8	% 3.4	% —	% 2.3	百万円 31,820
3 期末 (2019年 6月17日)	円 12,648	円 0	% 2.0	(ベンチマーク) 12,074	% 0.2	% 91.6	% 6.0	% —	% 2.8	百万円 36,065

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注4) 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。

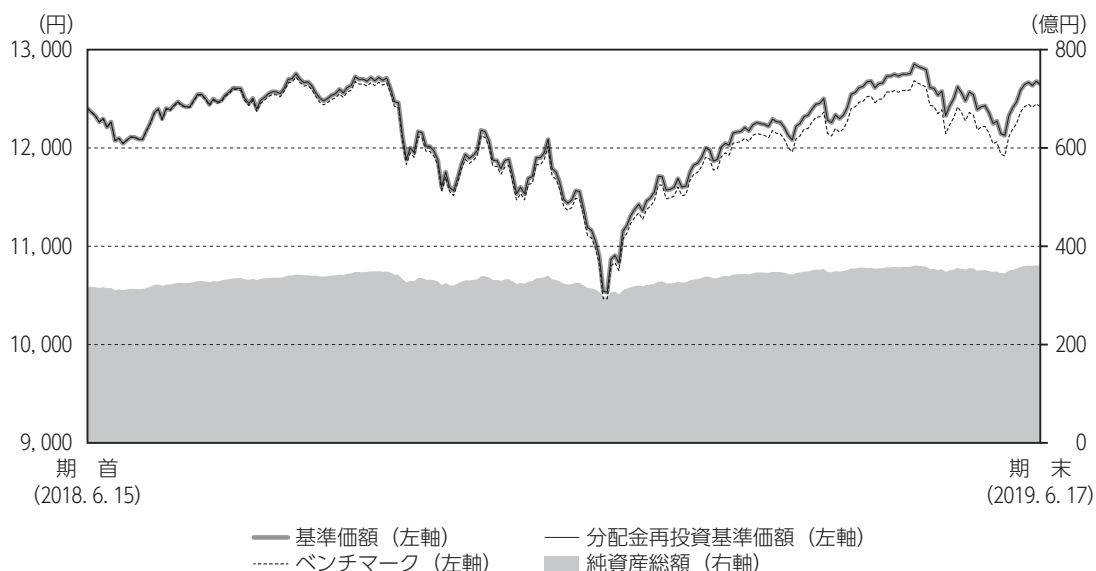
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：12,400円

期末：12,648円 (分配金 0円)

騰落率：2.0% (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った結果、米国の金融引き締め観測の後退などを好感して海外株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2018年6月15日	12,400	—	12,054	—	95.8	3.4	—	2.3
6月末	12,080	△ 2.6	11,740	△ 2.6	97.0	2.0	—	2.5
7月末	12,442	0.3	12,085	0.3	95.5	2.5	—	2.4
8月末	12,700	2.4	12,311	2.1	93.3	3.6	—	2.3
9月末	12,717	2.6	12,311	2.1	95.4	5.0	—	2.3
10月末	11,693	△ 5.7	11,321	△ 6.1	93.0	3.6	—	2.5
11月末	11,901	△ 4.0	11,497	△ 4.6	91.5	6.8	—	2.5
12月末	10,906	△ 12.0	10,531	△ 12.6	91.6	2.6	—	2.5
2019年1月末	11,752	△ 5.2	11,341	△ 5.9	90.5	6.9	—	2.5
2月末	12,240	△ 1.3	11,789	△ 2.2	91.6	7.5	—	2.6
3月末	12,335	△ 0.5	11,854	△ 1.7	94.4	2.2	—	2.8
4月末	12,813	3.3	12,288	1.9	96.0	2.1	—	2.7
5月末	12,274	△ 1.0	11,725	△ 2.7	92.2	3.0	—	2.8
(期末)2019年6月17日	12,648	2.0	12,074	0.2	91.6	6.0	—	2.8

(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

(2018.6.16 ~ 2019.6.17)

### ■海外株式市況

米国・欧州を中心とした海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国の通商政策をめぐる懸念が再燃したことや新興国株式市場の軟調などが逆風となり、下落基調で始まりました。2018年9月以降は、米中貿易摩擦への懸念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。2019年1月以降は、米中貿易摩擦への懸念が和らいだことや米国の金融引き締め観測の後退などが支援材料となり、堅調に推移しました。当作成期末にかけては、順調に進展しているとみられていた米中貿易協議への懸念が高まったことを受けて下落した場面もありましたが、米国の利下げ観測から反発しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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。また、保有実質外貨建資産については、為替ヘッジを行います。

## ポートフォリオについて

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（リート、株式先物を含む。）のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、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0.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.0%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、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	
	2018年6月16日 ~2019年6月17日	
当期分配金 (税込み) (円)	—	
対基準価額比率 (%)	—	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	2,648	

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





## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク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。また、保有実質外貨建資産については、為替ヘッジを行います。

### 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2018.6.16~2019.6.17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	54円	0.440%	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12,189円です。
(投信会社)	(38)	(0.309)	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)	(13)	(0.109)	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	1	0.005	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)	(0.003)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.007	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)	(0.007)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	5	0.044	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)	(4)	(0.034)	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)	(0.005)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	61	0.497	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17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	2,987,737	5,600,600	1,201,741	2,214,250

(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

(2018年6月16日から2019年6月17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	6,386,346千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	36,009,999千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17	

(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	当 期 末		
	期 首	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	16,801,363	18,587,359	36,061,336

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17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	36,061,336	99.5
コール・ローン等、その他	177,505	0.5
投資信託財産総額	36,238,841	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1香港・ドル=13.87円、1シンガポール・ドル=79.26円、1ニュージーランド・ドル=70.62円、1イギリス・ポンド=136.75円、1イスラエル・シケル=30.11円、1スイス・フラン=108.77円、1デンマーク・クローネ=16.32円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローネ=11.45円、1ユーロ=121.87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(40,360,627千円)の投資信託財産総額(42,238,393千円)に対する比率は、95.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	36,238,841,727円
コール・ローン等	155,405,158
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)	36,061,336,569
未収入金	22,100,000
(B) 負債	173,384,244
未払解約金	97,961,037
未払信託報酬	74,494,003
その他未払費用	929,204
(C) 純資産総額(A-B)	36,065,457,483
元本	28,513,883,705
次期繰越損益金	7,551,573,778
(D) 受益権総口数	28,513,883,705口
1万口当り基準価額(C/D)	12,648円

\* 期首における元本額は25,661,230,421円、当作成期間中における追加設定元本額は9,938,067,643円、同解約元本額は7,085,414,359円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,648円です。

■損益の状況

当期自2018年6月16日至2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 58,881円
受取利息	7,615
支払利息	△ 66,496
(B) 有価証券売買損益	987,983,590
売買益	1,130,832,005
売買損	△ 142,848,415
(C) 信託報酬等	△ 149,717,491
(D) 当期損益金(A+B+C)	838,207,218
(E) 前期繰越損益金	2,423,995,301
(F) 追加信託差損益金	4,289,371,259
(配当等相当額)	( 2,184,109,669)
(売買損益相当額)	( 2,105,261,590)
(G) 合計(D+E+F)	7,551,573,778
次期繰越損益金(G)	7,551,573,778
追加信託差損益金	4,289,371,259
(配当等相当額)	( 2,184,109,669)
(売買損益相当額)	( 2,105,261,590)
分配準備積立金	3,262,261,400
繰越損益金	△ 58,881

(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	838,238,043
(c) 収益調整金	4,289,371,259
(d) 分配準備積立金	2,424,023,357
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	7,551,632,659
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	7,551,632,659
(h) 受益権総口数	28,513,883,705口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2019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（2019年6月17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42～60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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.61	122,147	200,242	SHIRE PLC (ジャージー)	8.223	52,258	6,355
MICROSOFT CORP (アメリカ)	9.237	113,934	12,334	APPLE INC (アメリカ)	1.404	31,178	22,207
APPLE INC (アメリカ)	3.397	74,618	21,966	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	1.9	22,822	12,011
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.463	60,115	129,839	KEURIG DR PEPPER INC (アメリカ)	1.476	20,138	13,644
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	3.016	53,487	17,734	RELX PLC (イギリス)	8.2	19,315	2,355
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	3.152	48,758	15,469	ORACLE CORP (アメリカ)	2.933	16,595	5,658
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	5.073	44,897	8,850	CISCO SYSTEMS INC (アメリカ)	2.492	13,319	5,345
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.235	40,457	12,506	QUALCOMM INC (アメリカ)	1.846	13,194	7,147
NESTLE SA-REG (スイス)	4.132	39,784	9,628	LINDE PLC (アイルランド)	0.75	13,050	17,400
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.303	39,549	130,525	WELLS FARGO & CO (アメリカ)	2.304	12,877	5,589

(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、2019年6月17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（21,623,237千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2019年6月17日現在		業 種 等
		評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	11	143	15,556	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	10.03	203	22,155	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	16.59	139	15,111	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	71	7,794	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	210	22,871	金融
ABBOTT LABORATORIES	168.44	1,384	150,484	ヘルスケア
ARCONIC INC	39.5	90	9,863	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	15.96	232	25,290	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	32.29	184	20,097	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	31.88	300	32,666	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33.53	407	44,230	情報技術
QORVO INC	11.79	72	7,878	情報技術
AFLAC INC	70.68	389	42,271	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	149	16,229	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18.35	117	12,759	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	48.06	1,318	143,234	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17.5	80	8,747	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	10.08	178	19,354	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	72	7,828	金融
GARMIN LTD	13.18	105	11,427	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22.04	483	52,507	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	70.31	1,215	132,024	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	17.1	217	23,647	情報技術
WR BERKLEY CORP	17.71	116	12,627	金融
AUTOZONE INC	2.4	268	29,204	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	23.99	264	28,755	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	96.83	79	8,669	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	9	87	9,532	公益事業
CELANESE CORP	12.97	135	14,683	素材
DR HORTON INC	33.06	151	16,510	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	12.49	45	4,983	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	139	15,113	ヘルスケア
AUTODESK INC	22.03	348	37,860	情報技術
MOODY'S CORP	17.82	342	37,235	金融
DEVON ENERGY CORP	48.68	125	13,631	エネルギー
ALBEMARLE CORP	8	56	6,161	素材
ATMOS ENERGY CORP	10.5	110	11,978	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	22	110	11,952	公益事業
CITIGROUP INC	231.76	1,563	169,935	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	43.63	722	78,479	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	44.53	403	43,828	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	2019年6月17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		
ALLEGHANY CORP	1.38	95	10,359	金融
DOMINO'S PIZZA INC	3	84	9,148	一般消費財・サービス
HESS CORP	28.96	165	18,015	エネルギー
DAVITA INC	10	48	5,311	ヘルスケア
DANAHER CORP	61.31	856	93,020	ヘルスケア
FORTIVE CORP	30.44	235	25,577	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	53.14	451	49,040	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12	32	3,529	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	40	4,408	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	60.74	247	26,921	生活必需品
BUNGE LTD	18.38	106	11,555	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	32.46	294	31,976	情報技術
APPLE INC	461.35	8,892	966,211	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	260	28,268	金融
BOEING CO/THE	52.73	1,830	198,910	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14.5	150	16,313	金融
BECTON DICKINSON AND CO	24.93	583	63,431	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	30	3,266	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	110	11,993	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	53	5,807	情報技術
NISOURCE INC	40.26	115	12,577	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10.5	87	9,549	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	83.81	372	40,516	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	401.97	2,342	254,555	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	125.79	2,580	280,419	金融
ANSYS INC	7.2	141	15,422	情報技術
H&R BLOCK INC	16	45	4,987	一般消費財・サービス
BB&T CORP	69.55	348	37,831	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	160.67	764	83,032	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	319.62	3,510	381,403	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	22.75	241	26,188	金融
LKQ CORP	33	86	9,409	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5.47	97	10,619	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26.52	149	16,212	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	26.5	179	19,499	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12.35	189	20,602	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.72	362	39,396	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	18.84	512	55,733	情報技術
CATERPILLAR INC	54.83	697	75,801	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	25	146	15,959	公益事業
MOSAIC CO/THE	30	67	7,288	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	92	10,038	資本財・サービス
CORNING INC	83.99	259	28,209	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	432.66	2,368	257,395	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12.65	78	8,534	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	125.59	537	58,434	金融
WABCO HOLDINGS INC	4.59	60	6,523	資本財・サービス
MSCI INC	7.3	172	18,702	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	124	13,487	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	4	52	5,698	資本財・サービス
COTY INC-CL A	47.57	64	7,019	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25.07	141	15,412	情報技術
BROADCOM INC	38.9	1,034	112,405	情報技術
ACUITY BRANDS INC	3.5	46	5,077	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7	49	5,326	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	109	11,884	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16.12	42	4,568	素材
DTE ENERGY COMPANY	19.33	250	27,208	公益事業
CENTENE CORP	39.08	209	22,739	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9	96	10,536	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40.5	141	15,389	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17.97	157	17,124	金融
GARTNER INC	8	126	13,785	情報技術
SPLUNK INC	13.04	154	16,753	情報技術
DOMINION ENERGY INC	76.39	585	63,631	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	44.36	272	29,562	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	14	63	6,926	資本財・サービス
DEERE & CO	30.08	455	49,520	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	16.1	255	27,782	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	8.33	140	15,232	情報技術
CHEMOURS CO/THE	14	33	3,626	素材
BURLINGTON STORES INC	7	118	12,830	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	8.5	81	8,839	金融
VAIL RESORTS INC	3.9	92	10,000	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	14.61	64	7,024	金融
TARGA RESOURCES CORP	20.29	74	8,067	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5.01	76	8,353	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	91	9,917	金融

銘柄	2019年6月17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		
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4.05	25	2,805	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	29.94	265	28,804	公益事業
COGNEX CORP	14	61	6,646	情報技術
TELEFLEX INC	4.85	155	16,876	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8.06	73	7,956	資本財・サービス
WELLCARE HEALTH PLANS INC	5	143	15,598	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12.25	201	21,913	ヘルスケア
IDEX CORP	7	111	12,145	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	76.33	559	60,836	生活必需品
ROLLINS INC	10.5	39	4,295	資本財・サービス
AMETEK INC	19.82	168	18,303	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	21.55	166	18,067	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	32	3,501	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	67	7,334	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	10.6	60	6,535	資本財・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	7.2	117	12,771	情報技術
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3.98	117	12,815	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	33.56	290	31,543	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	43.02	1,119	121,608	生活必需品
GRUBHUB INC	10	70	7,623	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	5.49	95	10,409	情報技術
AFFILIATED MANAGERS GROUP	8.78	77	8,429	金融
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2.4	177	19,313	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	28	50	5,470	金融
UGI CORP	20.85	110	12,018	公益事業
CUMMINS INC	16.04	262	28,559	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	78.59	358	38,957	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	43.26	96	10,477	情報技術
CDW CORP/DE	13	135	14,724	情報技術
SIGNATURE BANK	7.69	89	9,717	金融
COSTAR GROUP INC	3.82	209	22,815	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	4.48	97	10,620	金融
AMERCO	0.7	27	2,959	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8.26	117	12,748	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	4.8	295	32,128	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	29	48	5,227	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	115	12,533	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	28.81	269	29,245	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22.45	35	3,878	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	2.5	32	3,584	情報技術
DEXCOM INC	9	133	14,477	ヘルスケア
COPART INC	17.78	131	14,259	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	15.91	157	17,106	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	10	68	7,443	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	6.88	210	22,853	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	5	236	25,690	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	43.47	100	10,892	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	198.98	408	44,388	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	26.89	340	36,999	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3.82	122	13,284	金融
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	109	11,901	エネルギー
T-MOBILE US INC	34.49	258	28,070	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	81	8,808	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	394.38	2,023	219,880	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	25.75	146	15,875	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	143	15,641	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	12.5	51	5,615	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	128	13,959	金融
CSX CORP	73.56	567	61,682	資本財・サービス
FLUOR CORP	12.9	37	4,108	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.5	174	18,983	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	11.5	145	15,846	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	52	5,735	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	40.88	7,643	830,511	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16	27	2,964	エネルギー
FLOWSERVE CORP	9	43	4,768	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19.45	357	38,872	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	411.25	3,057	332,243	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	16.13	82	8,959	情報技術
AES CORP	50.88	86	9,448	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	8.75	215	23,461	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	3.5	87	9,547	金融
EOG RESOURCES INC	57.49	489	53,204	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	12.5	98	10,678	情報技術
ABIOMED INC	3.55	89	9,680	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	13.6	115	12,568	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34.58	241	26,290	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	375.4	374	40,709	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	2019年6月17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		
MACY'S INC	22	47	5,153	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	11	31	3,468	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	12.55	137	14,970	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	64	7,011	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	45.54	122	13,281	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	88	9,667	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	120	13,121	情報技術
MARKEL CORP	1.58	171	18,674	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	8	19	2,106	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	46.74	967	105,110	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	150.25	160	17,387	素材
US BANCORP	152	799	86,908	金融
UNITED RENTALS INC	6.61	81	8,825	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	5.5	75	8,183	情報技術
FASTENAL CO	58.14	184	19,994	資本財・サービス
FISERV INC	35	312	33,923	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	856.82	876	95,243	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	14.01	46	5,084	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	21.49	116	12,674	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	122.63	437	47,516	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	7	31	3,464	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	23.16	396	43,096	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33.29	638	69,329	金融
ALPHABET INC-CL A	28.64	3,111	338,058	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	31.19	3,385	367,836	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	8	40	4,365	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	55.56	296	32,244	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	56.61	248	27,047	公益事業
GENUINE PARTS CO	12	123	13,421	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	33.55	199	21,625	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	221	24,107	金融
HARRIS CORP	12.72	242	26,343	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	31	3,373	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	78.26	167	18,180	エネルギー
HOME DEPOT INC	110.36	2,270	246,753	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	89	9,686	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107.45	143	15,598	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3.5	75	8,168	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	13.58	187	20,410	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	14	48	5,269	一般消費財・サービス
HUMANA INC	12.88	324	35,244	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	28.26	256	27,909	情報技術
HELMERICH & PAYNE	13.36	64	7,026	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	10.6	75	8,210	ヘルスケア
HP INC	161.33	321	34,902	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	132.5	187	20,372	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	40	4,388	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	17.83	71	7,807	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13.5	49	5,360	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	74	8,041	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	36	128	13,910	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	59.73	181	19,671	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	88.04	1,189	129,290	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	173	18,904	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	81	8,803	資本財・サービス
ZOETIS INC	46.63	516	56,135	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	25.48	317	34,519	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	24.84	162	17,654	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	117	12,787	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	15.72	58	6,386	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	132	14,386	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	26.65	251	27,353	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	28.5	75	8,249	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	9	110	12,058	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	261.36	3,661	397,846	ヘルスケア
ABBVIE INC	147.1	1,157	125,777	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	145	15,813	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	35.44	487	53,007	生活必需品
KROGER CO	71.6	173	18,874	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	15.2	166	18,118	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	25.15	880	95,686	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.36	255	27,731	情報技術
L BRANDS INC	19.5	43	4,769	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	80.58	802	87,234	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	87.18	974	105,851	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	14.77	261	28,374	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	5.87	78	8,491	不動産
LOEWS CORP	25.5	136	14,835	金融

銘柄	2019年6月17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		
LINCOLN NATIONAL CORP	18	114	12,415	金融
MCDONALD'S CORP	75.03	1,540	167,368	一般消費財・サービス
3M CO	57.39	956	103,947	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	234.34	4,249	461,727	コミュニケーション・サービス
MANPOWERGROUP INC	6.5	59	6,413	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	23.87	536	58,332	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5.4	120	13,142	素材
CONCHO RESOURCES INC	18	177	19,238	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	58.32	154	16,837	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	19	61	6,730	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	45.21	386	42,046	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	45.61	103	11,269	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	156	17,008	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	24.29	125	13,650	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10.29	161	17,509	生活必需品
MYLAN NV	48.88	83	9,039	ヘルスケア
METLIFE INC	75.19	367	39,878	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	61.24	145	15,857	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	5.93	139	15,211	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13.49	58	6,388	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14.35	230	25,002	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.1	166	18,050	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	55.56	123	13,372	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	11	172	18,709	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	5.12	19	2,139	金融
MERCK & CO. INC.	253.93	2,102	228,406	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	75.09	563	61,259	素材
MASCO CORP	35.43	135	14,740	資本財・サービス
M & T BANK CORP	13.23	222	24,136	金融
MARSH & MCLENNAN COS	50.16	492	53,511	金融
HEICO CORP-CLASS A	7.07	71	7,733	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	27.83	372	40,424	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	15.62	324	35,303	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	6	94	10,314	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	36.26	259	28,206	情報技術
TRANSUNION	20.29	143	15,635	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	42.85	101	11,067	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	11	36	4,005	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	28.76	354	38,488	情報技術
BEIGENE LTD-ADR	3.5	41	4,473	ヘルスケア
NETAPP INC	23	140	15,239	情報技術
NIKE INC -CL B	124.89	1,042	113,232	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	25.53	497	54,022	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20.5	170	18,530	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10.5	86	9,419	金融
ALLY FINANCIAL INC	50.94	148	16,168	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	16.06	496	53,997	資本財・サービス
APTIV PLC	26.8	201	21,936	一般消費財・サービス
NEWMONT GOLDCORP CORP	77.47	278	30,245	素材
MCKESSON CORP	17.69	235	25,590	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23.87	133	14,537	情報技術
XYLEM INC	19.72	159	17,373	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	151.57	1,170	127,145	生活必需品
NUCOR CORP	27	139	15,167	素材
WESTERN UNION CO	36	72	7,858	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	19.3	135	14,688	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	58	6,393	一般消費財・サービス
EVERGY INC	24	145	15,821	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	75.13	370	40,254	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	66	7,226	金融
OKTA INC	10.1	130	14,151	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	8	80	8,744	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	28.47	90	9,883	ヘルスケア
LINDE PLC	51.89	1,051	114,295	素材
WIX.COM LTD	5	71	7,765	情報技術
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	34.52	73	7,978	金融
KKR & CO INC -A	49.96	118	12,914	金融
PAYCHEX INC	33	286	31,081	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8.27	320	34,862	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	183.61	933	101,471	生活必需品
PFIZER INC	544.54	2,328	253,009	ヘルスケア
ALKERMES PLC	10.5	22	2,497	ヘルスケア
CIGNA CORP	37.26	590	64,135	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	19.17	98	10,690	情報技術
ALTICE USA INC- A	10.38	24	2,684	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	53.81	323	35,099	公益事業
STERIS PLC	8.97	125	13,687	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	15.3	53	5,812	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	2019年6月17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		
FOX CORP - CLASS A	34.5	121	13,210	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	33.79	660	71,769	ヘルスケア
DOW INC	75.09	384	41,734	素材
PARKER HANNIFIN CORP	12.39	203	22,107	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	16.48	71	7,741	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16.5	233	25,383	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	4	35	3,894	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	241.14	2,681	291,369	生活必需品
EXELON CORP	90.42	459	49,911	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	22.07	260	28,281	ヘルスケア
NVR INC	0.3	103	11,277	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	112.9	664	72,158	エネルギー
TWILIO INC - A	9.32	130	14,195	情報技術
DOCUSIGN INC	10.27	52	5,666	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	4.91	105	11,435	情報技術
PEPSICO INC	138.02	1,831	199,058	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	53	5,790	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	56	6,097	情報技術
MONGODB INC	3.9	64	7,021	情報技術
SNAP INC - A	68.89	96	10,449	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	75.09	189	20,553	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.88	425	46,234	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	247	26,884	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	62.13	1,149	124,874	情報技術
PENTAIR PLC	15.75	56	6,095	資本財・サービス
QUALCOMM INC	118.7	815	88,634	情報技術
INVESCO LTD	37	76	8,298	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	124	13,509	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	178	19,398	金融
RAYTHEON COMPANY	28.22	500	54,382	資本財・サービス
RED HAT INC	17.9	331	36,021	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	7.45	227	24,709	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	20.5	178	19,377	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.5	798	86,816	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	36.18	365	39,694	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	8.44	80	8,741	素材
RESMED INC	13.83	163	17,746	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	12	121	13,173	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	84	9,162	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	4	44	4,873	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	11.63	108	11,744	ヘルスケア
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	134	14,664	金融
CHEVRON CORP	185.41	2,239	243,391	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	31.03	184	20,041	公益事業
TESLA INC	14.05	301	32,811	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	54	104	11,359	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	15.81	223	24,310	資本財・サービス
SYNOPLYS INC	15.82	197	21,453	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16.05	629	68,378	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	28	138	15,078	不動産
TWITTER INC	71.82	259	28,211	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	98.84	550	59,767	公益事業
SYSCO CORP	50.97	368	40,014	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	24.82	372	40,483	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	53	5,860	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	60	6,605	素材
SCHLUMBERGER LTD	135.88	488	53,049	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	92	10,091	資本財・サービス
AT&T INC	709.03	2,293	249,234	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	91	9,898	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	36.27	69	7,507	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7.61	360	39,166	素材
SEMPRA ENERGY	27.68	381	41,434	公益事業
TIFFANY & CO	10.86	98	10,740	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	23.49	103	11,297	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	90.23	968	105,210	情報技術
SALESFORCE.COM INC	73.92	1,108	120,490	情報技術
WESTROCK CO	23.21	83	9,091	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	83.88	335	36,412	資本財・サービス
UNION PACIFIC CORP	69.47	1,160	126,054	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	102.44	132	14,448	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	70.61	338	36,797	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	78.79	987	107,273	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	68.76	698	75,924	資本財・サービス
UNUM GROUP	19	62	6,823	金融
SPRINT CORP	114.74	80	8,739	コミュニケーション・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	14.32	202	21,986	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	97	10,596	金融



銘柄	2019年6月17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		
AMEREN CORPORATION	28.61	219	23,847	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	93.54	2,295	249,395	ヘルスケア
VERISIGN INC	10.85	222	24,192	情報技術
VALERO ENERGY CORP	38.82	297	32,378	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	4.75	168	18,303	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	119	13,028	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	121	13,231	ヘルスケア
ANTHEM INC	25.21	719	78,158	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	175.72	2,489	270,462	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	420.71	1,918	208,411	金融
WASTE MANAGEMENT INC	42.25	484	52,602	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	125.23	337	36,726	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10.5	111	12,109	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	5	67	7,371	一般消費財・サービス
WALMART INC	141.09	1,538	167,213	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	70	7,679	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19.56	229	24,962	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	132	14,383	一般消費財・サービス
XEROX CORP	19.88	68	7,435	情報技術
WABTEC CORP	18.98	129	14,024	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	121.66	648	70,513	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.5	132	14,351	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3.5	30	3,313	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	31.29	362	39,412	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	105	11,507	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	80.64	423	46,063	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12.28	233	25,396	金融
WESTERN DIGITAL CORP	25.45	92	10,046	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	28.69	241	26,283	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	50.77	309	33,629	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	171.52	2,910	316,201	情報技術
PPL CORP	73.94	232	25,267	公益事業
PULTEGROUP INC	19	62	6,782	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	24.34	283	30,824	素材
NORTHERN TRUST CORP	20.62	179	19,531	金融
NVIDIA CORP	55.71	805	87,557	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	8.59	196	21,320	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	45.59	616	66,980	金融
QURATE RETAIL INC	42.88	55	5,977	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	24.82	98	10,655	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	32.11	263	28,578	生活必需品
NETFLIX INC	43.03	1,461	158,845	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38.51	1,098	119,366	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	104	11,337	公益事業
TORCHMARK CORP	12.15	108	11,772	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	18.56	178	19,431	金融
TEXTRON INC	22.1	109	11,874	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	29	34	3,727	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	12	52	5,659	公益事業
OMNICOM GROUP	25.46	202	21,954	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	245.68	1,308	142,234	情報技術
MASTERCARD INC - A	88.84	2,310	251,083	情報技術
ONEOK INC	37.36	240	26,167	エネルギー
CENTURYLINK INC	97.47	108	11,756	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	10.56	385	41,838	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	32.71	359	39,022	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	11.91	131	14,282	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	55	6,076	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	17.75	95	10,415	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	37.5	73	8,039	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	892.56	2,502	271,947	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13.83	111	12,148	ヘルスケア
NORDSTROM INC	8	26	2,834	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	70.28	857	93,166	金融
ANALOG DEVICES INC	33.36	347	37,706	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	95.45	289	31,488	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23.94	120	13,141	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	84.69	451	49,058	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	51.05	356	38,735	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15.69	112	12,241	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17.84	221	24,062	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	6.5	71	7,796	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	53.53	329	35,853	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	63.46	398	43,283	資本財・サービス
AON PLC	22.96	437	47,591	金融
AMGEN INC	60.83	1,071	116,385	ヘルスケア
TAPESTRY INC	25.5	75	8,185	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	41.02	321	34,931	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	2019年6月17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		
CELGENE CORP	70.24	677	73,659	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15.06	282	30,704	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	91.64	377	41,055	情報技術
CIT GROUP INC	9	45	4,908	金融
CIMAREX ENERGY CO	8	43	4,746	エネルギー
CME GROUP INC	35.41	697	75,837	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33.89	67	7,364	エネルギー
ECOLAB INC	26.46	526	57,177	素材
EQUIFAX INC	12.56	165	18,020	資本財・サービス
GAP INC/THE	28.2	51	5,570	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	125.79	834	90,703	ヘルスケア
HORMEL FOODS CORP	33.15	137	14,923	生活必需品
STATE STREET CORP	39.48	218	23,748	金融
SUNTRUST BANKS INC	46.15	297	32,379	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	115.1	472	51,290	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	51.75	403	43,821	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	13	54	5,969	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	11.45	66	7,208	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	146	15,925	ヘルスケア
FEDEX CORP	25.45	418	45,504	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45.69	413	44,965	金融
FMC CORP	11.42	91	9,916	素材
FLEX LTD	45	40	4,420	情報技術
CERNER CORP	32	231	25,115	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11.63	173	18,802	素材
CITRIX SYSTEMS INC	13.5	130	14,198	情報技術
INTEL CORP	446.02	2,060	223,857	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28	61	6,714	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	38.14	209	22,772	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	32.29	481	52,296	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	85	9,243	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	14.63	503	54,685	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	64	6,982	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	11.33	562	61,129	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12.36	140	15,219	情報技術
SNAP-ON INC	5	82	8,915	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	166	18,064	一般消費財・サービス
COMERICA INC	14.76	103	11,260	金融
INGREDION INC	5.3	43	4,699	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	69.64	611	66,491	公益事業
TARGET CORP	49.32	432	47,047	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	164	17,881	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	4	108	11,837	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11.16	87	9,495	資本財・サービス
CINTAS CORP	9.95	235	25,555	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	166	18,074	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	92	10,058	生活必需品
CLOROX COMPANY	12.78	200	21,785	生活必需品
ENTERGY CORP	21.14	215	23,439	公益事業
MICROSOFT CORP	709.09	9,391	1,020,523	情報技術
INCYTE CORP	19.93	154	16,828	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	128.96	698	75,907	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	128.89	1,256	136,550	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	113.72	371	40,357	情報技術
BLACKROCK INC	11.84	529	57,504	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	166	18,139	公益事業
HASBRO INC	10	107	11,676	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	26.2	148	16,121	生活必需品
KEYCORP	87.73	150	16,348	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	137	14,939	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	143.06	787	85,574	生活必需品
KOHL'S CORP	16.5	78	8,564	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	4.08	131	14,324	ヘルスケア
APACHE CORP	36.73	100	10,971	エネルギー
CHUBB LTD	42.88	644	70,011	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	67	7,291	情報技術
ALLSTATE CORP	34.1	348	37,845	金融
EBAY INC	90.53	352	38,275	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	108.88	1,264	137,439	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	12.83	92	10,050	素材
XILINX INC	25.83	272	29,588	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	29.84	112	12,172	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	19	85	9,265	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20.44	361	39,285	生活必需品
TRIMBLE INC	22	93	10,212	情報技術
LENNAR CORP-A	33.94	181	19,748	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	80	8,716	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	23	104	11,323	金融

銘柄	2019年6月17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	
PROGRESSIVE CORP	57.19	468	50,932	金融
PACCAR INC	35.25	246	26,819	資本財・サービス
PVH CORP	6.18	54	5,912	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	18.99	432	46,978	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	7.42	198	21,586	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	124.84	1,051	114,272	一般消費財・サービス
PTC INC	12	100	10,939	情報技術
PERRIGO CO PLC	9	38	4,222	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	34.23	264	28,792	公益事業
INTUIT INC	24.25	616	66,963	情報技術
BORGWARNER INC	15.5	63	6,896	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	23	151	16,502	一般消費財・サービス
BALL CORP	28.92	189	20,554	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131.42	531	57,720	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	30.24	280	30,469	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	12.23	162	17,620	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25.58	435	47,313	ヘルスケア
VF CORP	32.04	279	30,379	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	28.41	139	15,123	コミュニケーション・サービス
VIACOM INC-CLASS B	30.71	90	9,807	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	4.8	73	7,942	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	131	14,264	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	38.14	202	22,014	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	436.24	1,845	200,557	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	77	8,465	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	22	142	15,490	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	42	4,624	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	110	72	7,912	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、 銘柄数 < 比率 >	金額 29,636.4 615銘柄	241,569 26,248,965 <62.6%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	23	83	6,732	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	300	24,350	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24.38	42	3,420	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	21.21	192	15,623	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42	129	10,484	素材
INTACT FINANCIAL CORP	11	132	10,719	金融
BCE INC	9	53	4,365	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	16	167	13,583	素材
SUNCOR ENERGY INC	152.12	632	51,246	エネルギー
METRO INC/CN	30	151	12,276	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	33	203	16,500	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	119	840	68,041	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	44	455	36,890	金融
TORONTO-DOMINION BANK	179	1,358	110,061	金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	39	117	9,477	金融
ROYAL BANK OF CANADA	135	1,397	113,231	金融
TOURMALINE OIL CORP	13	20	1,638	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	14	37	3,036	エネルギー
TC ENERGY CORP	88	577	46,802	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	55.71	269	21,822	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	192	41	3,390	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	174	324	26,299	素材
CAE INC	23	79	6,444	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	18.33	160	12,961	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	57	4,642	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	37	3,023	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	64	5,201	素材
HYDRO ONE LTD	15	34	2,777	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	14.89	103	8,372	生活必需品
WSP GLOBAL INC	12	84	6,838	資本財・サービス
QUEBECOR INC -CL B	23	73	5,961	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	12	64	5,195	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	37	3,073	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	39	269	21,812	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	18	111	9,048	素材
STARS GROUP INC/THE	35	77	6,242	一般消費財・サービス
KINROSS GOLD CORP	105.34	49	4,044	素材
BANK OF MONTREAL	58	578	46,824	金融
POWER CORP OF CANADA	31	86	6,993	金融
METHANEX CORP	6	35	2,914	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	10	409	33,141	情報技術
NUTRIEN LTD	60.27	430	34,866	素材
AURORA CANNABIS INC	70	70	5,743	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	20	110	8,952	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	34	70	5,714	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	22	112	9,122	素材
CAMECO CORP	28	38	3,134	エネルギー
TELUS CORP	3	14	1,180	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	2019年6月17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	
POWER FINANCIAL CORP	20	59	4,816	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	128	10,385	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5	69	5,591	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	117	416	33,709	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	189	15,389	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	191	15,500	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	91	7,405	生活必需品
BLACKBERRY LTD	64	73	5,946	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	51	268	21,774	金融
ENBRIDGE INC	196	906	73,426	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	78	493	39,967	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	202	471	38,156	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	20	57	4,667	ヘルスケア
ENCANA CORP	152	95	7,695	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13	404	32,758	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	57	4,672	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	145	11,798	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	71	870	70,490	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	286	23,194	情報技術
HUSKY ENERGY INC	30.12	38	3,098	エネルギー
ONEX CORPORATION	6	45	3,661	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	39	104	8,425	コミュニケーション・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	19	48	3,927	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	11	917	金融
OPEN TEXT CORP	27	149	12,107	情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	42	3,410	金融
SAPUTO INC	29	115	9,346	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	70	5,689	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	45	386	31,274	生活必需品
FORTIS INC	42	219	17,741	公益事業
LUNDIN MINING CORP	66	44	3,597	素材
CENOVUS ENERGY INC	80	90	7,361	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	126	10,230	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	36	2,923	公益事業
ALTAGAS LTD	47	90	7,301	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	20	44	3,598	不動産
KEYERA CORP	22	70	5,746	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	95	7,760	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,902.88 86銘柄	17,897 <3.5%>	1,449,690
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	77	5,765	金融
BHP GROUP LTD	298.17	1,201	89,797	素材
SOUTH32 LTD	563.87	186	13,947	素材
ALUMINA LTD	362.17	88	6,576	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	95.76	335	25,067	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	105	92	6,905	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	36	41	3,088	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	268.99	719	53,731	金融
WESTPAC BANKING CORP	330.42	921	68,842	金融
SANTOS LTD	182.7	127	9,557	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	55	4,142	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	278.74	786	58,782	金融
RIO TINTO LTD	33.49	352	26,363	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	147	10,999	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD	153.1	81	6,109	資本財・サービス
COLES GROUP LTD	95.67	124	9,301	生活必需品
AMCOR PLC-CDI	109.96	172	12,860	素材
OIL SEARCH LTD	154.18	107	8,065	エネルギー
SEEK LTD	26	54	4,097	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	55.92	84	6,297	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	84.2	253	18,952	素材
INCITEC PIVOT LTD	204	70	5,305	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	176.68	1,409	105,322	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	20	52	3,956	エネルギー
ORICA LTD	20	40	3,056	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	187	14,027	金融
CIMIC GROUP LTD	10	45	3,366	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	140.56	453	33,917	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	26	1,944	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	79	5,951	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	35	2,683	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	135	10,155	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	249.35	52	3,931	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	32	59	4,412	素材
MACQUARIE GROUP LTD	33.47	408	30,537	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	188	14,102	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	30	28	2,138	金融

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
CSL LTD	44.63	950	70,996	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	114.44	408	30,496	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	4.44	90	6,776	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	83	6,232	素材
SUNCORP GROUP LTD	149.38	199	14,925	金融
BORAL LTD	86	46	3,464	素材
ASX LTD	22.6	183	13,680	金融
COMPUTERSHARE LTD	37	61	4,598	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	211	15,774	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	143	10,733	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	63	40	3,060	金融
WORLEYPARSONS LTD	13.21	18	1,356	エネルギー
AGL ENERGY LTD	84.66	165	12,381	公益事業
BRAMBLES LTD	183.37	237	17,773	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	8	33	2,469	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9	64	4,820	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	56	4,214	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	6.21	24	1,822	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,895.23 55銘柄	12,306 <2.2%>	
(香港)	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	145	814	11,302	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	220	1,067	14,799	一般消費財・サービス
MTR CORP	165	814	11,293	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	160	2,014	27,939	不動産
SINO LAND CO	340	425	5,894	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	270.52	2,031	28,178	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	80	161	2,241	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	35	328	4,553	不動産
CLP HOLDINGS LTD	190	1,691	23,467	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	828	11,495	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,180.35	2,027	28,126	公益事業
HANG SENG BANK LTD	90	1,747	24,241	金融
WHELOCK & CO LTD	60	316	4,385	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	667	9,251	不動産
WH GROUP LTD	915	672	9,327	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	119	3,098	42,979	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	206	2,866	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	146	2,026	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	80	171	2,374	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	150	233	3,237	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	75	231	3,214	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	86	188	2,618	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	60	237	3,295	不動産
SJM HOLDINGS LTD	100	82	1,137	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	252	3,506	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	305.52	1,799	24,959	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	346	4,805	公益事業
PCCW LTD	600	273	3,794	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	1,292	9,534	132,249	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	726	10,077	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	120	557	7,731	生活必需品
SANDS CHINA LTD	230	828	11,484	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	40	37	524	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	120	663	9,204	資本財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	140	168	2,341	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	390	1,177	16,336	金融
WYNN MACAU LTD	168	268	3,728	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 >	9,127.04 37銘柄	510,992 <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	332	26,343	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	171	424	33,626	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	64	5,137	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	108	8,638	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	52	37	2,992	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	48	3,857	不動産
CAPITALAND LTD	190	65	5,165	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	270	39	3,145	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	28	2,254	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	32	2,603	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	348	375	29,733	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	39	3,156	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	53	4,217	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	924	307	24,387	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	57	4,593	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	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	40	9	751	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	90	2	192	生活必需品
SATS LTD	77	39	3,136	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	69	52	4,123	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	25	2,044	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	54	4,358	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 >	3,670 21銘柄	174,461 <0.4%>	
	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)				
MERIDIAN ENERGY LTD	150	67	4,750	公益事業
A2 MILK CO LTD	70	103	7,340	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	65	4,613	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	73	5,159	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	145.26	78	5,570	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	37	55	3,937	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	51	3,635	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	35,008 <0.1%>	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)				
MERLIN ENTERTAINMENT	50	18	2,583	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	48.02	36	4,926	一般消費財・サービス
BP PLC	1,975.27	1,064	145,566	エネルギー
UNILEVER PLC	111.99	556	76,167	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,801.73	268	36,711	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	177.45	158	21,640	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	105	22	3,101	一般消費財・サービス
PRUDENTIAL PLC	259.64	415	56,862	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	508.36	107	14,765	金融
EVRAZ PLC	74.41	51	7,082	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	54	7,435	素材
BAE SYSTEMS PLC	293.37	142	19,445	資本財・サービス
AVIVA PLC	443.49	181	24,780	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	485.52	769	105,196	ヘルスケア
INFORMA PLC	110	88	12,034	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	42.04	83	11,350	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	400	67	9,274	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	59.71	33	4,584	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	65	8,907	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	44.17	51	7,003	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	64	8,803	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	79	10,822	情報技術
GVC HOLDINGS PLC	41.61	25	3,552	一般消費財・サービス
NMC HEALTH PLC	9.75	22	3,065	ヘルスケア
RELX PLC	202.6	386	52,876	資本財・サービス
DIAGEO PLC	228.95	782	107,029	生活必需品
RIO TINTO PLC	114.02	543	74,374	素材
STANDARD CHARTERED PLC	297.45	201	27,513	金融
TESCO PLC	887.48	199	27,233	生活必需品
FRESNILLO PLC	24	20	2,756	素材
SMITH & NEPHEW PLC	83.29	141	19,402	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,067.03	290	39,696	素材
JOHN WOOD GROUP PLC	54.66	21	2,973	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	59	8,183	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	60	8,277	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109.63	35	4,846	金融
PEARSON PLC	82.71	66	9,032	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	34	4,675	生活必需品
NEXT PLC	11.59	63	8,739	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	50	6,859	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	84	11,509	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	31.59	68	9,352	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	2,737.37	350	47,922	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	7.83	41	5,610	素材
KINGFISHER PLC	172.29	35	4,891	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	125	17,101	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	67	9,291	公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	26	3,626	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	177.58	69	9,465	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	66.64	434	59,471	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	50	6,961	金融
SCHROEDERS PLC	12.27	35	4,914	金融
SSE PLC	82.82	92	12,707	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	39.42	58	7,943	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	69	9,498	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	121.53	755	103,288	ヘルスケア
FERGUSON PLC	19.89	110	15,139	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	181	24,885	金融
3I GROUP PLC	84.39	86	11,828	金融
ASHTREAD GROUP PLC	39	76	10,394	資本財・サービス

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SAGE GROUP PLC/THE	97.25	73	10,112	情報技術
NATIONAL GRID PLC	303.25	252	34,560	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,763.72	390	53,368	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	125.86	71	9,793	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	102.29	202	27,648	生活必需品
CENTRICA PLC	680.02	62	8,510	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	19.63	69	9,475	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	223.21	644	88,076	生活必需品
BHP GROUP PLC	213.17	407	55,678	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29.6	72	9,969	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	1,956.67	1,263	172,746	金融
ANGLO AMERICAN PLC	107.45	226	31,011	素材
MONDI PLC	34	58	8,027	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	145	28	3,922	生活必需品
CARNIVAL PLC	13.83	55	7,627	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	16.44	15	2,088	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	142.39	272	37,220	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	25.69	49	6,834	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	856.24	176	24,155	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	74	10,228	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	51.36	89	12,231	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	13.03	68	9,317	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	15.92	88	12,047	資本財・サービス
ITV PLC	275.87	29	3,970	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27.35	148	20,368	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	437.7	1,100	150,536	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	369.7	930	127,225	エネルギー
MEGGITT PLC	99.25	50	6,938	資本財・サービス
G4S PLC	113.2	23	3,275	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	32	4,461	金融
INVESTEC PLC	46	21	2,994	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	29	4,064	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	178.99	48	6,655	金融
EXPERIAN PLC	93.19	224	30,686	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 >	29,194.81 94銘柄	17,563 <5.7%>	2,401,771 <5.7%>
(イスラエル)	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	170	5,141	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	116	3,518	不動産
ISRAEL CHEMICALS LTD	110.96	212	6,388	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	167	5,049	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	79	205	6,172	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	114	284	8,567	金融
NICE LTD	8	397	11,981	情報技術
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	440.26 7銘柄	1,554 <0.1%>	46,819 <0.1%>
(スイス)	百株	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG	1.89	15	1,661	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	374.02	430	46,865	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	81	8,879	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	100	10,973	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	68.28	1,884	204,980	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	28	3,137	金融
SIKA AG-REG	11.4	181	19,715	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	78	8,494	生活必需品
ABB LTD-REG	176.76	332	36,202	資本財・サービス
SWISS RE AG	29.82	294	32,065	金融
NESTLE SA-REG	297.98	3,021	328,650	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1.63	116	12,630	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5.31	115	12,539	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	254.16	288	31,418	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	21.98	89	9,771	金融
SGS SA-REG	0.65	167	18,254	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1.53	32	3,524	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	3.69	51	5,562	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	7.93	138	15,060	情報技術
ALCON INC	42.49	246	26,796	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	2.67	68	7,501	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14.92	503	54,738	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	105	11,457	金融
CLARIANT AG-REG	15.68	29	3,203	素材
NOVARTIS AG-REG	212.46	1,899	206,620	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.2	39	4,302	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	54.28	431	46,901	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	136	14,890	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG	3.34	155	16,860	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	0.89	247	26,873	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	93	10,153	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	5.63	129	14,121	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スイス・フラン	千円	
LONZA GROUP AG-REG	6.92	227	24,770	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	22	2,410	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	47.7	232	25,241	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	180	19,668	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4.95	66	7,214	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	79	8,612	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.1	68	7,488	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,719.75 39銘柄	12,413 1,350,216 <3.2%>	
	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)				
NOVO NORDISK A/S-B	184.61	6,285	102,587	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	793	12,942	金融
ISS A/S	13.2	254	4,154	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	206	3,370	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	126	2,071	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18.57	1,056	17,244	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	12.32	1,084	17,693	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	18.02	549	8,969	素材
COLOPLAST-B	10.52	790	12,897	ヘルスケア
DSV A/S	16.5	1,022	16,689	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	284	4,644	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	479	7,817	資本財・サービス
TRYG A/S	17	370	6,048	金融
PANDORA A/S	7.5	165	2,701	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	927	15,137	素材
GENMAB A/S	7.33	864	14,103	ヘルスケア
ORSTED A/S	22.76	1,290	21,053	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	432.41 17銘柄	16,552 270,128 <0.6%>	
	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)				
NORSK HYDRO ASA	130.5	403	5,039	素材
DNB ASA	85.45	1,286	16,067	金融
ORKLA ASA	70	532	6,656	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	1,653	20,651	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	111.21	1,890	23,606	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	14.5	589	7,361	素材
MOWI ASA	46.77	960	11,992	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	350	4,373	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	382	4,777	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	13.06	295	3,689	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 >	595.95 10銘柄	8,344 104,217 <0.2%>	
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)				
ICA GRUPPEN AB	7	278	3,191	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	323.35	2,886	33,054	情報技術
VOLVO AB-B SHS	145.68	2,053	23,510	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7.77	393	4,501	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES	40	630	7,220	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	595	6,823	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	21.88	929	10,644	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	70.26	942	10,788	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	196.97	1,714	19,634	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	165.26	1,518	17,385	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	90.75	1,273	14,583	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	90.39	1,392	15,942	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS	37.09	620	7,102	資本財・サービス
SANDVIK AB	132.81	2,146	24,574	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	45.5	1,999	22,891	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	76.68	2,153	24,653	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	25	411	4,711	資本財・サービス
TELIA CO AB	241.07	994	11,388	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	20	400	4,582	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	36.78	940	10,768	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	108.82	2,206	25,268	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	323	3,703	金融
LUNDIN PETROLEUM AB	19	506	5,797	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	67.47	1,997	22,866	生活必需品
BOLIDEN AB	31.71	714	8,185	その他
EPIROC AB-A	69.82	635	7,276	資本財・サービス
EPIROC AB-B	25	220	2,523	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	24	208	2,387	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP	339.57	2,352	26,940	金融
KINNEVIK AB - B	15	363	4,158	金融
HEXAGON AB-B SHS	24	1,157	13,248	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	261	2,996	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,547.11 32銘柄	35,223 403,308 <1.0%>	



銘柄	2019年6月17日現在			業種等	
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
<b>ユーロ (アイルランド)</b>					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19.95	53	6,467	素材	
AIB GROUP PLC	90	32	3,931	金融	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	102.34	47	5,774	金融	
KINGSPAN GROUP PLC	16	74	9,074	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	17.12	181	22,157	生活必需品	
CRH PLC	80.12	227	27,691	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8.89	58	7,141	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	334.42	674	82,238	
		7銘柄		<0.2%>	
<b>ユーロ (オランダ)</b>					
QIAGEN N. V.	25.21	88	10,826	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	93.09	341	41,595	ヘルスケア	
NN GROUP NV	31	108	13,272	金融	
UNILEVER NV-CVA	140.43	766	93,426	生活必需品	
HEINEKEN NV	29.1	280	34,194	生活必需品	
AEGON NV	143.61	60	7,340	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	106.52	219	26,709	生活必需品	
AKZO NOBEL N. V.	25.04	205	25,050	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	19.38	207	25,330	素材	
WOLTERS KLUWER	30.97	199	24,283	資本財・サービス	
ING GROEP NV	364.4	357	43,614	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	360	102	12,446	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	42.23	722	88,026	情報技術	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	34.53	64	7,917	金融	
ADYEN NV	0.77	53	6,570	情報技術	
VOPAK	6.3	24	3,000	エネルギー	
RANDSTAD NV	9.98	48	5,863	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	11	98	11,998	生活必需品	
STMICROELECTRONICS NV	74.98	106	12,920	情報技術	
AIRBUS SE	56.88	696	84,861	資本財・サービス	
EXOR NV	10.88	64	7,849	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	98	12,010	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	107.87	127	15,565	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	11.3	153	18,728	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,852.38	5,197	633,406	
		24銘柄		<1.5%>	
<b>ユーロ (ベルギー)</b>					
UCB SA	11.1	78	9,523	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	30.11	174	21,209	金融	
COLRUYT SA	3.5	21	2,665	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9	76	9,323	金融	
SOLVAY SA	8.73	75	9,230	素材	
UMICORE	16	43	5,247	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72.21	544	66,336	生活必需品	
AGEAS	16.54	72	8,873	金融	
PROXIMUS	22.69	59	7,222	コミュニケーション・サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	4.62	22	2,766	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 >	194.5	1,168	142,398	
		10銘柄		<0.3%>	
<b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>					
AROUNDTOWN SA	80.42	61	7,530	不動産	
RTL GROUP	3.5	15	1,886	コミュニケーション・サービス	
ARCELMITTAL	80.31	117	14,262	素材	
EUROFINS SCIENTIFIC	1.31	47	5,747	ヘルスケア	
SES	44.02	62	7,671	コミュニケーション・サービス	
TENARIS SA	47	50	6,186	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	256.56	355	43,284	
		6銘柄		<0.1%>	
<b>ユーロ (フランス)</b>					
JCDECAUX SA	8.45	22	2,706	コミュニケーション・サービス	
TOTAL SA	230.14	1,087	132,522	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	18.61	204	24,925	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	39.38	467	56,990	素材	
KERING	7.08	344	41,972	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	52.24	392	47,786	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	18.92	59	7,249	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	109.86	448	54,705	金融	
PEUGEOT SA	64.97	134	16,405	一般消費財・サービス	
NATIXIS	76.74	29	3,607	金融	
THALES SA	9.18	96	11,797	資本財・サービス	
DANONE	58.53	424	51,728	生活必需品	
CARREFOUR SA	51.56	88	10,751	生活必需品	
SUEZ	29.5	37	4,520	公益事業	
VIVENDI	84.95	207	25,343	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL	25.33	628	76,556	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	58.49	194	23,711	資本財・サービス	
LEGRAND SA	22.5	140	17,148	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	2019年6月17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	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	6	794	生活必需品
PERNOD RICARD SA	21.54	340	41,436	生活必需品
SOCIETE BIC SA	1.5	10	1,235	資本財・サービス
EURAZEO SE	5.6	34	4,207	金融
SOCIETE GENERALE SA	80.65	171	20,871	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	27.15	961	117,130	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	64	7,845	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	16.45	159	19,478	情報技術
VALEO SA	19.65	47	5,819	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	18.06	90	11,004	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	68	8,376	資本財・サービス
EIFFAGE	7.5	64	7,811	資本財・サービス
SODEXO SA	7.63	79	9,693	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	31	3,858	ヘルスケア
INGENICO GROUP	4.99	38	4,665	情報技術
AMUNDI SA	4.37	25	3,147	金融
TELEPERFORMANCE	5	86	10,596	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	66	8,101	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	5.6	19	2,411	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	51	6,287	ヘルスケア
SEB SA	1.97	29	3,627	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	27.31	290	35,412	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	0.22	26	3,217	資本財・サービス
WORLDLINE SA	13.3	81	9,887	情報技術
AXA SA	185.78	420	51,191	金融
EDENRED	19.13	82	10,015	資本財・サービス
RENAULT SA	25.54	142	17,349	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	2.68	164	19,995	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	29	3,551	生活必需品
ATOS SE	9.46	67	8,240	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	11.49	157	19,183	情報技術
WENDEL	2.01	23	2,875	金融
ORANGE	204.92	283	34,513	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	13.1	54	6,627	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	26	3,253	金融
SANOFI	109.67	833	101,550	ヘルスケア
VINCI SA	50.21	449	54,814	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	69.73	148	18,058	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	99.04	101	12,426	金融
BIOMERIEUX	4.57	34	4,165	ヘルスケア
ENGIE	174.13	225	27,492	公益事業
IMERYS SA	3.4	15	1,848	素材
EDF	67.6	79	9,704	公益事業
SAFRAN SA	31.33	385	46,925	資本財・サービス
ILIAD SA	2.19	22	2,708	コミュニケーション・サービス
ARKEMA	8.38	63	7,790	素材
ADP	3.5	53	6,547	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14	22	2,787	コミュニケーション・サービス
SCOR SE	12.97	50	6,134	金融
GETLINK SE	39.4	54	6,635	資本財・サービス
BOLLORE	73	28	3,480	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,557.46 69銘柄	11,875 <3.4%>	1,447,223
ユーロ (ドイツ)	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	91.57	483	58,978	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	18	43	5,332	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	229.67	138	16,869	金融
COMMERZBANK AG	96.89	59	7,218	金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	60	7,375	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	17.74	250	30,535	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	75.45	784	95,647	資本財・サービス
E. ON SE	222.7	221	26,964	公益事業
UNIPER SE	13.8	36	4,421	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.21	182	22,234	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	32	3,968	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	11.8	146	17,889	一般消費財・サービス
BASF SE	91.06	550	67,117	素材
ALLIANZ SE-REG	38.42	796	97,109	金融
THYSSENKRUPP AG	40.3	47	5,780	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	18.57	164	20,024	生活必需品
RWE AG	53.09	121	14,784	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	30	3,664	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5.6	42	5,199	資本財・サービス
BRENTAG AG	14.36	60	7,392	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	37.09	171	20,851	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	30	3,699	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	1.66	17	2,156	資本財・サービス
SAP SE	93.65	1,063	129,584	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14.15	313	38,214	金融
ZALANDO SE	20.25	76	9,326	一般消費財・サービス

銘柄	2019年6月17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	
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	146	17,842	素材
KION GROUP AG	6	31	3,837	資本財・サービス
WIRECARD AG	10.27	153	18,705	情報技術
COVESTRO AG	19.45	81	9,898	素材
INNOGY SE	15	61	7,553	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG	3.05	54	6,605	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12.65	71	8,661	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	10.56	39	4,837	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	50	6,111	ヘルスケア
METRO AG	15	22	2,753	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG	5	13	1,667	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	54	6,692	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	5.49	54	6,630	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	12.75	136	16,618	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	7	24	2,973	素材
MERCK KGAA	11.49	105	12,854	ヘルスケア
ADIDAS AG	17.91	466	56,880	一般消費財・サービス
PUMA SE	5.1	27	3,384	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	108	13,197	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	318.56	490	59,748	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	22.71	151	18,460	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	87.92	416	50,809	一般消費財・サービス
HANNOVER RUECK SE	130.44	187	22,875	情報技術
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	90	11,003	金融
DEUTSCHE BOERSE AG	89.74	245	29,944	資本財・サービス
LANXESS AG	18.97	238	29,060	金融
MTU AERO ENGINES AG	6	27	3,341	素材
AXEL SPRINGER SE	4.44	88	10,751	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	4.7	29	3,562	コミュニケーション・サービス
SYMRISE AG	32.85	121	14,812	不動産
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	14.36	126	15,449	素材
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62.4	15	1,882	コミュニケーション・サービス
HUGO BOSS AG -ORD	9	47	5,835	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	8.11	44	5,406	一般消費財・サービス
	46.37	213	26,023	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,353.54 61銘柄	10,166 <3.0%>	1,239,014
ユーロ (ポルトガル)	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	29	41	5,083	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	94	11,567	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	36.09	47	5,783	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	340.85 3銘柄	184 <0.1%>	22,435
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	459.9	342	41,722	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	21.5	51	6,233	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	604.32	294	35,929	金融
IBERDROLA SA	560.28	501	61,166	公益事業
BANCO DE SABADELL SA	496.34	45	5,563	金融
BANKINTER SA	67	41	5,024	金融
REPSOL SA	142	203	24,746	エネルギー
GRIFOLS SA	30.04	72	8,863	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	1,598.97	632	77,059	金融
AMADEUS IT GROUP SA	43.11	293	35,778	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	101	12,333	公益事業
MAPFRE SA	80.05	21	2,572	金融
CAIXABANK SA	468.59	120	14,716	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21.95	81	9,969	資本財・サービス
AENA SME SA	5.69	98	12,010	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	20.96	67	8,191	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	96.55	241	29,416	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	26	3,239	資本財・サービス
ENAGAS SA	36.75	91	11,201	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40.56	78	9,577	公益事業
FERROVIAL SA	63.46	140	17,122	資本財・サービス
BANKIA SA	159.05	34	4,159	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,074.78 22銘柄	3,582 <1.0%>	436,600
ユーロ (イタリア)	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	14.4	24	2,971	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	117.33	189	23,071	金融
MEDIOBANCA SPA	44.6	38	4,634	金融
UNICREDIT SPA	211.47	214	26,106	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	49	6,057	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	21	2,609	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	1,354.57	248	30,332	金融
ATLANTIA SPA	60.27	141	17,202	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	29	26	3,275	金融
MONCLER SPA	15.22	53	6,501	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA	6.92	25	3,124	ヘルスケア
ENI SPA	248.98	347	42,310	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	44.83	39	4,785	生活必需品
PIRELLI & C SPA	56.51	29	3,644	一般消費財・サービス
LEONARDO SPA	25	26	3,284	資本財・サービス
ENEL SPA	797.95	484	59,028	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	株数	2019年6月17日現在		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
SNAM SPA	243	114	13,972	エネルギー 公益事業 金融	
TERNA SPA	199	114	13,983		
FINECOBANK SPA	59.72	54	6,583		
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,097.61 19銘柄	2,244 <0.7%>	273,479	
ユーロ (フィンランド)	株数	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	44.93	104	12,714	素材 情報技術 資本財・サービス 素材 資本財・サービス コミュニケーション・サービス 金融 公益事業 資本財・サービス 一般消費財・サービス エネルギー ヘルスケア	
NOKIA OYJ	544.37	238	29,097		
WARTSILA OYJ ABP	41.16	52	6,448		
STORA ENSO OYJ-R SHS	41.93	39	4,812		
METSO OYJ	11.08	35	4,308		
ELISA OYJ	13	54	6,669		
SAMPO OYJ-A SHS	38.32	155	18,955		
FORTUM OYJ	44	84	10,266		
KONE OYJ-B	38.6	193	23,567		
NOKIAN RENKAAT OYJ	17.7	47	5,731		
NESTE OYJ	48.49	149	18,242		
ORION OYJ-CLASS B	17.63	55	6,752		
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	901.21 12銘柄	1,210 <0.4%>		147,568
ユーロ (オーストリア)	株数	千ユーロ	千円		
VERBUND AG	2.4	11	1,341	公益事業 エネルギー 金融 素材 金融 資本財・サービス	
OMV AG	12.09	50	6,201		
ERSTE GROUP BANK AG	27.5	88	10,748		
VOESTALPINE AG	18	43	5,299		
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	23	2,875		
ANDRITZ AG	5.5	17	2,099		
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	76.49 6銘柄	234 <0.1%>	28,565	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	19,039.8 239銘柄	36,893 <10.7%>	4,496,214	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	107,897.69 1,259銘柄	— <91.6%>	38,411,435	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	口数	2019年6月17日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.372	285	31,022
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.053	497	54,046
BOSTON PROPERTIES INC	1.556	210	22,858
VORNADO REALTY TRUST	2.128	140	15,307
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.055	238	25,965
EQUITY RESIDENTIAL	4.248	332	36,123
EQUINIX INC	0.817	416	45,268
AMERICAN TOWER CORP	4.318	912	99,107
HOST HOTELS & RESORTS INC	6.228	114	12,391
KIMCO REALTY CORP	3.3	61	6,716
INVITATION HOMES INC	2.2	60	6,528
VENTAS INC	3.702	247	26,854
WEYERHAEUSER CO	7.435	191	20,770
AGNC INVESTMENT CORP	4.334	73	7,949
CROWN CASTLE INTL CORP	4.153	553	60,158
IRON MOUNTAIN INC	3.474	110	11,977
VEREIT INC	13.632	129	14,116
SUN COMMUNITIES INC	0.843	108	11,827
PROLOGIS INC	6.353	507	55,197
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.2	181	19,728
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.65	69	7,497
DUKE REALTY CORP	3.1	98	10,694
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.6	179	19,505
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.974	129	14,090
WELLTOWER INC	3.797	312	33,947
HCP INC	4.55	146	15,880
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	50	5,459
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.1	129	14,078
MACERICH CO/THE	0.7	24	2,626
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.975	120	13,140
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15.632	142	15,490
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1.552	85	9,322
REALTY INCOME CORP	2.55	186	20,301
PUBLIC STORAGE	1.54	374	40,714
REGENCY CENTERS CORP	1.15	79	8,605
SL GREEN REALTY CORP	0.65	56	6,182
UDR INC	2.965	137	14,961

銘柄	柄	2019年6月17日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
WP CAREY INC		千口 1.6	千アメリカ・ドル 136	千円 14,864
DIGITAL REALTY TRUST INC		2.269	271	29,526
EXTRA SPACE STORAGE INC		1.285	138	15,088
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	124.04 40銘柄	8,244	895,898 <2.1%>
(カナダ)		千口	千カナダ・ドル	千円
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		2	45	3,682
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1.4	37	3,043
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	3.4 2銘柄	83	6,725 <0.0%>
(オーストラリア)		千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENLEASE GROUP		4.303	55	4,180
TRANSURBAN GROUP		26.027	377	28,221
SYDNEY AIRPORT		9.129	70	5,280
APA GROUP		14.243	159	11,889
SCENTRE GROUP		43.529	163	12,230
DEXUS		13.949	190	14,218
GPT GROUP		14.648	90	6,753
MIRVAC GROUP		31.638	101	7,589
STOCKLAND		18.729	81	6,102
GOODMAN GROUP		14.731	215	16,127
VICINITY CENTRES		19.523	50	3,764
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	210.449 11銘柄	1,557	116,358 <0.3%>
(香港)		千口	千香港・ドル	千円
LINK REIT		24	2,300	31,906
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		52	405	5,625
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		34	426	5,913
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	110 3銘柄	3,132	43,445 <0.1%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		28	57	4,571
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		30.5	90	7,203
CAPITALAND MALL TRUST		9	23	1,854
SUNTEC REIT		26	49	3,894
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	93.5 4銘柄	221	17,525 <0.0%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		10.295	86	11,848
SEGRO PLC		13.286	95	13,063
BRITISH LAND CO PLC		14.58	78	10,750
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	38.161 3銘柄	260	35,662 <0.1%>
(ユーロ (フランス))		千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1.249	169	20,678
ICADE		0.406	32	3,958
GECINA SA		0.334	44	5,454
KLEPIERRE		2.394	70	8,644
COVIVIO		0.353	33	4,084
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	4.736 5銘柄	351	42,820 <0.1%>
合 計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	584.286 68銘柄	—	1,158,437 <2.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17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	2019年6月17日現在		
	買 建 額	売 建 額	
外	百万円	百万円	
	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	1,790	—
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	110	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	73	—
国	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	160	—
	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	85	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	308	—

(注1) 外貨建の評価額は、2019年6月17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11期 (決算日 2019年1月10日)

(作成対象期間 2018年1月11日~2019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。)
株式組入制限	無制限

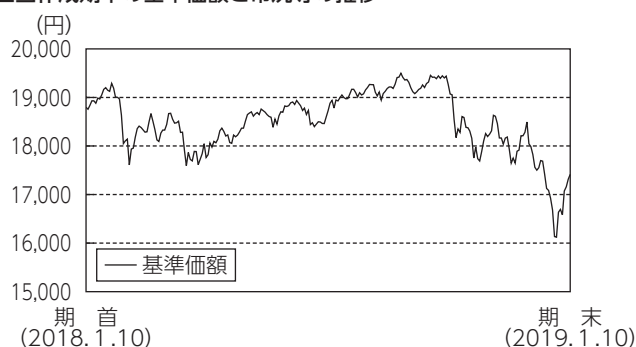
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

### ■当作成期中の基準価額と市況等の推移



当作成期首より、米国の税制改革法への期待などを好感し、上昇してまいりました。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。10月以降は、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。当作成期末にかけては、米国予算をめぐる議会の対立により一部米国政府機関が閉鎖するなど混乱が生じたことや、米国の代表的銘柄であるアップルの業績下方修正などが嫌気され、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。

#### ◆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

ベンチマークの騰落率は△9.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△7.4%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ってまいります。

年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース、指数化)		株式組入率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	投資信託証券組入比率
	円	%	騰落率	騰落率				
期首2018年1月10日	18,797	-	15,025	-	93.4	3.9	0.0	2.4
1月末	19,006	1.1	15,186	1.1	92.1	3.4	0.0	2.3
2月末	18,507	△1.5	14,756	△1.8	91.8	3.6	0.0	2.2
3月末	17,888	△4.8	14,237	△5.2	92.4	4.7	0.0	2.3
4月末	18,225	△3.0	14,476	△3.7	96.0	4.1	0.0	2.4
5月末	18,553	△1.3	14,680	△2.3	94.4	1.8	-	2.3
6月末	18,450	△1.8	14,575	△3.0	97.0	2.0	-	2.5
7月末	19,010	1.1	15,003	△0.1	95.5	2.5	-	2.4
8月末	19,412	3.3	15,285	1.7	93.3	3.6	-	2.3
9月末	19,444	3.4	15,284	1.7	95.5	5.0	-	2.3
10月末	17,885	△4.9	14,056	△6.5	93.0	3.6	-	2.5
11月末	18,210	△3.1	14,274	△5.0	91.5	6.8	-	2.5
12月末	16,694	△11.2	13,075	△13.0	91.6	2.6	-	2.5
期末2019年1月10日	17,415	△7.4	13,628	△9.3	90.1	6.6	-	2.4

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 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：18,797円 期末：17,415円 騰落率：△7.4%

##### 【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った結果、米中貿易摩擦が深刻化したことや米国の代表的銘柄であるアップルの業績下方修正などを嫌気し海外株式市況が下落したことから、基準価額は下落しました。

#### ◆投資環境について

##### ○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は下落しました。

### ■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	2円 (1)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	3 (3)
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	9 (8)
(その他)	(1)
合計	14

(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

(2018年1月11日から2019年1月10日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	アメリカ	百株 7,830.47 (116.12)	千アメリカ・ドル 61,021 (△ 1,429)	百株 439.12	千アメリカ・ドル 2,568
	カナダ	百株 895 (18.14)	千カナダ・ドル 4,228 (△ 11)	百株 68	千カナダ・ドル 160
	オーストラリア	百株 1,989.79 (97.87)	千オーストラリア・ドル 3,076 (△ 3)	百株 277.41	千オーストラリア・ドル 285
	香港	百株 2,243 (81.64)	千香港ドル 9,659 ( )	百株 1,020	千香港ドル 195
	シンガポール	百株 861 (190)	千シンガポール・ドル 767 (△ 64)	百株 120	千シンガポール・ドル 23
	ニュージーランド	百株 229 (4.26)	千ニュージーランド・ドル 200 ( )	百株 -	千ニュージーランド・ドル -
	イギリス	百株 7,934.37 (△ 239.55)	千イギリス・ポンド 4,782 (△ 121)	百株 983.63	千イギリス・ポンド 737
	イスラエル	百株 116.96 (4.18)	千イスラエル・シケル 356 (△ 131)	百株 -	千イスラエル・シケル -
	スイス	百株 386.66 (20.67)	千スイス・フラン 2,529 (△ 45)	百株 9.46	千スイス・フラン 0
	デンマーク	百株 111.32 ( )	千デンマーク・クローネ 4,337 ( )	百株 81	千デンマーク・クローネ 724
	ノルウェー	百株 166.87 ( )	千ノルウェー・クローネ 2,429 ( )	百株 -	千ノルウェー・クローネ -
	スウェーデン	百株 795.5 (131.98)	千スウェーデン・クローネ 10,524 (△ 25)	百株 85.46	千スウェーデン・クローネ 948
	ユーロ (アイルランド)	百株 109.2 ( )	千ユーロ 301 (△ 379)	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (オランダ)	百株 482.33 ( )	千ユーロ 1,195 ( )	百株 42.6	千ユーロ 47
	ユーロ (ベルギー)	百株 45.75 ( )	千ユーロ 296 ( )	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 140.98 ( )	千ユーロ 191 ( )	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (フランス)	百株 619.56 (0.25)	千ユーロ 3,063 (△ 9)	百株 33.34	千ユーロ 80
	ユーロ (ドイツ)	百株 655.69 (50.62)	千ユーロ 2,969 (△ 30)	百株 109.46	千ユーロ 100
	ユーロ (ポルトガル)	百株 145.76 ( )	千ユーロ 78 ( )	百株 -	千ユーロ -
ユーロ (スペイン)	百株 1,337.66 (3,102.83)	千ユーロ 1,009 (△ 79)	百株 2,607.6	千ユーロ 35	
ユーロ (イタリア)	百株 1,030.37 (18.15)	千ユーロ 640 (△ 15)	百株 157.47	千ユーロ 94	
ユーロ (フィンランド)	百株 249.01 (27.44)	千ユーロ 311 ( )	百株 -	千ユーロ -	
ユーロ (オーストリア)	百株 30.5 ( )	千ユーロ 119 (△ 3)	百株 -	千ユーロ -	
ユーロ (その他)	百株 18 ( )	千ユーロ 31 ( )	百株 82	千ユーロ 146	
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 4,864.81 (3,199.29)	千ユーロ 10,208 (△ 517)	百株 3,032.47	千ユーロ 504	

(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

(2018年1月11日から2019年1月10日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	千口 -	千アメリカ・ドル -	千口 70 ( )	千アメリカ・ドル 20 ( )

(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

(2018年1月11日から2019年1月10日まで)

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	千口 30,604 (△ 3,988)	千アメリカ・ドル 1,952 (△ 89)	千口 7.1 ( )	千アメリカ・ドル 77 ( )
	オーストラリア	千口 18,455 (3,451)	千オーストラリア・ドル 120 (32)	千口 14,397 ( )	千オーストラリア・ドル 123 ( )
	香港	千口 62.5 ( )	千香港ドル 1,158 ( )	千口 -	千香港ドル -
	シンガポール	千口 18.5 ( )	千シンガポール・ドル 49 (△ 0)	千口 -	千シンガポール・ドル -
	イギリス	千口 6,058 ( )	千イギリス・ポンド 32 ( )	千口 -	千イギリス・ポンド -
	ユーロ (フランス)	千口 1,634 ( )	千ユーロ 155 ( )	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、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。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2018年1月11日から2019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 13,331	百万円 11,936	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

(2018年1月11日から2019年1月10日まで)

銘 柄	当 期				銘 柄	期					
	買 付		売 付			買 付		売 付			
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
APPLE INC (アメリカ)	千株	千円	円	SHIRE PLC (ジャージー)	千株	千円	円				
MICROSOFT CORP (アメリカ)	10,792	210,868	19,539	APPLE INC (アメリカ)	8,223	52,258	6,355				
AMAZON.COM INC (アメリカ)	18,682	202,062	10,815	AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.1	25,253	22,958				
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	1,113	197,298	177,267	KEURIG DR PEPPER INC (アメリカ)	1,476	20,138	13,644				
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	6,646	123,757	18,621	RELX PLC (イギリス)	8.2	19,315	2,355				
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	6,895	100,938	14,639	LINDE PLC (アイルランド)	0.75	13,050	17,400				
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	8,128	100,261	12,335	OLD MUTUAL PLC (イギリス)	41,479	12,644	304				
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	0,799	98,886	123,762	MICROSOFT CORP (アメリカ)	1	10,945	10,945				
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	11,288	96,881	8,582	GKN PLC (イギリス)	15,154	10,601	699				
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	0,751	91,530	121,877	THOMSON REUTERS CORP (カナダ)	1.8	9,751	5,417				
	3,652	82,957	22,715	RANDGOLD RESOURCES LTD (ジャージー)	1,012	9,535	9,422				

(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

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額
DIGITAL REALTY TRUST INC	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.45	1.8	183	19,830
アメリカ・ドル 通貨計	87,951	107,467	6,334	685,344
	40銘柄	39銘柄		<1.9%>
(カナダ) H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
	2	2	42	3,487
	1.4	1.4	33	2,778
カナダ・ドル 通貨計	3.4	3.4	76	6,265
	2銘柄	2銘柄		<0.0%>
(オーストラリア) LENDLEASE GROUP TRANSURBAN GROUP SYDNEY AIRPORT APA GROUP SCENTRE GROUP DEXUS GPT GROUP MIRVAC GROUP STOCKLAND WESTFIELD CORP GOODMAN GROUP VICINITY CENTRES	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
	4.303	4.303	51	3,980
	17.162	26.027	303	23,569
	9.129	9.129	60	4,689
	7.5	7.5	67	5,220
	30.929	43.529	174	13,511
	6.5	6.5	68	5,326
	14.648	14.648	78	6,103
	31.638	31.638	71	5,548
	14.3	14.3	51	3,983
	13.956	-	-	-
	14.731	14.731	161	12,562
	19.523	19.523	50	3,908
オーストラリア・ドル 通貨計	184.319	191.828	1,139	88,406
	12銘柄	11銘柄		<0.2%>
(香港) LINK REIT HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS HKT TRUST AND HKT LTD-SS	千口	千口	千香港ドル	千円
	13.5	24	1,917	26,462
	-	52	422	5,826
	34	34	399	5,508
香港ドル 通貨計	47.5	110	2,739	37,798
	2銘柄	3銘柄		<0.1%>
(シンガポール) CAPITALAND COMMERCIAL TRUST ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT CAPITALAND MALL TRUST SUNTEC REIT	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
	28	28	50	4,029
	12	30.5	80	6,462
	9	9	21	1,705
	26	26	48	3,846
シンガポール・ドル 通貨計	75	93.5	200	16,044
	4銘柄	4銘柄		<0.0%>
(イギリス) LAND SECURITIES GROUP PLC SEGRO PLC HAMMERSON PLC BRITISH LAND CO PLC	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
	4.808	4.808	39	5,496
	5.92	5.92	36	5,047
	4.9	10.958	37	5,187
	6.3	6.3	34	4,734
イギリス・ポンド 通貨計	21.928	27.986	147	20,466
	4銘柄	4銘柄		<0.1%>
ユーロ (フランス) UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD UNIBAIL-RODAMCO SE ICADE GECINA SA KLEPIERRE COVIVIO	千口	千口	千ユーロ	千円
	-	1.249	179	22,378
	0.609	-	-	-
	0.406	0.406	27	3,483
	0.334	0.334	39	4,901
	1.4	2.394	67	8,379
	0.353	0.353	29	3,732
ユーロ通貨計	3.102	4.736	343	42,876
	5銘柄	5銘柄		<0.1%>
合計	423.2	538,917	-	897,201
	69銘柄	68銘柄		<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
外 S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円	百万円
	1,564	-
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	144	-
SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	88	-
FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	180	-
国 SWISS MKT IX FUTR (スイス)	95	-
EURO STOXX 50 (ドイツ)	348	-

(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

2019年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	33,270,926	89.3
投資信託証券	897,201	2.4
コール・ローン等、その他	3,107,564	8.3
投資信託財産総額	37,275,693	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=108.19円、1カナダ・ドル=81.83円、1オーストラリア・ドル=77.60円、1香港ドル=13.80円、1シンガポール・ドル=79.96円、1ニュージーランド・ドル=73.45円、1イギリス・ポンド=138.41円、1イスラエル・シケル=29.51円、1スイス・フラン=111.09円、1デンマーク・クローネ=16.74円、1ノルウェー・クローネ=12.77円、1スウェーデン・クローネ=12.21円、1ユーロ=125.00円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産(35,191,560千円)の投資信託財産総額(37,275,693千円)に対する比率は、94.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	70,496,152,237円
コール・ローン等	2,417,386,456
株式(評価額)	33,270,926,436
投資信託証券(評価額)	897,201,898
未収入金	33,279,663,671
未収配当金	42,532,784
差入委託証拠金	588,440,992
(B) 負債	33,565,241,431
未払金	33,564,918,702
未払解約金	304,000
その他未払費用	18,729
(C) 純資産総額(A-B)	36,930,910,806
元本	21,206,702,536
次期繰越損益金	15,724,208,270
(D) 受益権総口数	21,206,702,536口
1万口当り基準価額(C/D)	17,415円

\* 期首における元本額は16,172,496,917円、当作成期間中における追加設定元本額は7,629,081,114円、同解約元本額は2,594,875,495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) 18,311,659,026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) 1,222,421,129円、iFree 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 234,191,569円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50 V A25,088,268円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75 V A55,351,015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) 1,357,991,529円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,415円です。

■損益の状況

当期 自2018年1月11日 至2019年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	729,494,185円
受取配当金	727,190,783
受取利息	1,027,671
その他収益金	1,788,038
支払利息	△ 512,307
(B) 有価証券売買損益	△ 3,486,918,737
売買益	6,182,895,910
売買損	△ 9,669,814,647
(C) 先物取引等損益	△ 66,631,482
取引益	158,793,242
取引損	△ 225,424,724
(D) その他費用	△ 17,902,642
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 2,841,958,676
(F) 前期繰越損益金	14,226,619,765
(G) 解約差損益金	△ 2,188,416,305
(H) 追加信託差損益金	6,527,963,486
(I) 合計(E+F+G+H)	15,724,208,270
次期繰越損益金(I)	15,724,208,270

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



# ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17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。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/海外/株式/インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式(預託証券を含みます。)	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質上限組入比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

## 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)

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

<2732>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	12,232	0	22.3	12,081	20.8	96.0	1.4	2.6	1,719
2 期末 (2018年 6 月15日)	13,931	0	13.9	13,533	12.0	96.1	1.5	2.4	3,307
3 期末 (2019年 6 月17日)	14,011	0	0.6	13,342	△ 1.4	95.8	1.3	2.9	4,523

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注4) 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。

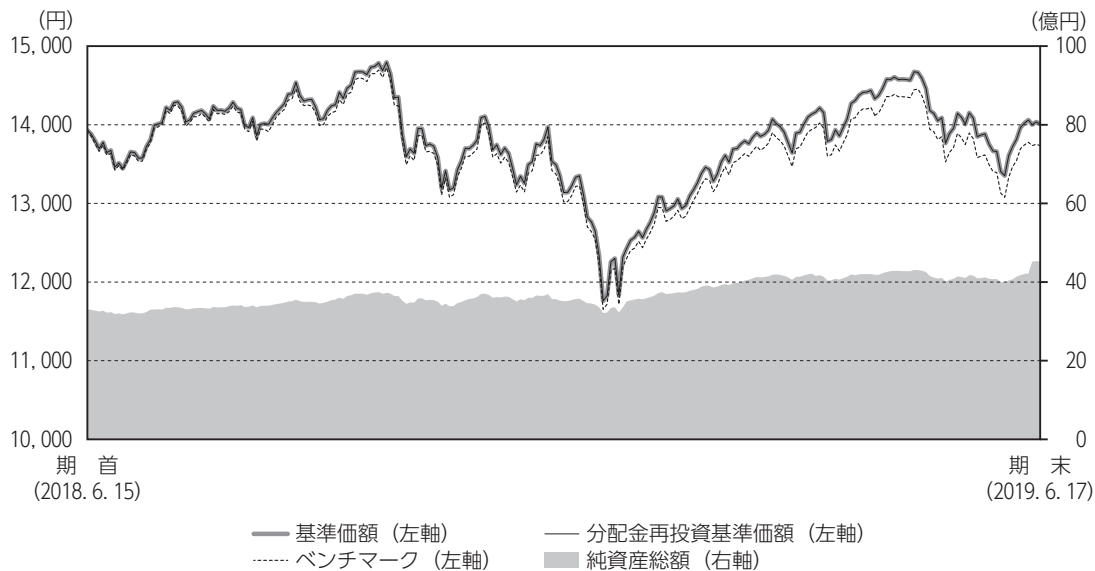
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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 (円ベース) です。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：13,931円

期末：14,011円 (分配金 0円)

騰落率：0.6% (分配金込み)

#### ■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首)2018年6月15日	13,931	—	13,533	—	96.1	1.5	2.4
6月末	13,544	△ 2.8	13,124	△ 3.0	95.6	2.0	2.5
7月末	14,075	1.0	13,633	0.7	96.1	1.5	2.4
8月末	14,374	3.2	13,891	2.6	95.7	1.8	2.4
9月末	14,733	5.8	14,233	5.2	96.2	1.4	2.4
10月末	13,430	△ 3.6	12,963	△ 4.2	95.5	1.9	2.6
11月末	13,737	△ 1.4	13,228	△ 2.3	95.1	2.3	2.6
12月末	12,300	△ 11.7	11,826	△ 12.6	96.2	1.2	2.7
2019年1月末	13,098	△ 6.0	12,571	△ 7.1	96.1	1.2	2.7
2月末	13,878	△ 0.4	13,320	△ 1.6	96.2	1.1	2.7
3月末	13,969	0.3	13,380	△ 1.1	95.8	1.6	2.8
4月末	14,588	4.7	13,955	3.1	96.4	0.9	2.7
5月末	13,660	△ 1.9	13,012	△ 3.9	96.0	1.1	2.8
(期末)2019年6月17日	14,011	0.6	13,342	△ 1.4	95.8	1.3	2.9

(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

(2018.6.16～2019.6.17)

### ■海外株式市況

米国・欧州を中心とした海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国の通商政策をめぐる懸念が再燃したことや新興国株式市場の軟調などが逆風となり、下落基調で始まりました。2018年9月以降は、米中貿易摩擦への懸念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。2019年1月以降は、米中貿易摩擦への懸念が和らいだことや米国の金融引き締め観測の後退などが支援材料となり、堅調に推移しました。当作成期末にかけては、順調に進展しているとみられていた米中貿易協議への懸念が高まったことを受けて下落した場面もありましたが、米国の利下げ観測から反発しました。

### ■為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると円高が進みました。

対円為替相場は、当作成期首より、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。一方、米ドルは利上げ観測の高まりなどから上昇しました。2018年9月中旬以降は、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。12月以降は、株価や原油価格の急落を受けて市場のリスク回避姿勢が強まり、円高が進行しました。2019年1月に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり、市場のリスク選好姿勢が回復したことなどから、米ドルを中心に上昇に転じました。4月以降は、米中の貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマーク (M S C I 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。

## ポートフォリオについて

（2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17）

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率（リート、株価指数先物を含む。）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。

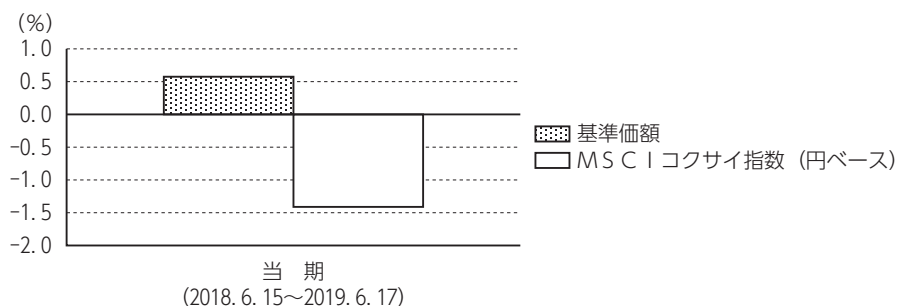
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.6%となりました。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、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	
	2018年6月16日 ~2019年6月17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)	4,011

- (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

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

### ■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	61円	0.440%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は13,809円です。
(投信会社)	(43)	(0.309)	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)	(15)	(0.109)	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	0.003	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当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)	(0.002)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.006	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.006)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	5	0.039	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(4)	(0.032)	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)	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	67	0.488	

(注1) 当期中の費用(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

(2018年6月16日から2019年6月17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 マザーファンド	679,057	1,662,926	207,115	515,828

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

項 目	当 期	
	外国株式インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	13,874,481千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	102,773,565千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.13	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当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	当 期 末		
	期 首	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス マザーファンド	1,334,039	1,805,981	4,523,081

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス マザーファンド	4,523,081	99.7
コール・ローン等、その他	13,353	0.3
投資信託財産総額	4,536,434	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1香港・ドル=13.87円、1シンガポール・ドル=79.26円、1ニュージーランド・ドル=70.62円、1イギリス・ポンド=136.75円、1イスラエル・シケル=30.11円、1スイス・フラン=108.77円、1デンマーク・クローネ=16.32円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローネ=11.45円、1ユーロ=121.87円です。

(注3) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(112,279,631千円)の投資信託財産総額(113,235,106千円)に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,536,434,866円
コール・ローン等	12,043,433
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	4,523,081,433
未収入金	1,310,000
(B) 負債	13,048,288
未払解約金	4,273,865
未払信託報酬	8,666,456
その他未払費用	107,967
(C) 純資産総額(A-B)	4,523,386,578
元本	3,228,404,217
次期繰越損益金	1,294,982,361
(D) 受益権総口数	3,228,404,217口
1万口当り基準価額(C/D)	14,011円

\* 期首における元本額は2,374,174,372円、当作成期間中における追加設定元本額は1,523,438,524円、同解約元本額は669,208,679円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,011円です。

■損益の状況

当期自2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,016円
受取利息	601
支払利息	△ 5,617
(B) 有価証券売買損益	63,380,150
売買益	85,692,953
売買損	△ 22,312,803
(C) 信託報酬等	△ 16,578,559
(D) 当期損益金(A+B+C)	46,796,575
(E) 前期繰越損益金	252,542,939
(F) 追加信託差損益金	995,642,847
(配当等相当額)	( 279,205,517)
(売買損益相当額)	( 716,437,330)
(G) 合計(D+E+F)	1,294,982,361
次期繰越損益金(G)	1,294,982,361
追加信託差損益金	995,642,847
(配当等相当額)	( 279,205,517)
(売買損益相当額)	( 716,437,330)
分配準備積立金	299,344,530
繰越損益金	△ 5,016

(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	46,799,914
(c) 収益調整金	995,642,847
(d) 分配準備積立金	252,544,616
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,294,987,377
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,294,987,377
(h) 受益権総口数	3,228,404,217口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2018年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2019年6月17日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を78～96ページに併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.42	275,237	193,829	SHIRE PLC (ジャージー)	24.324	154,583	6,355
MICROSOFT CORP (アメリカ)	22.35	272,358	12,186	APPLE INC (アメリカ)	4	89,132	22,283
APPLE INC (アメリカ)	8	166,503	20,812	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	5	59,811	11,962
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	6.95	119,932	17,256	KEURIG DR PEPPER INC (アメリカ)	4.348	59,324	13,644
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.94	115,813	123,205	RELX PLC (イギリス)	24.719	57,927	2,343
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	7.6	114,665	15,087	ORACLE CORP (アメリカ)	9.2	53,290	5,792
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	12.95	111,750	8,629	OLD MUTUAL PLC (イギリス)	122.525	37,351	304
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.87	107,658	123,745	CISCO SYSTEMS INC (アメリカ)	5.8	33,341	5,748
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	4.55	104,934	23,062	QUALCOMM INC (アメリカ)	5.15	30,591	5,940
CHEVRON CORP (アメリカ)	6.25	82,468	13,194	LUXOTTICA GROUP SPA (イタリア)	4.5	29,822	6,627

(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、2019年6月17日現在における外国株式インデックスマザーファンド（44,938,531千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2019年6月17日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	30.5	396	43,133	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	25	508	55,223	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	51.5	431	46,911	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	208	22,676	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	176	597	64,926	金融
ABBOTT LABORATORIES	481.16	3,956	429,869	ヘルスケア
ARCONIC INC	113.33	260	28,298	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	41.5	605	65,760	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	105	601	65,352	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	82	773	84,022	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	88.29	1,071	116,466	情報技術
QORVO INC	34	209	22,720	情報技術
AFLAC INC	202.5	1,114	121,108	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	34	406	44,215	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	39	249	27,117	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	134	3,675	399,363	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	64.5	296	32,239	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	30.5	538	58,563	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	100	163	17,755	金融
GARMIN LTD	36.5	291	31,645	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	59.8	1,311	142,465	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	200.5	3,464	376,489	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	44.71	569	61,830	情報技術
WR BERKLEY CORP	38.25	250	27,273	金融
AUTOZONE INC	6.7	750	81,528	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	63.21	697	75,765	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	309	254	27,666	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	29.5	287	31,246	公益事業
CELANESE CORP	35.5	369	40,190	素材
DR HORTON INC	94.16	432	47,023	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	24.5	89	9,775	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	59	334	36,394	ヘルスケア
AUTODESK INC	59.5	941	102,254	情報技術
MOODY'S CORP	46.5	894	97,163	金融
DEVON ENERGY CORP	128.5	331	35,982	エネルギー
ALBEMARLE CORP	28	198	21,565	素材
ATMOS ENERGY CORP	30.5	320	34,795	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	62.5	312	33,956	公益事業
CITIGROUP INC	655.73	4,424	480,805	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	118	1,953	212,253	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	133.5	1,209	131,396	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.1	283	30,777	金融
DOMINO'S PIZZA INC	11	308	33,544	一般消費財・サービス
HESS CORP	72	412	44,789	エネルギー
DAVITA INC	35	171	18,589	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2019年6月17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		
DANAHER CORP	172	2,401	260,961	ヘルスケア
FORTIVE CORP	82	634	68,901	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	155.5	1,320	143,503	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	49	132	14,412	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	47.28	112	12,252	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	151	615	66,926	生活必需品
BUNGE LTD	40	231	25,148	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	94.25	854	92,846	情報技術
APPLE INC	1,290	24,863	2,701,663	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	89	689	74,899	金融
BOEING CO/THE	147.4	5,117	556,028	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	42.15	436	47,421	金融
BECTON DICKINSON AND CO	74.49	1,744	189,531	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	134	14,589	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	38.5	303	32,982	情報技術
CDK GLOBAL INC	32	155	16,895	情報技術
NISOURCE INC	101.5	291	31,708	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	38.5	322	35,015	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	264.21	1,175	127,726	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,122.04	6,539	710,554	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	355	7,283	791,390	金融
ANSYS INC	22.5	443	48,195	情報技術
H&R BLOCK INC	58	166	18,081	一般消費財・サービス
BB&T CORP	207.5	1,038	112,870	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	447.5	2,128	231,262	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	892.7	9,803	1,065,262	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	66.5	704	76,551	金融
LKQ CORP	85	223	24,235	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	11.5	205	22,326	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	85.62	481	52,341	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	78.5	531	57,763	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	38.1	584	63,560	金融
DOLLAR GENERAL CORP	72	976	106,157	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	50.1	1,363	148,209	情報技術
CATERPILLAR INC	160	2,035	221,196	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	77	452	49,155	公益事業
MOSAIC CO/THE	97.5	218	23,688	素材
DELTA AIR LINES INC	47.5	265	28,898	資本財・サービス
CORNING INC	220	680	73,890	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,210.5	6,627	720,142	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	37	229	24,962	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	354.5	1,517	164,942	金融
WABCO HOLDINGS INC	14	183	19,896	資本財・サービス
MSCI INC	24.5	577	62,768	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	10	275	29,972	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	14.5	190	20,655	資本財・サービス
COTY INC-CL A	135.39	183	19,978	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	60.5	342	37,195	情報技術
BROADCOM INC	110.72	2,944	319,936	情報技術
ACUITY BRANDS INC	11.5	153	16,682	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	24.3	170	18,490	ヘルスケア
ARAMARK	64.5	222	24,158	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	60.5	157	17,144	素材
DTE ENERGY COMPANY	49.5	641	69,675	公益事業
CENTENE CORP	115.5	618	67,206	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	30	323	35,121	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	129	451	49,017	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	50	438	47,647	金融
GARTNER INC	25	396	43,078	情報技術
SPLUNK INC	40	472	51,391	情報技術
DOMINION ENERGY INC	218.41	1,674	181,932	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	111	680	73,971	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	41.5	188	20,531	資本財・サービス
DEERE & CO	82.5	1,249	135,820	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	42.5	674	73,339	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	23	387	42,058	情報技術
CHEMOURS CO/THE	45.5	108	11,786	素材
BURLINGTON STORES INC	19	320	34,826	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	31.5	301	32,759	金融
VAIL RESORTS INC	11.2	264	28,718	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	41	181	19,713	金融
TARGA RESOURCES CORP	58.5	214	23,258	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	18	276	30,012	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	19.8	206	22,467	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	66	7,274	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	89.5	792	86,105	公益事業
COGNEX CORP	45.5	198	21,600	情報技術
TELEFLEX INC	12.3	393	42,800	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	23	208	22,705	資本財・サービス
WELLCARE HEALTH PLANS INC	14	401	43,674	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	33.5	551	59,927	ヘルスケア
IDEX CORP	21	335	36,436	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	223	1,635	177,735	生活必需品
ROLLINS INC	38.25	144	15,648	資本財・サービス



銘柄	2019年6月17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		
AMETEK INC	61.75	524	57,026	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	65	501	54,497	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	36.5	117	12,778	資本財・サービス
HEICO CORP	12	151	16,451	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	34.5	195	21,270	資本財・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	20	326	35,477	情報技術
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	10.5	311	33,809	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	89	769	83,651	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	120	3,121	339,214	生活必需品
GRUBHUB INC	26	182	19,821	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	15	261	28,441	情報技術
AFFILIATED MANAGERS GROUP	15	132	14,401	金融
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7.4	548	59,549	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	83.5	150	16,313	金融
UGI CORP	46	244	26,516	公益事業
CUMMINS INC	40.5	663	72,110	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	210.5	960	104,346	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	76.5	170	18,528	情報技術
CDW CORP/DE	40.5	422	45,873	情報技術
SIGNATURE BANK	15	174	18,955	金融
COSTAR GROUP INC	9.7	533	57,934	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	14.9	325	35,324	金融
AMERCO	2.2	85	9,300	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16.5	234	25,466	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	11.7	720	78,313	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	95	157	17,125	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	21	289	31,446	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	74.16	692	75,279	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	53.5	85	9,243	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	10.2	134	14,623	情報技術
DEXCOM INC	24.5	362	39,410	ヘルスケア
COPART INC	58.5	431	46,918	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	42.5	420	45,695	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	29	198	21,585	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	20.7	632	68,759	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12.8	605	65,767	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	99	228	24,806	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	560.81	1,151	125,104	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	73.5	930	101,133	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	10.5	336	36,515	金融
CABOT OIL & GAS CORP	120.5	286	31,123	エネルギー
T-MOBILE US INC	95	711	77,317	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	34.5	156	17,015	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,106	5,674	616,633	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	57.5	326	35,450	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	48.5	358	38,982	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	30.5	126	13,700	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	86.5	288	31,355	金融
CSX CORP	214.5	1,655	179,864	資本財・サービス
FLUOR CORP	36.5	106	11,624	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	27.8	462	50,262	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	34.25	434	47,193	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	24	158	17,206	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	114.3	21,370	2,322,099	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	66.5	113	12,320	エネルギー
FLOWSERVE CORP	35.5	173	18,808	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	56.5	1,039	112,919	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,160.55	8,628	937,593	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	37.5	191	20,830	情報技術
AES CORP	184	314	34,168	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	22	542	58,988	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	11.2	281	30,552	金融
EOG RESOURCES INC	156.5	1,332	144,834	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	44.5	349	38,015	情報技術
ABIOMED INC	11.7	293	31,905	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	42.5	361	39,276	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	87.4	611	66,449	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,071.23	1,069	116,167	一般消費財・サービス
MACY'S INC	80.98	174	18,971	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	39.9	115	12,581	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	35	384	41,750	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	130	14,183	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	100.89	270	29,423	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	34	165	18,021	資本財・サービス
FORTINET INC	38	287	31,261	情報技術
MARKEL CORP	3.8	413	44,912	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	44	106	11,584	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	130	2,690	292,347	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	406.08	432	46,992	素材
US BANCORP	416.5	2,191	238,141	金融
UNITED RENTALS INC	23	282	30,707	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	219	23,806	情報技術
FASTENAL CO	154	487	52,961	資本財・サービス
FISERV INC	106	945	102,740	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2019年6月17日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
GENERAL ELECTRIC CO	2,389.5	2,444	265,614	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	44.5	148	16,150	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	61	331	35,978	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	342	1,219	132,518	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	27.5	125	13,611	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	68	1,164	126,534	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	90.9	1,742	189,306	金融
ALPHABET INC-CL A	82	8,907	967,906	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	85.57	9,287	1,009,162	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	31.5	158	17,189	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	163.5	873	94,887	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	146.68	644	70,080	公益事業
GENUINE PARTS CO	40	411	44,737	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	107.34	636	69,188	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	226	619	67,262	金融
HARRIS CORP	32.5	619	67,309	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	98	10,653	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	234	500	54,361	エネルギー
HOME DEPOT INC	309.5	6,368	692,010	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	17.5	185	20,179	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	294	392	42,679	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11.9	255	27,773	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	41.5	574	62,373	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	44.5	154	16,749	一般消費財・サービス
HUMANA INC	37.3	939	102,067	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	94	854	92,835	情報技術
HELMERICH & PAYNE	29	140	15,251	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	40.5	288	31,368	ヘルスケア
HP INC	433	862	93,676	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	394	557	60,579	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	48	176	19,151	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	47	189	20,581	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	54.5	199	21,638	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	25	91	9,912	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	111.5	396	43,083	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	186.53	565	61,433	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	244.5	3,304	359,058	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	107	459	49,982	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	40	216	23,474	資本財・サービス
ZOETIS INC	130.5	1,445	157,101	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	65.79	820	89,130	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	65.5	428	46,553	エネルギー
ALLEGION PLC	24.5	259	28,224	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	35	130	14,219	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	135.73	351	38,227	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	72.07	680	73,972	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	96.5	257	27,933	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	31.7	390	42,474	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	730	10,226	1,111,219	ヘルスケア
ABBVIE INC	403.29	3,173	344,831	ヘルスケア
HOLOGIC INC	75.5	361	39,247	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	93	1,280	139,100	生活必需品
KROGER CO	218.5	530	57,598	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	43.5	477	51,852	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	69.2	2,422	263,279	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	24.4	665	72,290	情報技術
L BRANDS INC	65	146	15,898	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	218.5	2,176	236,543	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	245.05	2,738	297,531	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	42.3	747	81,262	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	12.5	166	18,082	不動産
LOEWS CORP	79	422	45,959	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	57.99	368	39,999	金融
MCDONALD'S CORP	210	4,311	468,443	一般消費財・サービス
3M CO	156	2,600	282,555	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	651.5	11,813	1,283,671	コミュニケーション・サービス
MANPOWERGROUP INC	17.8	161	17,562	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	67.3	1,513	164,465	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	17.2	385	41,860	素材
CONCHO RESOURCES INC	54.5	536	58,248	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	160.5	426	46,337	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	58.5	190	20,722	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	126	1,078	117,182	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	121	275	29,898	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	132.5	366	39,823	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	77.88	402	43,767	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	34.5	540	58,705	生活必需品
MYLAN NV	137.5	234	25,429	ヘルスケア
METLIFE INC	227	1,107	120,393	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	169	402	43,760	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	13.9	328	35,656	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	42	183	19,888	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	44.78	718	78,023	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6.9	545	59,310	ヘルスケア

銘柄	2019年6月17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		
BAKER HUGHES A GE CO	132.73	293	31,945	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	31.8	497	54,087	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	29.4	113	12,283	金融
MERCK & CO. INC.	707.71	5,858	636,576	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	207.18	1,555	169,021	素材
MASCO CORP	86	329	35,781	資本財・サービス
M & T BANK CORP	35.69	599	65,112	金融
MARSH & MCLENNAN COS	137	1,345	146,154	金融
HEICO CORP-CLASS A	21	211	22,971	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	80.72	1,079	117,251	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	42	873	94,925	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	16.5	261	28,365	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	90.5	647	70,399	情報技術
TRANSUNION	51	361	39,301	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	100.5	238	25,957	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	38.5	129	14,018	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	82.5	1,016	110,406	情報技術
BEIGENE LTD-ADR	9.5	111	12,141	ヘルスケア
NETAPP INC	68.5	417	45,388	情報技術
NIKE INC -CL B	343	2,861	310,984	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	73.2	1,425	154,894	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	64	532	57,852	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	34.5	284	30,949	金融
ALLY FINANCIAL INC	114.5	334	36,341	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	44.5	1,376	149,620	資本財・サービス
APTIV PLC	73	549	59,753	一般消費財・サービス
NEWMONT GOLDCORP CORP	224.61	807	87,691	素材
MCKESSON CORP	53	705	76,669	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	76	425	46,286	情報技術
XYLEM INC	48	389	42,288	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	426.5	3,292	357,771	生活必需品
NUCOR CORP	87	449	48,874	素材
WESTERN UNION CO	117.46	235	25,641	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	45	315	34,247	情報技術
NEWELL BRANDS INC	122.92	178	19,366	一般消費財・サービス
EVERGY INC	69	418	45,487	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	205	1,010	109,839	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	7	173	18,804	金融
OKTA INC	28	361	39,232	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	28.5	286	31,150	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	73.05	233	25,360	ヘルスケア
LINDE PLC	151.46	3,070	333,612	素材
WIX. COM LTD	13	185	20,191	情報技術
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	83	176	19,182	金融
KKR & CO INC -A	135	321	34,897	金融
PAYCHEX INC	88	762	82,884	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22	853	92,742	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	513.5	2,611	283,783	生活必需品
PFIZER INC	1,553.13	6,641	721,631	ヘルスケア
ALKERMES PLC	40	87	9,514	ヘルスケア
CIGNA CORP	105.3	1,668	181,251	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	41.01	210	22,868	情報技術
ALTICE USA INC- A	92	218	23,792	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	137	822	89,363	公益事業
STERIS PLC	23	322	35,095	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	48.33	168	18,359	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	93.99	331	35,990	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	93	1,817	197,529	ヘルスケア
DOW INC	207.18	1,059	115,149	素材
PARKER HANNIFIN CORP	35	574	62,450	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	52	224	24,426	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	47	665	72,305	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	15.5	138	15,090	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	680.67	7,569	822,453	生活必需品
EXELON CORP	260.72	1,324	143,915	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	60	707	76,885	ヘルスケア
NVR INC	0.9	311	33,833	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	313	1,841	200,050	エネルギー
TWILIO INC - A	31.5	441	47,977	情報技術
DOCUSIGN INC	29	147	16,001	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	14	300	32,606	情報技術
PEPSICO INC	381.5	5,063	550,216	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	11	143	15,574	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	52	121	13,255	情報技術
MONGODB INC	9	149	16,202	情報技術
SNAP INC - A	190	265	28,820	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	207.18	521	56,708	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	110	1,091	118,605	金融
AMCOR PLC	135	147	16,033	素材
AMERICAN WATER WORKS CO INC	48.5	573	62,328	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	174.5	3,227	350,724	情報技術
PENTAIR PLC	47.05	167	18,210	資本財・サービス
QUALCOMM INC	331.5	2,278	247,534	情報技術
INVESCO LTD	109.5	226	24,558	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2019年6月17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		
ADVANCE AUTO PARTS INC	20.5	311	33,813	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	78	436	47,386	金融
RAYTHEON COMPANY	77.2	1,369	148,770	資本財・サービス
RED HAT INC	47.5	879	95,588	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	21.6	659	71,641	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	60	521	56,714	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	12.4	2,201	239,228	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	103	1,039	113,005	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	26.5	252	27,447	素材
RESMED INC	39	460	50,043	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	38	383	41,716	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	33.5	188	20,475	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	14.5	162	17,666	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	31	288	31,306	ヘルスケア
REGIONS FINANCIAL CORP	280.35	409	44,445	金融
CHEVRON CORP	520.68	6,290	683,507	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	88	523	56,837	公益事業
TESLA INC	36.2	778	84,538	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	172.5	333	36,288	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	41.22	583	63,381	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	41	511	55,599	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	43.05	1,687	183,407	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	87	431	46,851	不動産
TWITTER INC	201.5	728	79,150	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	284.5	1,583	172,035	公益事業
SYSCO CORP	133	960	104,414	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	71.23	1,069	116,182	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	35.5	191	20,803	金融
STEEL DYNAMICS INC	62	163	17,805	素材
SCHLUMBERGER LTD	376.52	1,352	146,999	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	46	210	22,912	資本財・サービス
AT&T INC	1,982.91	6,414	697,022	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	40.5	209	22,804	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	110	209	22,769	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	22.8	1,079	117,344	素材
SEMPRA ENERGY	73.5	1,012	110,022	公益事業
TIFFANY & CO	29.5	268	29,176	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	76	336	36,550	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	257.5	2,763	300,252	情報技術
SALESFORCE.COM INC	208.5	3,127	339,856	情報技術
WESTROCK CO	71.3	257	27,929	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	248.84	994	108,020	資本財・サービス
UNION PACIFIC CORP	197.5	3,298	358,366	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	226	293	31,875	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	184.88	886	96,347	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	224.37	2,811	305,481	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	192.5	1,956	212,559	資本財・サービス
UNUM GROUP	59	194	21,188	金融
SPRINT CORP	207.65	145	15,816	コミュニケーション・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	46.44	656	71,302	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	235	25,609	金融
AMEREN CORPORATION	67	513	55,846	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	263.26	6,459	701,901	ヘルスケア
VERISIGN INC	29	595	64,661	情報技術
VALERO ENERGY CORP	112.92	866	94,183	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	15.1	535	58,184	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	74.88	298	32,431	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	23	282	30,677	ヘルスケア
ANTHEM INC	70.3	2,005	217,950	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	489.12	6,928	752,838	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,202.22	5,480	595,556	金融
WASTE MANAGEMENT INC	115	1,317	143,178	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	331	893	97,073	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	32	339	36,906	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	230	25,063	一般消費財・サービス
WALMART INC	398	4,340	471,691	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	227	24,745	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	55.5	651	70,829	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	26	300	32,661	一般消費財・サービス
XEROX CORP	59.11	203	22,107	情報技術
WABTEC CORP	44.11	299	32,592	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	334.5	1,784	193,873	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	416	45,263	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	156	17,039	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	91.07	1,055	114,710	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	15	286	31,100	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	219	1,151	125,098	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	35.23	670	72,860	金融
WESTERN DIGITAL CORP	78	283	30,791	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	86.8	731	79,518	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	141	859	93,397	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	475.5	8,067	876,596	情報技術
PPL CORP	201	632	68,688	公益事業
PULTEGROUP INC	75	246	26,771	一般消費財・サービス

銘柄	2019年6月17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		
PPG INDUSTRIES INC	64.5	751	81,684	素材
NORTHERN TRUST CORP	56.5	492	53,516	金融
NVIDIA CORP	155.5	2,249	244,392	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	20.5	468	50,881	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	125.43	1,695	184,280	金融
QURATE RETAIL INC	114.5	146	15,962	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	185	20,177	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	79	647	70,312	生活必需品
NETFLIX INC	118.9	4,039	438,920	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	108	3,080	334,760	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	79.5	276	30,044	公益事業
TORCHMARK CORP	29.25	260	28,340	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	45	433	47,112	金融
TEXTRON INC	68.5	338	36,806	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	102.37	121	13,159	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	53	230	24,993	公益事業
OMNICOM GROUP	60.5	480	52,170	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	712.83	3,797	412,686	情報技術
MASTERCARD INC - A	248.5	6,463	702,322	情報技術
ONEOK INC	112.5	725	78,797	エネルギー
CENTURYLINK INC	270.52	300	32,628	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	28.2	1,028	111,727	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	83	911	99,017	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	30.5	336	36,574	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13.3	185	20,203	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	50.5	272	29,631	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	133.5	263	28,620	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,511.01	7,040	765,061	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	49	396	43,041	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	97	10,630	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	197	2,403	261,153	金融
ANALOG DEVICES INC	99.99	1,040	113,016	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	266	807	87,751	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	77	389	42,269	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	238.22	1,269	137,992	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	139	970	105,469	エネルギー
SKYWORCS SOLUTIONS INC	48	344	37,448	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	49.5	614	66,765	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	23	253	27,588	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	158	973	105,825	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	170	1,067	115,949	資本財・サービス
AON PLC	65	1,239	134,731	金融
AMGEN INC	172	3,028	329,085	ヘルスケア
TAPESTRY INC	76.5	225	24,555	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	115.36	904	98,236	資本財・サービス
CELGENE CORP	195	1,881	204,492	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	45.3	849	92,357	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	263	1,084	117,825	情報技術
CIT GROUP INC	28	140	15,270	金融
CIMAREX ENERGY CO	25	136	14,832	エネルギー
CME GROUP INC	99	1,951	212,027	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	105.94	211	23,022	エネルギー
ECOLAB INC	70.5	1,402	152,344	素材
EQUIFAX INC	31.5	415	45,194	資本財・サービス
GAP INC/THE	59.5	108	11,753	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	349	2,315	251,652	ヘルスケア
HORMEL FOODS CORP	77.5	321	34,888	生活必需品
STATE STREET CORP	102.43	567	61,615	金融
SUNTRUST BANKS INC	119.48	771	83,829	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	329	1,349	146,607	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	137	1,067	116,009	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	48.5	204	22,271	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	34.5	199	21,720	素材
CARDINAL HEALTH INC	83	366	39,826	ヘルスケア
FEDEX CORP	68	1,118	121,584	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	126.04	1,141	124,040	金融
FMC CORP	36	287	31,258	素材
FLEX LTD	147.5	133	14,488	情報技術
CERNER CORP	90	650	70,636	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	27.74	412	44,848	素材
CITRIX SYSTEMS INC	37	358	38,913	情報技術
INTEL CORP	1,226	5,662	615,330	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	102	225	24,460	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	97.5	535	58,215	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	89.5	1,333	144,952	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	461	256	27,851	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	39.7	1,365	148,394	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	195	21,189	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	31.6	1,569	170,494	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	34.5	390	42,481	情報技術
SNAP-ON INC	15.5	254	27,636	資本財・サービス
CARMAX INC	46	384	41,756	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	315	34,330	金融
INGREDIENT INC	19	155	16,846	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2019年6月17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	
DUKE ENERGY CORP	198.78	1,746	189,794	公益事業
TARGET CORP	143	1,255	136,411	一般消費財・サービス
DOVER CORP	39	374	40,711	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	13	354	38,473	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	39.5	309	33,606	資本財・サービス
CINTAS CORP	25	590	64,209	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	127	379	41,233	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	41	253	27,492	生活必需品
CLOROX COMPANY	35	549	59,663	生活必需品
ENTERGY CORP	50.5	515	55,992	公益事業
MICROSOFT CORP	1,996	26,437	2,872,646	情報技術
INCYTE CORP	50	388	42,219	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	358.69	1,943	211,128	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	365.38	3,562	387,096	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	303.5	991	107,707	情報技術
BLACKROCK INC	33	1,475	160,273	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	137	405	44,093	公益事業
HASBRO INC	33.5	359	39,116	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	68.5	387	42,150	生活必需品
KEYCORP	282	483	52,551	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	27.5	321	34,934	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	394.61	2,172	236,045	生活必需品
KOHL'S CORP	44.5	212	23,098	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	13	420	45,640	ヘルスケア
APACHE CORP	106.1	291	31,692	エネルギー
CHUBB LTD	126.99	1,908	207,339	金融
ARROW ELECTRONICS INC	24	161	17,498	情報技術
ALLSTATE CORP	92	939	102,106	金融
EBAY INC	245	953	103,585	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	306	3,554	386,264	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	37.5	270	29,374	素材
XILINX INC	69	727	79,039	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	64.5	242	26,310	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	52	233	25,358	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	58.5	1,034	112,435	生活必需品
TRIMBLE INC	70.5	301	32,725	情報技術
LENNAR CORP-A	81	433	47,131	一般消費財・サービス
LEAR CORP	18	240	26,150	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	70	317	34,463	金融
PROGRESSIVE CORP	159	1,303	141,601	金融
PACCAR INC	95.37	667	72,561	資本財・サービス
PVH CORP	20	176	19,135	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	54.6	1,243	135,072	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	23.7	634	68,949	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	340	2,864	311,219	一般消費財・サービス
PTC INC	31.5	264	28,717	情報技術
PERRIGO CO PLC	34	146	15,952	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	85.3	660	71,748	公益事業
INTUIT INC	70.7	1,796	195,229	情報技術
BORGWARNER INC	56	229	24,917	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	65	429	46,636	一般消費財・サービス
BALL CORP	87.34	571	62,076	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	383.47	1,549	168,421	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	82	760	82,623	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	37	490	53,306	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	71	1,208	131,322	ヘルスケア
VF CORP	91	794	86,283	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	93.71	459	49,884	コミュニケーション・サービス
VIACOM INC-CLASS B	92.71	272	29,607	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	17.2	261	28,462	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	24	314	34,131	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	111.5	592	64,358	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,235.9	5,229	568,193	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	61	226	24,590	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	62	401	43,655	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	68	7,432	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	313	207	22,515	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	83,179.23 616銘柄	73,488,262 <65.3%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	76	274	22,247	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	721	58,441	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	59.96	103	8,411	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	67.87	617	49,993	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	120	369	29,957	素材
INTACT FINANCIAL CORP	38.5	463	37,518	金融
BCE INC	41.3	247	20,031	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	51	534	43,297	素材
SUNCOR ENERGY INC	439.3	1,827	147,990	エネルギー
METRO INC/CN	73	368	29,872	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	95	586	47,501	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	344	2,428	196,691	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	125.5	1,299	105,223	金融

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
TORONTO-DOMINION BANK	509	3,863	312,969	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	83	249	20,169	金融
ROYAL BANK OF CANADA	401.5	4,157	336,760	金融
TOURMALINE OIL CORP	66	102	8,318	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	45	120	9,761	エネルギー
TC ENERGY CORP	254.5	1,671	135,354	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	139.29	673	54,562	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	530	115	9,358	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	499	931	75,421	素材
CAE INC	72	249	20,172	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	54.12	472	38,269	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	46	146	11,863	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	16	99	8,062	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	41.5	266	21,587	素材
HYDRO ONE LTD	92	210	17,035	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	54.6	379	30,701	生活必需品
WSP GLOBAL INC	27	189	15,385	資本財・サービス
QUEBECOR INC -CL B	53	169	13,737	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	17	90	7,360	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	33	125	10,144	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	100	690	55,930	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	64	397	32,171	素材
STARS GROUP INC/THE	63	138	11,236	一般消費財・サービス
KINROSS GOLD CORP	341	161	13,092	素材
BANK OF MONTREAL	179	1,784	144,511	金融
POWER CORP OF CANADA	94	261	21,204	金融
METHANEX CORP	17	101	8,256	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	27	1,104	89,481	情報技術
NUTRIEN LTD	169.19	1,208	97,876	素材
AURORA CANNABIS INC	198	200	16,246	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	55	303	24,618	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	55	114	9,244	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	58	296	24,049	素材
CAMECO CORP	106	146	11,865	エネルギー
TELUS CORP	54	262	21,257	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	70	208	16,856	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	140	407	33,044	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	248	20,127	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	338	1,202	97,383	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	506	41,039	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	87	537	43,501	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	20.37	206	16,742	生活必需品
BLACKBERRY LTD	135	154	12,542	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	165.5	872	70,660	金融
ENBRIDGE INC	563	2,603	210,913	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	234.5	1,483	120,159	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	547	1,275	103,323	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	87	250	20,302	ヘルスケア
ENCANA CORP	418	261	21,161	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	39	1,213	98,276	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	29	152	12,318	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	56	291	23,596	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	201.5	2,469	200,052	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	69	705	57,158	情報技術
HUSKY ENERGY INC	93.58	118	9,626	エネルギー
ONEX CORPORATION	22	165	13,423	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	125	333	27,003	コミュニケーション・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	45	114	9,302	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	24	90	7,340	金融
OPEN TEXT CORP	75	415	33,631	情報技術
CI FINANCIAL CORP	70	147	11,935	金融
SAPUTO INC	63	250	20,304	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193	215	17,430	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	121	1,038	84,092	生活必需品
FORTIS INC	117	610	49,422	公益事業
LUNDIN MINING CORP	194	130	10,575	素材
CENOVUS ENERGY INC	293	332	26,960	エネルギー
DOLLARAMA INC	83	388	31,450	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	22	99	8,040	公益事業
ALTAGAS LTD	69	132	10,719	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	48	106	8,635	不動産
KEYERA CORP	60	193	15,673	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	115	229	18,592	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,209.58 86銘柄	51,463 <3.7%>	4,168,542
(オーストラリア)		百株	千オーストラリア・ドル	千円
MEDIBANK PRIVATE LTD	728	246	18,388	金融
BHP GROUP LTD	821.5	3,310	247,404	素材
SOUTH32 LTD	1,411	467	34,901	素材
ALUMINA LTD	693	168	12,584	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	257	900	67,277	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	425	374	27,949	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	133	152	11,410	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千オーストラリア・ドル	千円		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	772.5	2,064	154,309	金融
WESTPAC BANKING CORP	968.48	2,700	201,780	金融
SANTOS LTD	487	340	25,475	エネルギー
AUSNET SERVICES	500	97	7,267	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	789.5	2,227	166,496	金融
RIO TINTO LTD	103	1,085	81,082	素材
ORIGIN ENERGY LTD	495	347	25,967	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD	543	289	21,668	資本財・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	78	5,831	エネルギー
COLES GROUP LTD	315.45	410	30,669	生活必需品
AMCOR PLC-CDI	314	491	36,723	素材
OIL SEARCH LTD	384	268	20,087	エネルギー
SEEK LTD	96	202	15,130	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	205	308	23,086	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	209.5	631	47,155	素材
INCITEC PIVOT LTD	423	147	11,000	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	493	3,932	293,887	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	71.5	189	14,143	エネルギー
ORICA LTD	101	206	15,435	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	360.5	440	32,947	金融
CIMIC GROUP LTD	28	126	9,426	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	364	1,175	87,834	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	137	137	10,248	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	577	264	19,791	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	96	114	8,587	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	1,202	465	34,762	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	840	177	13,245	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	120.5	222	16,614	素材
MACQUARIE GROUP LTD	89.34	1,090	81,511	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	163.5	500	37,412	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	108	103	7,699	金融
CSL LTD	125.5	2,671	199,642	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	319.45	1,139	85,129	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	16.5	336	25,182	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	144	169	12,655	素材
SUNCORP GROUP LTD	362	483	36,168	金融
BORAL LTD	305	164	12,285	素材
ASX LTD	54	437	32,686	金融
COMPUTERSHARE LTD	139	231	17,274	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	56	4,226	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	630.36	491	36,696	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	121.5	334	24,969	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	139	90	6,751	金融
WORLEYPARSONS LTD	94	129	9,651	エネルギー
AGL ENERGY LTD	190	371	27,786	公益事業
BRAMBLES LTD	443	574	42,937	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	57	4,321	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	38.5	275	20,620	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD	87	56	4,238	コミュニケーション・サービス
REA GROUP LTD	13.5	125	9,358	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	16.5	64	4,843	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	19,252.08 58銘柄	34,719 <2.3%>	2,594,623
(香港)		百株	千香港・ドル	千円
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	375	2,107	29,231	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	650	3,152	43,725	一般消費財・サービス
MTR CORP	425	2,097	29,090	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	440	5,539	76,834	不動産
SINO LAND CO	900	1,125	15,603	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	766.69	5,757	79,861	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	320	646	8,965	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	135	1,266	17,563	不動産
CLP HOLDINGS LTD	455	4,051	56,198	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	395.07	1,592	22,082	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	2,881.99	4,951	68,673	公益事業
HANG SENG BANK LTD	214	4,155	57,642	金融
WHELOCK & CO LTD	220	1,159	16,080	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,690	1,943	26,956	不動産
WH GROUP LTD	2,650	1,947	27,015	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	333	8,671	120,271	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	570	981	13,613	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	76	555	7,700	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	190	406	5,639	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	425	661	9,172	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	175	540	7,500	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	366.4	804	11,154	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	170	673	9,337	不動産
SJM HOLDINGS LTD	580	475	6,596	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	326	1,030	14,288	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	726.69	4,280	59,366	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	180	1,134	15,728	公益事業



銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
PCCW LTD	1,170	533	7,399	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	3,360	24,796	343,931	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	330	1,712	23,755	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	220	1,021	14,173	生活必需品
SANDS CHINA LTD	672	2,419	33,554	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	283	3,932	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	380	2,101	29,146	資本財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	236	284	3,947	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,020	3,080	42,725	金融
WYNN MACAU LTD	420	672	9,320	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 >	24,743.84 37銘柄	98,614 1,367,781	<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	373	932	73,880	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	493	1,223	96,945	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	149.7	136	10,832	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	395	248	19,723	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	140	101	8,055	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	104	97	7,715	不動産
CAPITALAND LTD	689	236	18,731	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	693	101	8,074	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	97	7,701	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	98	7,811	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	895	964	76,470	金融
GENTING SINGAPORE LTD	1,700	150	11,924	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	72	119	9,490	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,209.5	735	58,316	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	440	180	14,333	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	288	68	5,409	資本財・サービス
GOLDEN AGR-RESOURCES LTD	1,644	44	3,518	生活必需品
SATS LTD	196	100	7,984	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	208	156	12,430	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	553	142	11,308	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	534	185	14,729	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 >	12,213.2 21銘柄	6,124 485,389	<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	345	154	10,927	公益事業
A2 MILK CO LTD	190	282	19,925	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	204	14,418	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	294	265	18,727	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	201	109	7,707	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	151	227	16,070	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	118	137	9,708	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 >	1,825.89 7銘柄	1,380 97,484	<0.1%>
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	193	72	9,971	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	118.97	89	12,205	一般消費財・サービス
BP PLC	5,662	3,051	417,258	エネルギー
UNILEVER PLC	307.6	1,529	209,206	生活必需品
BARCLAYS PLC	4,850	722	98,822	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	468	417	57,074	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	561	121	16,570	一般消費財・サービス
PRUDENTIAL PLC	730	1,169	159,873	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,347.91	286	39,150	金融
EVRAZ PLC	150	104	14,276	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	54.64	169	23,110	素材
BAE SYSTEMS PLC	898	435	59,521	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,075.66	439	60,103	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,383.52	2,192	299,762	ヘルスケア
INFORMA PLC	342	273	37,414	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	95.4	188	25,757	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,345	228	31,185	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	253	142	19,423	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	28	194	26,588	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	135	156	21,405	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	21	182	24,984	資本財・サービス
HALMA PLC	110	218	29,927	情報技術
GVC HOLDINGS PLC	167	104	14,259	一般消費財・サービス
NMC HEALTH PLC	27	62	8,488	ヘルスケア
RELX PLC	553.46	1,056	144,446	資本財・サービス
DIAGEO PLC	673.5	2,302	314,847	生活必需品
RIO TINTO PLC	314.5	1,500	205,147	素材
STANDARD CHARTERED PLC	783	529	72,425	金融
TESCO PLC	2,753	617	84,480	生活必需品
FRESNILLO PLC	56	47	6,431	素材
SMITH & NEPHEW PLC	250.5	426	58,354	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2019年6月17日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
GLENCORE PLC	3,113.25	846	115,821	素材
JOHN WOOD GROUP PLC	180	71	9,791	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	81.5	152	20,841	金融
SMITHS GROUP PLC	113.83	168	23,092	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	368.83	119	16,306	金融
PEARSON PLC	216.63	173	23,657	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	452.25	87	11,991	生活必需品
NEXT PLC	38.5	212	29,030	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	932	145	19,831	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	49.61	233	31,987	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	96.05	207	28,436	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	7,411.83	948	129,756	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	36.61	191	26,233	素材
KINGFISHER PLC	554.11	115	15,730	一般消費財・サービス
WPP PLC	354	339	46,492	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	187.27	154	21,107	公益事業
SEVERN TRENT PLC	63.33	129	17,667	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	540	210	28,784	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	196.5	1,282	175,362	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	151.5	157	21,598	金融
SCHRODERS PLC	34.5	101	13,818	金融
SSE PLC	280	314	42,961	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	68.5	100	13,802	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	285	160	21,887	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	353	2,193	300,015	ヘルスケア
FERGUSON PLC	66.87	372	50,898	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,631	434	59,484	金融
3I GROUP PLC	273.91	280	38,393	金融
ASHTREAD GROUP PLC	136.5	266	36,380	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	297.14	225	30,898	情報技術
NATIONAL GRID PLC	935.34	779	106,598	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	19,709.65	1,137	155,518	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	287.6	163	22,378	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	263	519	71,088	生活必需品
CENTRICA PLC	1,526.6	139	19,105	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32	112	15,447	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	643.1	1,855	253,762	生活必需品
BHP GROUP PLC	583.27	1,114	152,345	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	98	241	33,007	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	5,572.5	3,597	491,972	金融
ANGLO AMERICAN PLC	298.83	630	86,245	素材
MONDI PLC	101.5	175	23,964	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	663	131	17,933	生活必需品
CARNIVAL PLC	48.61	196	26,809	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	40	37	5,081	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	438.39	837	114,594	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	85	165	22,614	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	2,332	481	65,789	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	58	168	23,048	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	113.39	197	27,003	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	47.36	247	33,865	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	44	243	33,298	資本財・サービス
ITV PLC	931	97	13,399	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	87.99	479	65,529	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,239	3,116	426,124	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,042.68	2,623	358,818	エネルギー
MEGGITT PLC	215	109	15,029	資本財・サービス
G4S PLC	435	92	12,587	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC	55.5	115	15,771	金融
INVESTEC PLC	183	87	11,912	金融
ANTOFAGASTA PLC	114	97	13,391	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	708.62	192	26,348	金融
EXPERIAN PLC	253.54	610	83,489	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 >	83,458.15 94銘柄	50,226 <6.1%>	6,868,418 <6.1%>
(イスラエル)		百株	千イスラエル・シェケル	千円
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	345	490	14,782	金融
AZRIELI GROUP LTD	10	220	6,639	不動産
ISRAEL CHEMICALS LTD	176	336	10,132	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	6	335	10,098	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	307	796	23,987	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	410	1,023	30,813	金融
NICE LTD	16.5	820	24,711	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	30	239	7,211	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,300.5 8銘柄	4,263 <0.1%>	128,376 <0.1%>
(スイス)		百株	千スイス・フラン	千円
DUFREY AG-REG	12.5	101	10,985	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	1,087.5	1,252	136,267	金融

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スイス・フラン	千円	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.3	144	15,710	素材
ADECCO GROUP AG-REG	42.5	244	26,589	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	194.8	5,376	584,799	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	11	81	8,871	金融
SIKA AG-REG	35.9	570	62,087	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	234	25,484	生活必需品
ABB LTD-REG	521	981	106,708	資本財・サービス
SWISS RE AG	84	830	90,325	金融
NESTLE SA-REG	849	8,608	936,385	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5.3	377	41,068	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	11.4	247	26,919	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	722.7	821	89,338	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	64	261	28,450	金融
SGS SA-REG	1.5	387	42,126	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5.8	122	13,361	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	13	180	19,598	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	18.2	317	34,564	情報技術
ALCON INC	118.8	688	74,921	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	8.5	219	23,880	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	42.52	1,434	155,997	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	13.9	239	26,065	金融
CLARIANT AG-REG	57	107	11,646	素材
NOVARTIS AG-REG	602	5,382	585,452	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.6	118	12,908	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	144.1	1,144	124,512	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	7.1	352	38,304	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG	10.5	487	53,004	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	2.6	721	78,505	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2.9	243	26,527	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	15.4	355	38,626	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	21	691	75,172	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	15.2	74	8,140	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	136.4	663	72,178	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	9.7	460	50,073	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	14.9	199	21,717	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	20.3	169	18,481	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.29	199	21,717	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,926.14 39銘柄	35,096 3,817,478	<3.4%>
	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)				
NOVO NORDISK A/S-B	477	16,241	265,066	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	201	2,202	35,952	金融
ISS A/S	44	848	13,848	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	654	10,674	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	17	431	7,044	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52.5	2,987	48,751	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	29.5	2,596	42,366	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	58	1,769	28,870	素材
COLOPLAST-B	33.5	2,516	41,069	ヘルスケア
DSV A/S	53.6	3,322	54,217	資本財・サービス
DEMANT A/S	26.75	579	9,455	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.7	1,233	20,136	資本財・サービス
TRYG A/S	33	719	11,740	金融
PANDORA A/S	31.5	695	11,345	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	30.5	2,241	36,585	素材
GENMAB A/S	17	2,004	32,710	ヘルスケア
ORSTED A/S	52	2,947	48,100	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,159.5 17銘柄	43,991 717,936	<0.6%>
	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)				
NORSK HYDRO ASA	352	1,088	13,593	素材
DNB ASA	261.5	3,936	49,171	金融
ORKLA ASA	219.5	1,671	20,874	生活必需品
TELENOR ASA	213	4,026	50,294	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	270.23	4,592	57,361	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	49.6	2,016	25,182	素材
MOWI ASA	128.5	2,638	32,949	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	55.5	971	12,137	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	24	540	6,744	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	29	655	8,193	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 >	1,602.83 10銘柄	22,137 276,503	<0.2%>
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)				
ICA GRUPPEN AB	23	915	10,486	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	872.3	7,787	89,171	情報技術
VOLVO AB-B SHS	426	6,004	68,751	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	18	910	10,428	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES	105.5	1,663	19,043	資本財・サービス

銘柄	株数	2019年6月17日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ELECTROLUX AB-SER B	66.5	1,524	17,451	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	46	1,954	22,379	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	137	1,837	21,035	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	455.5	3,965	45,405	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	430.5	3,955	45,289	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	248	3,480	39,853	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	235.5	3,627	41,536	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS	91.5	1,530	17,522	資本財・サービス
SANDVIK AB	311.5	5,033	57,637	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	129.5	5,690	65,153	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	185.5	5,208	59,641	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	84.5	1,390	15,925	資本財・サービス
TELIA CO AB	770	3,177	36,376	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	88	1,760	20,162	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	103	2,633	30,155	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	282.5	5,729	65,598	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	22	750	8,594	金融
LUNDIN PETROLEUM AB	52.5	1,399	16,019	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	165.5	4,898	56,091	生活必需品
BOLIDEN AB	78	1,758	20,134	その他
EPIROC AB-A	179.5	1,633	18,707	資本財・サービス
EPIROC AB-B	97	855	9,792	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	114.5	994	11,390	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP	828	5,737	65,691	金融
KINNEVIK AB - B	65	1,573	18,018	金融
HEXAGON AB-B SHS	74	3,567	40,848	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	46	925	10,602	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,831.8 32銘柄	93,877	1,074,898 <1.0%>
<b>ユーロ (アイルランド)</b>	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	60	159	19,450	素材
AIB GROUP PLC	230	82	10,045	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	274.6	127	15,494	金融
KINGSPAN GROUP PLC	44	204	24,956	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	45.7	485	59,147	生活必需品
CRH PLC	227	643	78,456	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	22	145	17,674	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	903.3 7銘柄	1,848	225,225 <0.2%>
<b>ユーロ (オランダ)</b>	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.	64.98	228	27,906	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	253.26	928	113,165	ヘルスケア
NN GROUP NV	82.5	289	35,320	金融
UNILEVER NV-CVA	424	2,314	282,082	生活必需品
HEINEKEN NV	71	684	83,430	生活必需品
AEGON NV	486.44	204	24,863	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	328.83	676	82,453	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.	60.88	499	60,906	素材
KONINKLIJKE DSM NV	50	536	65,352	素材
WOLTERS KLUWER	78	501	61,160	資本財・サービス
ING GROEP NV	1,068.5	1,049	127,887	金融
KONINKLIJKE KPN NV	919.5	260	31,791	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	116.5	1,992	242,840	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	117	220	26,827	金融
ADYEN NV	3	210	25,600	情報技術
VOPAK	19	74	9,049	エネルギー
RANDSTAD NV	32	154	18,801	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	31.5	281	34,358	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	185.5	262	31,966	情報技術
AIRBUS SE	163	1,995	243,185	資本財・サービス
EXOR NV	28.8	170	20,778	金融
CNH INDUSTRIAL NV	272	229	27,944	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	298.5	353	43,071	一般消費財・サービス
FERRARI NV	33.45	454	55,441	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,188.14 24銘柄	14,574	1,776,183 <1.6%>
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	35.5	249	30,457	ヘルスケア
KBC GROUP NV	69	398	48,604	金融
COLRUYT SA	16	99	12,183	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	22	187	22,789	金融
SOLVAY SA	19.5	169	20,618	素材
UMICORE	58	156	19,021	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	208	1,567	191,080	生活必需品
AGEAS	49.4	217	26,501	金融
PROXIMUS	41	107	13,051	コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	14.5	71	8,683	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 >	532.9 10銘柄	3,224	392,991 <0.3%>

銘柄		2019年6月17日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>					
AROUNDTOWN SA		222	170	20,789	不動産
RTL GROUP		10	44	5,389	コミュニケーション・サービス
ARCELORMITTAL		188	273	33,386	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		3.2	115	14,039	ヘルスケア
SES		97	138	16,904	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA		133	143	17,505	エネルギー
国小計		653.2	886	108,014	
		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6銘柄	<0.1%>	
<b>ユーロ (フランス)</b>					
JCDECAUX SA		19	49	6,085	コミュニケーション・サービス
TOTAL SA		663.5	3,135	382,067	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		47.5	522	63,619	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		119.92	1,424	173,548	素材
KERING		21.3	1,036	126,274	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		154	1,155	140,872	資本財・サービス
BOUYGUES SA		60.5	190	23,181	資本財・サービス
BNP PARIBAS		316.5	1,293	157,604	金融
PEUGEOT SA		165.5	342	41,791	一般消費財・サービス
NATIXIS		253.5	97	11,915	金融
THALES SA		28.5	300	36,625	資本財・サービス
DANONE		172.5	1,250	152,455	生活必需品
CARREFOUR SA		158	270	32,946	生活必需品
SUEZ		99.25	124	15,210	公益事業
VIVENDI		290.91	712	86,789	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		70.7	1,753	213,681	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		137	455	55,539	資本財・サービス
LEGRAND SA		72.17	451	55,006	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		15.5	50	6,158	生活必需品
PERNOD RICARD SA		59.37	937	114,211	生活必需品
SOCIETE BIC SA		7	47	5,766	資本財・サービス
EURAZEO SE		12.54	77	9,421	金融
SOCIETE GENERALE SA		209	443	54,087	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		77.6	2,747	334,781	一般消費財・サービス
ACCOR SA		53.5	186	22,689	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		44.7	434	52,928	情報技術
VALEO SA		64	155	18,953	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		59.5	297	36,256	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		80	170	20,766	資本財・サービス
EIFFAGE		21.4	182	22,288	資本財・サービス
SODEXO SA		25	260	31,762	一般消費財・サービス
IPSEN		10	114	13,978	ヘルスケア
INGENICO GROUP		16	122	14,959	情報技術
AMUNDI SA		17	100	12,244	金融
TELEPERFORMANCE		16.5	286	34,968	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		22	149	18,242	コミュニケーション・サービス
FAURECIA		19	67	8,183	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		8	103	12,606	ヘルスケア
SEB SA		6.5	98	11,969	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		80	851	103,735	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		0.7	84	10,237	資本財・サービス
WORLDLINE SA		23.64	144	17,574	情報技術
AXA SA		532.5	1,203	146,729	金融
EDENRED		64	274	33,507	資本財・サービス
RENAULT SA		53.5	298	36,342	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		8.6	526	64,163	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		6.3	72	8,844	生活必需品
ATOS SE		26.6	190	23,171	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA		35.8	490	59,772	情報技術
WENDEL		7.8	91	11,159	金融
ORANGE		554	765	93,307	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		44.5	184	22,511	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		48.5	95	11,697	金融
SANOFI		309.75	2,353	286,818	ヘルスケア
VINCI SA		143	1,280	156,114	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		144.5	307	37,421	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		323	332	40,525	金融
BIOMERIEUX		11.5	86	10,483	ヘルスケア
ENGIE		499.73	647	78,898	公益事業
IMERYS SA		9	40	4,891	素材
EDF		170.5	200	24,477	公益事業
SAFRAN SA		90.7	1,114	135,848	資本財・サービス
ILIAD SA		7.4	75	9,153	コミュニケーション・サービス
ARKEMA		19.2	146	17,848	素材
ADP		8.1	124	15,152	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		47	76	9,359	コミュニケーション・サービス
SCOR SE		45	174	21,283	金融
GETLINK SE		124	171	20,884	資本財・サービス
BOLLORE		241	94	11,489	資本財・サービス
国小計		7,374.18	34,100	4,155,848	
		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	69銘柄	<3.7%>	

銘柄	株数	2019年6月17日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (ドイツ)</b>				
BAYER AG-REG	257.7	1,361	165,980	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	53	128	15,702	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	531.5	320	39,039	金融
COMMERZBANK AG	281.35	171	20,960	金融
VOLKSWAGEN AG	8.9	128	15,629	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	51.3	724	88,302	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	213	2,215	270,018	資本財・サービス
E.ON SE	615	611	74,462	公益事業
UNIPER SE	53.5	140	17,141	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	90.5	565	68,888	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	45	112	13,737	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	31.7	394	48,059	一般消費財・サービス
BASF SE	255.7	1,546	188,468	素材
ALLIANZ SE-REG	118.9	2,465	300,529	金融
THYSSENKRUPP AG	114.5	134	16,423	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	49	433	52,836	生活必需品
RWE AG	152.5	348	42,467	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	66.5	117	14,336	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	11.8	89	10,955	資本財・サービス
BRENTAG AG	43	181	22,135	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	116.5	537	65,494	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	105	12,805	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	7.1	75	9,223	資本財・サービス
SAP SE	273.42	3,104	378,334	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	41.2	912	111,266	金融
ZALANDO SE	35.5	134	16,349	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	41.5	285	34,796	素材
KION GROUP AG	18.5	97	11,832	資本財・サービス
WIRECARD AG	32.7	488	59,558	情報技術
COVESTRO AG	52	217	26,464	素材
INNOGY SE	37.3	154	18,783	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG	9.5	168	20,573	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	43	241	29,440	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	32	120	14,659	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	12.5	111	13,641	ヘルスケア
METRO AG	50	75	9,179	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG	15.5	42	5,168	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	40	146	17,846	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	14.5	143	17,512	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	28.9	309	37,668	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	19.5	67	8,284	素材
MERCK KGAA	35	321	39,156	ヘルスケア
ADIDAS AG	50.1	1,305	159,114	一般消費財・サービス
PUMA SE	23.6	128	15,660	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	28.5	235	28,689	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	928.5	1,428	174,147	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	58.7	391	47,715	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	253.5	1,202	146,499	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	315.5	454	55,329	情報技術
HANNOVER RUECK SE	17.3	242	29,559	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	273.5	748	91,261	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	53.9	677	82,569	金融
LANXESS AG	25	114	13,923	素材
MTU AERO ENGINES AG	14.3	284	34,628	資本財・サービス
AXEL SPRINGER SE	14	87	10,612	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	99.5	368	44,866	不動産
SYMRISE AG	36.7	323	39,484	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	263	65	7,932	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	15.5	82	10,049	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD	17.6	96	11,732	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	136.5	628	76,605	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,658.87 61銘柄	28,920 <3.1%>	3,524,498
<b>ユーロ (ポルトガル)</b>				
JERONIMO MARTINS	60	86	10,518	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	660	227	27,685	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	139.5	183	22,356	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	859.5 3銘柄	496 <0.1%>	60,560
<b>ユーロ (スペイン)</b>				
TELEFONICA SA	1,288.27	958	116,871	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	82.5	196	23,919	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,860.12	907	110,592	金融
IBERDROLA SA	1,649.34	1,477	180,060	公益事業
BANCO DE SABADELL SA	1,601.09	147	17,947	金融
BANKINTER SA	183	112	13,724	金融
REPSOL SA	392	560	68,315	エネルギー
GRIFOLS SA	85	205	25,079	ヘルスケア

銘柄	株数	2019年6月17日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
BANCO SANTANDER SA	4,462.5	1,764	215,063	金融
AMADEUS IT GROUP SA	123	837	102,081	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	98.5	250	30,538	公益事業
MAPFRE SA	306.5	80	9,850	金融
CAIXABANK SA	1,003	258	31,500	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	71.76	267	32,594	資本財・サービス
AENA SME SA	18.5	320	39,049	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	58	186	22,668	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	297.5	743	90,640	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	66.5	98	12,014	資本財・サービス
ENAGAS SA	59	147	17,983	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA	115	222	27,154	公益事業
FERROVIAL SA	134	296	36,155	資本財・サービス
BANKIA SA	301.05	64	7,873	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,256.13 22銘柄	10,106 <1.1%>	1,231,678
<b>ユーロ (イタリア)</b>	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	68.5	115	14,133	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	316.43	510	62,221	金融
MEDIOBANCA SPA	170.65	145	17,731	金融
UNICREDIT SPA	549.56	556	67,845	金融
TELECOM ITALIA SPA	3,139.82	143	17,529	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	1,719.5	76	9,272	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	4,102.37	753	91,861	金融
ATLANTIA SPA	134.57	315	38,408	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	135	125	15,248	金融
MONCLER SPA	47	164	20,076	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA	30.5	113	13,771	ヘルスケア
ENI SPA	700	976	118,954	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	162	141	17,294	生活必需品
PIRELLI & C SPA	110	58	7,094	一般消費財・サービス
LEONARDO SPA	109.75	118	14,418	資本財・サービス
ENEL SPA	2,289.34	1,389	169,354	公益事業
SNAM SPA	616	290	35,418	エネルギー
TERNA SPA	389	224	27,335	公益事業
FINECOBANK SPA	145	131	15,985	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,934.99 19銘柄	6,350 <0.7%>	773,957
<b>ユーロ (フィンランド)</b>	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	148.5	344	42,022	素材
NOKIA OYJ	1,600	701	85,523	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	120	154	18,799	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	155.5	146	17,847	素材
METSO OYJ	28	89	10,888	資本財・サービス
ELISA OYJ	41.5	174	21,292	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	122.5	497	60,597	金融
FORTUM OYJ	122.5	234	28,581	公益事業
KONE OYJ-B	94	470	57,393	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	30.5	81	9,876	一般消費財・サービス
NESTE OYJ	118.5	365	44,581	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	27.5	86	10,533	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,609 12銘柄	3,347 <0.4%>	407,938
<b>ユーロ (オーストリア)</b>	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	20	91	11,177	公益事業
OMV AG	35.5	149	18,209	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	83	266	32,439	金融
VOESTALPINE AG	28.5	68	8,391	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	34	72	8,887	金融
ANDRITZ AG	21	65	8,015	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	222 6銘柄	714 <0.1%>	87,122
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	54,192.21 239銘柄	104,570 <11.3%>	12,744,017
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	305,894.95 1,264銘柄	— <95.8%>	107,829,712

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17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	2019年6月17日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
<b>(アメリカ)</b>			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.767	783	85,175
SIMON PROPERTY GROUP INC	8.337	1,358	147,588
BOSTON PROPERTIES INC	4.25	574	62,436
VORNADO REALTY TRUST	4.647	307	33,427
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.05	690	75,065
EQUITY RESIDENTIAL	10.3	806	87,588
EQUINIX INC	2.238	1,141	124,002
AMERICAN TOWER CORP	12.15	2,566	278,869
HOST HOTELS & RESORTS INC	20.043	366	39,876
KIMCO REALTY CORP	11.1	207	22,590
INVITATION HOMES INC	11.1	303	32,939
VENTAS INC	9.6	640	69,639
WEYERHAEUSER CO	20.064	515	56,051
AGNC INVESTMENT CORP	14.1	238	25,861
CROWN CASTLE INTL CORP	11.2	1,493	162,237
IRON MOUNTAIN INC	7.41	235	25,548
VEREIT INC	26.9	256	27,855
SUN COMMUNITIES INC	2.4	309	33,672
PROLOGIS INC	17.062	1,364	148,242
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3.17	479	52,115
CAMDEN PROPERTY TRUST	2.6	276	29,991
DUKE REALTY CORP	9.4	298	32,429
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.8	538	58,517
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	266	28,933
WELLTOWER INC	10.65	876	95,216
HCP INC	13.5	433	47,117
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.95	198	21,563
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	353	38,397
MACERICH CO/THE	2.9	100	10,880
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2.4	297	32,345
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	37.7	343	37,359
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4.15	229	24,927
REALTY INCOME CORP	8.5	622	67,672
PUBLIC STORAGE	4.29	1,043	113,419
REGENCY CENTERS CORP	4.6	316	34,423
SL GREEN REALTY CORP	2.4	210	22,829
UDR INC	7.4	343	37,341
WP CAREY INC	4.3	367	39,948
DIGITAL REALTY TRUST INC	5.8	694	75,476
EXTRA SPACE STORAGE INC	3.5	378	41,096
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	337.728 40銘柄	22,829 <2.2% >
		千口	千カナダ・ドル
<b>(カナダ)</b>			
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2.1	71	5,786
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3.7	84	6,812
RIOCAN REAL ESTATE INVSTR	3.9	104	8,478
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.7 3銘柄	260 <0.0% >
		千口	千オーストラリア・ドル
<b>(オーストラリア)</b>			
LENDLEASE GROUP	14.9	193	14,475
TRANSURBAN GROUP	75.3	1,092	81,650
SYDNEY AIRPORT	30.3	234	17,525
APA GROUP	33.3	371	27,796
SCENTRE GROUP	153.922	578	43,249
DEXUS	30.75	419	31,344
GPT GROUP	51.16	315	23,589
MIRVAC GROUP	111.6	358	26,770
STOCKLAND	66	287	21,504
GOODMAN GROUP	47	688	51,455
VICINITY CENTRES	89.273	230	17,212
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	703.505 11銘柄	4,771 <0.3% >
		千口	千香港・ドル
<b>(香港)</b>			
LINK REIT	59	5,655	78,436
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75	585	8,113
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	107	1,341	18,610
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	241 3銘柄	7,581 <0.1% >



銘柄		2019年6月17日現在		
		□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千シンガポール・ドル	千円
<b>(シンガポール)</b>				
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		70.1	144	11,445
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		69.5	207	16,415
CAPITALAND MALL TRUST		69.7	181	14,363
SUNTEC REIT		63	119	9,437
シンガポール・ドル通貨計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	272.3 4銘柄	651 <0.0%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円
<b>(イギリス)</b>				
LAND SECURITIES GROUP PLC		19.662	165	22,628
SEGRO PLC		30.55	219	30,037
BRITISH LAND CO PLC		25.55	137	18,839
イギリス・ポンド通貨計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	75.762 3銘柄	522 <0.1%>
		千口	千ユーロ	千円
<b>ユーロ (フランス)</b>				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3.78	513	62,581
ICADE		0.95	76	9,262
GECINA SA		1.25	167	20,413
KLEPIERRE		5.65	167	20,402
COVIVIO		1.27	120	14,695
ユーロ通貨計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	12.9 5銘柄	1,045 <0.1%>
ファンド合計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,652.895 69銘柄	— <2.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17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		2019年6月17日現在	
		買建額	売建額
外国	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 1,491	百万円 —

(注1) 外貨建の評価額は、2019年6月17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なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式(預託証券を含みます。)
株式組入制限	無制限

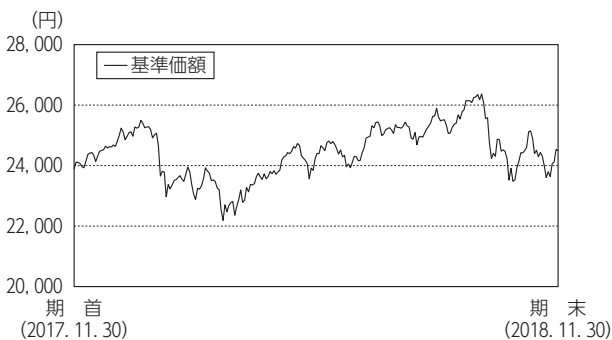
## 大和投資信託

Daiva 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 組入比率	株 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%	(円ベース)	%	%	%	%
(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、米国のムニヒ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も、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

#### ◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に、S&P500先物取引も一部利用し、株式組入比率(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も、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	1円 ( 1)
(先物・オプション)	( 0)
(投資信託証券)	( 0)
有価証券取引税 (株式)	2 ( 2)
(投資信託証券)	( 0)
その他費用 (保管費用)	13 ( 11)
(その他)	( 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 国	アメリカ	百株 10,431.8 ( 477.37)	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	百株 1,784.2 (△ 23.36)	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	百株 2,221 ( 221.81)	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	百株 4,423 ( 239.17)	千香港・ドル 14,250 ( ー)	百株 1,630	千香港・ドル 1,078
	シンガポール	百株 1,199 (△ 630)	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	百株 626 ( ー)	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	百株 12,225.8 (△18,461.58)	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	百株 135.5 (△ 9)	千イスラエル・シェケル 384 (△ 270)	百株 ー	千イスラエル・シェケル ー
	スイス	百株 678.9 ( 31.27)	千スイス・フラン 4,016 (△ 145)	百株 47.5	千スイス・フラン 197
	デンマーク	百株 117.9 ( ー)	千デンマーク・クローネ 4,436 ( ー)	百株 203.5	千デンマーク・クローネ 1,246
	ノルウェー	百株 230 ( ー)	千ノルウェー・クローネ 3,758 ( ー)	百株 24	千ノルウェー・クローネ 472
	スウェーデン	百株 944 ( 657.88)	千スウェーデン・クローネ 11,440 ( ー)	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)	百株 383.7 ( ー)	千ユーロ 528 (△ 960)	百株 ー	千ユーロ ー
	ユーロ (オランダ)	百株 585.9 ( ー)	千ユーロ 1,713 ( ー)	百株 204.5	千ユーロ 289
	ユーロ (ベルギー)	百株 66.5 ( ー)	千ユーロ 435 ( ー)	百株 2.1	千ユーロ 18
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 49.2 ( ー)	千ユーロ 118 ( ー)	百株 7	千ユーロ 19
	ユーロ (フランス)	百株 1,052.2 ( 0.49)	千ユーロ 4,759 (△ 30)	百株 119.9	千ユーロ 379
	ユーロ (ドイツ)	百株 997.2 ( 157.56)	千ユーロ 5,050 (△ 98)	百株 268	千ユーロ 328

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユーロ (ポルトガル)	百株 165 ( ー)	千ユーロ 53 ( ー)	百株 ー	千ユーロ ー
	ユーロ (スペイン)	百株 1,899 ( 8,011.2)	千ユーロ 1,443 ( 106)	百株 8,442.2	千ユーロ 558
	ユーロ (イタリア)	百株 1,893 ( 61.9)	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)	百株 177.5 ( 72)	千ユーロ 356 ( ー)	百株 4.5	千ユーロ 19
	ユーロ (オーストリア)	百株 12.5 ( ー)	千ユーロ 56 (△ 8)	百株 ー	千ユーロ ー
	ユーロ (その他)	百株 20 ( ー)	千ユーロ 35 ( ー)	百株 299.19	千ユーロ 608
国	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 7,301.7 ( 8,303.15)	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 ( ー)	千アメリカ・ドル 232 ( ー)
	カナダ	千口 0.7 ( ー)	千カナダ・ドル 14 ( ー)	千口 ー	千カナダ・ドル ー
	オーストラリア	千口 102.7 ( ー)	千オーストラリア・ドル 625 (△ 14)	千口 54.196 ( ー)	千オーストラリア・ドル 458 ( ー)
	香港	千口 18.5 ( ー)	千香港・ドル 590 ( ー)	千口 1.5 ( ー)	千香港・ドル 97 ( ー)
	シンガポール	千口 32.1 ( ー)	千シンガポール・ドル 68 (△ 1)	千口 ー	千シンガポール・ドル ー
	イギリス	千口 5.9 ( ー)	千イギリス・ポンド 44 ( ー)	千口 21.1 ( ー)	千イギリス・ポンド 41 ( ー)
	ユーロ (フランス)	千口 2.11 ( ー)	千ユーロ 304 ( ー)	千口 0.18 ( ー)	千ユーロ 23 ( 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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	18,905	18,303	ー	ー

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

銘柄	当 期			期 末		
	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.44	253,662	176,154	4.548	61,865	13,602
MICROSOFT CORP (アメリカ)	22.55	244,365	10,836	24.719	57,927	2,343
APPLE INC (アメリカ)	10.65	218,788	20,543	2.3	54,222	23,575
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	8.3	155,087	18,685	17.4	40,289	2,315
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.08	131,929	122,157	122.525	37,351	304
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	8.7	128,295	14,746	43.6	30,503	699
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	13.6	120,500	8,860	2.4	28,765	11,985
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	5.25	118,332	22,539	3.165	27,671	8,742
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.95	116,271	122,391	6.65	26,130	3,929
CHEVRON CORP (アメリカ)	6.95	91,877	13,219	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	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	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
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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
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 CORP	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
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
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

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	
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	ヘルスクエア
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	ヘルスクエア
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	ヘルスクエア
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	ヘルスクエア
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
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	ヘルスクエア
ABBVIE INC	364.29	394.29	3,545	402,258	ヘルスクエア
HOLOGIC INC	65.5	71	315	35,778	ヘルスクエア
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	ヘルスクエア
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

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		
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
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
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



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	
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
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

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		
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
VIDIA 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
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
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

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	
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
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

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	千アメリカ・ドル	千円		
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	70,298.77	79,569.2	613,411	69,603,768	
	銘柄数 < 比率 >	600銘柄	592銘柄		<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	
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 LIFECO 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	
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	

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	
GILDAN ACTIVEWEAR 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
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

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	千オーストラリア・ドル	千円	
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 銘柄数 < 比率 >	16,427.31 58銘柄	18,651.08 57銘柄	29,339 <2.3%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
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%>	
(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	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
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

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	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	百株 630	百株 —	千シンガポール・ドル —	千円 —	その他
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 11,244.2 銘柄数 < 比率 >	株数 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 1,439.89 銘柄数 < 比率 >	株数 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
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

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,381	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
ASHTREAD 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
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
INTERTEK 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 <6.3%>	6,830,372
(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 HAPOLIM 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 <0.1%>	111,304
(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
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



銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
銘柄	株数	株数	千スイス・フラン	千円		
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 銘柄数 < 比率 >	3,888.27 36銘柄	4,550.94 38銘柄	30,338	3,455,503 <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	
GENMAB A/S	13	17	1,708	29,574	ヘルスケア	
ORSTED A/S	44.5	50.5	2,190	37,920	公益事業	
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,218.6 18銘柄	1,133 17銘柄	39,180	678,209 <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 10銘柄	1,590.83 10銘柄	22,195	294,752 <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	

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	千スウェーデン・クローネ	千円		
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	
HEXAGON AB-B SHS	62	69	3,169	39,654	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	40	46	851	10,657	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%>	
<b>ユーロ (アイルランド)</b>	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%>	
<b>ユーロ (オランダ)</b>	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%>	
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	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	
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	392,948 <0.4%>	
<b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>	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	107,372 <0.1%>	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
<b>ユーロ (フランス)</b>						
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	
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%>	
<b>ユーロ (ドイツ)</b>						
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	

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		
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	
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	
BRENNTAG 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 HLDG-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 -PREF	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	22	108	13,989	素材	
MTU AERO ENGINES AG	—	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 銘柄数 < 比率 >	5,532.67 57銘柄	6,419.43 63銘柄	27,233	3,518,304 <3.3%>	
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	

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	
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 <1.1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円
ユーロ (イタリア)					
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
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 <0.7%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円
ユーロ (フィンランド)					
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 <0.4%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円
ユーロ (オーストリア)					
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 <0.1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円
ユーロ (その他)					
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 <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	— <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 □ 数	当 □ 数	期末 評価額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
<b>(アメリカ)</b>	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
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 <2.0%>
<b>(カナダ)</b>	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
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 <0.0%>
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE 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%>
<b>(香港)</b>	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%>

銘柄	期首 □数	当期 □数	期末 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
GECINA 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	— 2,814,132 <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
<b>(A) 資産</b>	<b>108,668,834,711円</b>
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>(B) 負債</b>	<b>975,308,842</b>
未払金	941,976,460
未払解約金	33,327,900
その他未払費用	4,482
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>107,693,525,869</b>
元本	43,964,024,902
次期繰越損益金	63,729,500,967
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>43,964,024,902口</b>
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3 0 V A（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5 0 V A（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3 0 V A（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5 0 V A（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3 0 569,101,264円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 839,595,806円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 676,868,528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1 5 V A76,173円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A156,042円、ダイワ世界分散バランスファンド2 5 V A1,204,032円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A2,140,945円、ダイワ世界分散バランスファンド4 0 V A237,257,604円、ダイワ世界分散バランスファンド6 0 V A353,114,328円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A3,137,819,193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）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2 5 19,463,084円、ダイワライフスタイル5 0 70,173,613円、ダイワライフスタイル7 5 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
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>2,238,368,228円</b>
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>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>288,319,317</b>
売買益	8,625,906,440
売買損	△ 8,337,587,123
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>66,002,151</b>
取引益	346,066,933
取引損	△ 280,064,782
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 52,956,222</b>
<b>(E) 当期損益金（A+B+C+D）</b>	<b>2,539,733,474</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>55,193,221,227</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 4,705,704,655</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>10,702,250,921</b>
<b>(I) 合計（E+F+G+H）</b>	<b>63,729,500,967</b>
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。



# ダイワファンドラップ 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)

★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	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。	

## 運用報告書(全体版) 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17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)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<2730>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率				
1 期末 (2017年 6 月15日)	円 12,158	円 0	% 21.6	% 94.7	% 1.1	% 3.0	百万円 826
2 期末 (2018年 6 月15日)	円 13,778	円 0	% 13.3	% 93.2	% 1.3	% 4.3	1,697
3 期末 (2019年 6 月17日)	円 13,793	円 0	% 0.1	% 93.8	% 1.3	% 4.0	1,747

(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まず。

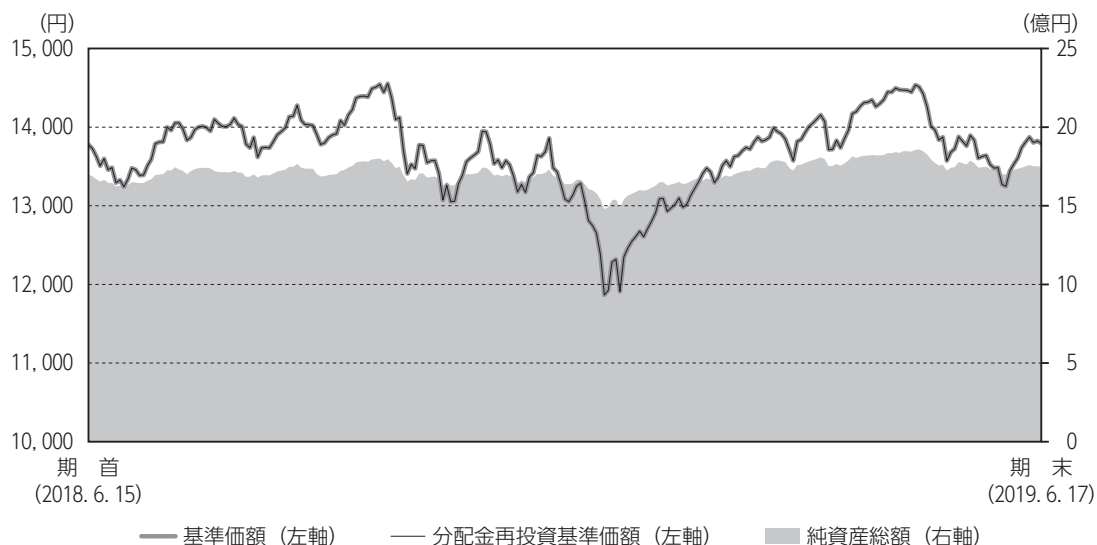
(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(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：13,778円

期末：13,793円（分配金0円）

騰落率：0.1%（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	1.0%	79.6%
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	△1.8%	19.6%

#### ■ 基準価額の変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率			
(期首)2018年6月15日	13,778	—	93.2	1.3	4.3
6月末	13,333	△ 3.2	92.5	1.8	4.9
7月末	13,950	1.2	92.2	1.4	5.4
8月末	14,089	2.3	94.0	1.6	3.3
9月末	14,492	5.2	93.8	1.3	3.9
10月末	13,281	△ 3.6	92.7	1.7	4.6
11月末	13,628	△ 1.1	92.1	2.0	5.0
12月末	12,319	△ 10.6	92.5	1.1	5.4
2019年1月末	13,136	△ 4.7	92.7	1.1	5.2
2月末	13,837	0.4	92.8	1.0	5.2
3月末	13,853	0.5	95.1	1.5	2.6
4月末	14,427	4.7	95.6	0.9	2.7
5月末	13,485	△ 2.1	94.2	1.1	3.7
(期末)2019年6月17日	13,793	0.1	93.8	1.3	4.0

(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

(2018.6.16～2019.6.17)

### ■先進国株式市況

先進国株式市況は上昇しました。

米国・欧州を中心とした先進国株式市況は、当作成期首より、米国の通商政策をめぐる懸念が再燃したことや新興国株式市場の軟調などが逆風となり、下落基調で始まりました。2018年9月以降は、米中貿易摩擦への懸念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。2019年1月以降は、米中貿易摩擦への懸念が和らいだことや米国の金融引き締め観測の後退などが支援材料となり、堅調に推移しました。当作成期末にかけては、順調に進展しているとみられていた米中貿易協議への懸念が高まったことを受けて下落した場面もありましたが、米国の利下げ観測から反発しました。

### ■先進国為替相場

先進国為替相場は、当作成期を通してみると円高が進みました。

当作成期首より、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。一方、米ドルは利上げ観測の高まりなどから上昇しました。2018年9月中旬以降は、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。12月以降は、株価や原油価格の急落を受けて市場のリスク回避姿勢が強まり、円高が進行しました。2019年1月に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり、市場のリスク選好姿勢が回復したことなどから、米ドルを中心に上昇に転じました。4月以降は、米中の貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。

### ■新興国株式市況

新興国株式市況は下落しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、米国金利の上昇による新興国からの資金流出と米中貿易摩擦の激化により下落基調となりました。2018年7月に入ると、米国を中心とした貿易摩擦懸念の後退などからリスク選好姿勢が強まる局面もあったものの、米中間でくすぶる貿易問題をにらんだ一進一退の動きとなりました。しかし10月からは、米中の貿易摩擦が再燃したことによる景気悪化懸念が強まり、中国大手通信機器メーカーの幹部拘束による米中対立の拡大から、年末までは売りが先行する展開となりました。2019年に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) の利上げ終了見通しが強まったことで新興国への資金流入が進んだことや、米中貿易協議に対する期待の高まりから急反発しました。その後しばらくは落ち着いた動きとなりましたが、5月以降は、予想に反して米中貿易摩擦が急激に激化したことで世界的な景気悪化懸念が広がり、下落して当作成期末を迎えました。

国別では、米中貿易摩擦と景気悪化懸念が悪材料となった中国株式市場は下落しました。対米貿易問題や移民流入問題が嫌気されたメキシコ株式市場も軟調でした。一方、個人消費が底堅く、大手エネルギー会社の増配が好感されたロシア株式市場や、新政権の経済政策に期待が高まったブラジル株式市場などは堅調でした。

#### ■新興国為替相場

新興国為替相場は、当作成期を通してみると円高が進みました。

新興国為替相場は、米中の対立激化に伴うリスク回避の動きを受けて新興国からの資金流出が進み、新興国通貨全体としては対米ドルでは下落しました。通貨別では、中央銀行の独立性に対する懸念と経済政策に対する不信感が強まったトルコ・リラは急落しました。経常赤字の拡大が続き、停電や労働組合の抗議運動も悪材料となった南アフリカ・ランドも売られました。一方、2018年のNAFTA（北米自由貿易協定）再交渉問題により売られ過ぎたメキシコ・ペソは買い戻されました。

なお、当作成期を通じては、リスク回避の動きもあって円が対米ドルで上昇したことから、新興国通貨は対米ドル同様に対円でも新興国通貨安となりました。

### 前作成期末における「今後の運用方針」

#### ■当ファンド

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

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

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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

#### ■当ファンド

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

#### ■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率（リート、株価指数先物を含む。）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 (DR (預託証券)、ETF (上場投資信託証券)、株価指数先物を含む。以下同じ。) は、FTSE RAFI エマージング インデックスのリバランス時や大量設定時を除き、当作成期を通じて原則として98%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、DR等を組み入れることでベンチマークの動きに連動させ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、新興国株式の実質的な組入比率を引き上げるため、MSCI エマージング先物取引をリバランス時以外でも組み入れています。

## 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	
	2018年6月16日 ～2019年6月17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)		3,793

- (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

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

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

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、株式実質組入比率の維持を目的に新興国株式市場を対象とした株価指数先物取引も利用します。

## 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2018.6.16~2019.6.17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	62円	0.451%	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13,670円です。
(投信会社)	(44)	(0.320)	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)	(15)	(0.109)	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)	(2)	(0.011)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.003)	
有価証券取引税	2	0.013	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)	(0.013)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	10	0.073	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)	(0.059)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(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)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	76	0.553	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデック ス・マザーファンド	61,940	96,380	46,082	72,120
外国株式インデックス マザーファンド	91,941	225,020	85,159	211,040

(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

(2018年6月16日から2019年6月17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	3,210,006千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,401,842千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.59
	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	13,874,481千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	102,773,565千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.13

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■利害関係人との取引状況等

当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
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	207,947	223,805	342,869
外国株式インデックスマザーファンド	548,554	555,335	1,390,838

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	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	342,869	19.6
外国株式インデックスマザーファンド	1,390,838	79.3
コール・ローン等、その他	19,440	1.1
投資信託財産総額	1,753,148	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1香港・ドル=13.87円、1シンガポール・ドル=79.26円、1ニュージーランド・ドル=70.62円、1台湾・ドル=3.45円、1イギリス・ポンド=136.75円、1イスラエル・シェケル=30.11円、1スイス・フラン=108.77円、1トルコ・リラ=18.39円、1デンマーク・クローネ=16.32円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローネ=11.45円、1メキシコ・ペソ=5.67円、100チリ・ペソ=15.52円、1インド・ルピー=1.57円、100インドネシア・ルピア=0.76円、1ブラジル・レアル=27.88円、1マレーシア・リンギット=26.03円、1南アフリカ・ランド=7.35円、1タイ・バーツ=3.48円、1ユーロ=121.87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(6,961,636千円)の投資信託財産総額(7,003,178千円)に対する比率は、99.4%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(112,279,631千円)の投資信託財産総額(113,235,106千円)に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,753,148,490円
コール・ローン等	17,640,172
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)	342,869,702
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,390,838,616
未収入金	1,800,000
(B) 負債	5,569,467
未払解約金	1,680,882
未払信託報酬	3,841,894
その他未払費用	46,691
(C) 純資産総額(A-B)	1,747,579,023
元本	1,267,003,630
次期繰越損益金	480,575,393
(D) 受益権総口数	1,267,003,630口
1万口当り基準価額(C/D)	13,793円

\* 期首における元本額は1,232,384,733円、当作成期間中における追加設定元本額は339,152,791円、同解約元本額は304,533,894円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,793円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 11,168円
受取利息	1,322
支払利息	△ 12,490
(B) 有価証券売買損益	11,450,722
売買益	25,776,087
売買損	△ 14,325,365
(C) 信託報酬等	△ 7,803,669
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,635,885
(E) 前期繰越損益金	127,846,445
(F) 追加信託差損益金	349,093,063
(配当等相当額)	( 86,118,978)
(売買損益相当額)	( 262,974,085)
(G) 合計(D+E+F)	480,575,393
次期繰越損益金(G)	480,575,393
追加信託差損益金	349,093,063
(配当等相当額)	( 86,118,978)
(売買損益相当額)	( 262,974,085)
分配準備積立金	131,493,498
繰越損益金	△ 11,168

(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	3,641,583
(c) 収益調整金	349,093,063
(d) 分配準備積立金	127,851,915
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	480,586,561
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	480,586,561
(h) 受益権総口数	1,267,003,630口

★「外国株式インデックスマザーファンド」の第19期にかかると運用状況については97~119ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド(ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし))が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日(2018年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2019年6月17日)現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。78~96ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「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（2019年6月17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127～133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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,223	120,776	98	LENOVO GROUP LTD (香港)	428	41,580	97
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	1,094	91,600	83	GAZPROM PJSC-SPON ADR (ロシア)	78.05	40,243	515
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	99	87,821	887	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	82	20,700	252
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	1,208	62,394	51	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN (ポーランド)	6.19	18,300	2,956
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島)	2.6	51,915	19,967	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	22.3	17,776	797
SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR (ロシア)	35.86	50,578	1,410	CJA ENERGETICA MINAS GER-PRF (ブラジル)	39.3	16,388	417
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	450	44,144	98	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	17.5	15,359	877
VALE SA (ブラジル)	29.4	42,337	1,440	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE (ポーランド)	12.26	14,875	1,213
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	7.8	39,718	5,092	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT (台湾)	64.964	14,633	225
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	30	35,267	1,175	CNOOC LTD (香港)	70	13,972	199

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	755	1,738,261	2,302	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	773	1,832,185	2,370
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI (トルコ)	171.87	5,788	33				
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	30.3	5,755	189				
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	29.1	4,598	158				
REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	54.02	4,057	75				

(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、2019年6月17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（4,567,104千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	柄	2019年6月17日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR PREF		164	105	11,447	エネルギー
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		34	537	58,409	一般消費財・サービス
BAIDU INC - SPON ADR		20	226	24,574	コミュニケーション・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR		88	67	7,353	一般消費財・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR		264.5	225	24,515	コミュニケーション・サービス
JD.COM INC-ADR		79	213	23,220	一般消費財・サービス
NETEASE INC-ADR		5	132	14,448	コミュニケーション・サービス
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR		36	120	13,092	一般消費財・サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S		893.06	112	12,227	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR		18.3	51	5,627	素材
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR		39.5	282	30,671	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR		155.3	59	6,510	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR		104.9	238	25,931	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		187	257	27,929	生活必需品
RUSHYDRO PJSC-ADR		606.1	53	5,808	公益事業
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR		704.5	1,070	116,319	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		9.3	188	20,534	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR		158.8	1,281	139,215	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR		462.7	291	31,724	エネルギー
GAZPROM PJSC-SPON ADR		1,879.6	1,347	146,438	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S		61.8	106	11,617	素材
TATNEFT PJSC - PREF		45.4	44	4,803	エネルギー
ALROSA PJSC		391.8	51	5,634	素材
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ		328.09	45	4,951	金融
AEROFLOT PJSC		407	61	6,717	資本財・サービス
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	7,143.65	7,175	779,721	
	銘柄数 < 比率 >	25銘柄		< 11.1% >	



銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千香港・ドル	千円		
(香港)				
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	950	938	13,018	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,650	1,034	14,349	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	240	313	4,347	資本財・サービス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	160	324	4,504	情報技術
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	450	547	7,589	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	410	300	4,162	資本財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	140	487	6,767	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	600	594	8,247	素材
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	12,978	6,605	91,622	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	100	385	5,346	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	760	458	6,356	一般消費財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	560	336	4,668	資本財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	135	350	4,859	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	610	604	8,384	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	126	4,158	57,671	コミュニケーション・サービス
CHINA TELECOM CORP LTD-H	4,580	1,777	24,647	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H	420	306	4,252	資本財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	2,100	1,774	24,612	コミュニケーション・サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	410	945	13,107	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	1,500	694	9,632	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	600	684	9,487	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	6,860	2,929	40,628	エネルギー
CNOOC LTD	3,960	4,886	67,777	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	640	312	4,331	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	1,880	917	12,724	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	170	793	11,011	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	840	420	5,825	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	30,910	19,566	271,380	金融
CHINA MOBILE LTD	1,305	8,913	123,625	コミュニケーション・サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	330	641	8,897	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	3,420	1,480	20,539	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	306	267	3,713	金融
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	2,790	371	5,146	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	100	572	7,940	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,560	683	9,477	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,120	1,814	25,165	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	220	251	3,490	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	276	753	10,450	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	540	1,787	24,791	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	190	380	5,270	一般消費財・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	580	391	5,430	エネルギー
BYD CO LTD-H	80	362	5,032	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	10,080	3,235	44,878	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	151	521	7,236	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,820	546	7,573	金融
CITIC LTD	1,220	1,300	18,038	資本財・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,150	378	5,248	金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	24,940	14,315	198,556	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H	3,860	741	10,279	コミュニケーション・サービス
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	740	328	4,557	素材
GUANGDONG INVESTMENT LTD	300	486	6,740	公益事業
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	780	2,164	30,021	不動産
CRRC CORP LTD - H	640	426	5,920	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,670	1,185	16,445	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,850	412	5,722	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	635	5,537	76,800	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	210	772	10,718	不動産
BAIC MOTOR CORP LTD-H	680	309	4,291	一般消費財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	2,670.8	1,509	20,929	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,240	1,421	19,709	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	80	409	5,675	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	253	747	10,369	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	920	303	4,210	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	380	266	3,699	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	40	389	5,395	一般消費財・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,020	1,670	23,170	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,000	551	7,642	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	410	533	7,392	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,880	522	7,249	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	478	1,369	18,994	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	244	379	5,259	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,240	2,232	30,957	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	74	548	7,605	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	380	235	3,273	素材
KUNLUN ENERGY CO LTD	680	454	6,300	エネルギー
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	508	725	10,061	不動産
CHINA OILFIELD SERVICES-H	440	308	4,278	エネルギー
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,140	334	4,632	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	460	388	5,391	資本財・サービス
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,940	1,233	17,113	素材

銘柄	2019年6月17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		
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,961	1,853	25,709	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	380	794	11,015	不動産	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	520	520	7,212	不動産	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	4,650	204	2,837	情報技術	
CHINA MERCHANTS BANK-H	765	2,975	41,275	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	30,130	9,641	133,728	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	305	438	6,083	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,140	397	5,518	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	696	560	7,780	金融	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	670	282	3,912	金融	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	290	871	12,087	不動産	
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	200,266.8 91銘柄	139,855 <27.7%>		
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円		
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	477	70	5,557	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 >	477 1銘柄	70 <0.1%>		
(台湾)	百株	千台湾・ドル	千円		
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	160	1,259	4,344	情報技術	
TAIWAN CEMENT	946	4,157	14,343	素材	
ASIA CEMENT CORP	550	2,549	8,794	素材	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	661.12	5,328	18,383	生活必需品	
FORMOSA PLASTICS CORP	576	6,451	22,256	素材	
NAN YA PLASTICS CORP	481.4	3,774	13,020	素材	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	503.9	5,568	19,209	素材	
WALSIN LIHWA CORP	930	1,478	5,101	資本財・サービス	
CHINA STEEL CORP	1,306.86	3,201	11,046	素材	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	656.16	2,959	10,209	情報技術	
DELTA ELECTRONICS INC	340	5,032	17,360	情報技術	
ACER INC	930	1,790	6,176	情報技術	
INVENTEC CORP	670	1,591	5,489	情報技術	
TATUNG CO LTD	550	1,144	3,946	一般消費財・サービス	
QUANTA COMPUTER INC	590	3,481	12,009	情報技術	
AU OPTRONICS CORP	2,720	2,499	8,623	情報技術	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	684	7,695	26,547	コミュニケーション・サービス	
MEDIATEK INC	310.03	9,517	32,836	情報技術	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	170	3,697	12,756	情報技術	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	611.87	1,477	5,097	金融	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,134.11	4,939	17,039	金融	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,456.93	6,017	20,759	金融	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,720	1,594	5,500	金融	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,363.34	3,531	12,182	金融	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,698.28	3,031	10,458	金融	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,559.93	4,781	16,495	金融	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,535.75	2,173	7,497	金融	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,556.77	3,154	10,884	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,420.28	5,167	17,827	金融	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	962.1	2,135	7,368	金融	
LARGAN PRECISION CO LTD	10	3,630	12,523	情報技術	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	100	1,640	5,658	情報技術	
TAIWAN MOBILE CO LTD	240	2,892	9,977	コミュニケーション・サービス	
WISTRON CORP	621.1	1,475	5,089	情報技術	
INNOLUX CORP	2,190	1,592	5,492	情報技術	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	230	1,794	6,189	コミュニケーション・サービス	
PEGATRON CORP	470	2,444	8,431	情報技術	
CHALEASE HOLDING CO LTD	142.2	1,734	5,985	金融	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	618	1,263	4,360	金融	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	214	1,583	5,463	情報技術	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	220	2,530	8,728	エネルギー	
POU CHEN	374.4	1,389	4,792	一般消費財・サービス	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,590	61,124	210,877	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,189.02	16,439	56,716	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	80	2,400	8,280	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	107.6	2,329	8,036	情報技術	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	750	2,452	8,461	資本財・サービス	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	4,380	6,000	20,702	情報技術	
台湾・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	47,281.15 48銘柄	225,894 <11.1%>		
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円		
TURKIYE GARANTI BANKASI	945.5	743	13,666	金融	
AKBANK T. A. S.	1,226.92	743	13,673	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	995.1	506	9,314	金融	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	439.5	544	10,022	コミュニケーション・サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	44.1	518	9,529	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	507.91	374	6,893	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	631.8	492	9,051	金融	

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE HALK BANKASI	722	371	6,837	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	1,075.6	226	4,173	金融
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	795.1	284	5,234	金融
KOC HOLDING AS	361.15	591	10,878	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	356.2	451	8,306	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	34.4	271	4,994	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,135.28 13銘柄	6,121 <1.6%>	112,576
	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
(メキシコ)				
BANCO SANTANDER MEXICO SA IN	621	1,754	9,950	金融
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	108	1,332	7,557	生活必需品
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	7,641	10,643	60,350	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	552	1,903	10,794	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO	7,073.19	5,594	31,723	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	309	5,806	32,924	生活必需品
MEXICHEM SAB DE CV-*	296.23	1,216	6,896	素材
ALFA S. A. B. -A	716	1,328	7,534	資本財・サービス
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	735	3,742	21,220	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	804	4,353	24,685	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	481	5,108	28,963	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	19,336.42 11銘柄	42,786 <3.5%>	242,601
	百株	千チリ・ペソ	千円	
(チリ)				
ENEL CHILE SA	4,877.97	31,511	4,890	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA	70	44,149	6,851	資本財・サービス
CENCOSUD SA	414.5	56,993	8,845	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE	9,830.9	50,619	7,856	金融
ENEL AMERICAS SA	5,285	61,559	9,554	公益事業
EMPRESAS CMPC SA	168.8	31,363	4,867	素材
S. A. C. I. FALABELLA	86.4	37,711	5,852	一般消費財・サービス
EMPRESAS COPEC SA	46.3	33,752	5,238	エネルギー
BANCO DE CHILE	3,966.92	39,669	6,156	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	24,746.79 9銘柄	387,330 <0.9%>	60,113
	百株	千インド・ルピー	千円	
(インド)				
TATA STEEL LTD	121.5	6,096	9,572	素材
AXIS BANK LTD	184.6	14,790	23,220	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8.7	5,870	9,216	一般消費財・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD	24.9	4,539	7,126	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	456.1	13,977	21,944	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	527.8	18,145	28,488	金融
NTPC LTD	648.4	8,607	13,513	公益事業
POWER FINANCE CORPORATION	305.8	4,054	6,366	金融
JSW STEEL LTD	222.7	6,040	9,483	素材
INDIAN OIL CORP LTD	1,082.8	17,303	27,165	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	440.45	17,023	26,726	エネルギー
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	237.9	1,407	2,209	公益事業
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	30.5	3,309	5,195	金融
TECH MAHINDRA LTD	42.2	3,123	4,904	情報技術
YES BANK LTD	235.2	2,705	4,248	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR	318.2	2,564	4,026	一般消費財・サービス
REC LTD	331.1	5,186	8,143	金融
COAL INDIA LTD	375.7	9,585	15,049	エネルギー
BHARTI INFRATEL LTD	114.4	3,146	4,940	コミュニケーション・サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	79	5,310	8,337	金融
GAIL INDIA LTD	104.53	3,224	5,062	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	374.5	7,424	11,656	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	81.2	7,299	11,460	素材
WIPRO LTD	136.53	4,079	6,404	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	61.56	13,878	21,789	情報技術
INFOSYS LTD	362.4	26,833	42,129	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	41.82	6,382	10,021	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	845.2	13,878	21,788	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	124.7	27,257	42,794	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	318.6	41,977	65,904	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	741.75	12,557	19,715	エネルギー
ITC LTD	236.4	6,573	10,319	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	98.9	6,302	9,894	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	15.3	4,085	6,414	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	386.22	13,645	21,422	コミュニケーション・サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	108.4	4,255	6,680	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	58.1	6,315	9,915	情報技術
VEDANTA LTD	860.5	14,589	22,905	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,744.56 38銘柄	373,351 <8.4%>	586,161

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)				
	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
UNITED TRACTORS TBK PT	284	763,960	5,806	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,084	2,289,870	17,403	一般消費財・サービス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	470	538,150	4,089	素材
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	770	542,850	4,125	生活必需品
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	7,956	3,174,444	24,125	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,252	1,064,200	8,087	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	515	1,493,500	11,350	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,977	2,329,502	17,704	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	3,015	590,940	4,491	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	6,605	2,793,915	21,233	金融
ADARO ENERGY TBK PT	4,729	584,031	4,438	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 >	31,657 11銘柄	16,165,363 <1.8%>	122,856
(ブラジル)				
	百株	千ブラジル・リアル	千円	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	12	54	1,530	公益事業
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	17	159	4,436	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	46	215	6,002	金融
CIA DE SANEAMENTO DO PA-UNIT	16	123	3,434	公益事業
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	139	342	9,548	一般消費財・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	851	2,302	64,202	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF	781.6	2,823	78,730	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	1,073.36	3,648	101,716	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	228	382	10,660	素材
VALE SA	801.9	4,121	114,914	素材
GERDAU SA-PREF	332	476	13,282	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	641	1,935	53,952	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	390.97	568	15,838	公益事業
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	375.41	449	12,538	金融
BRASKEM SA-PREF A	50	172	4,816	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	48	173	4,841	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	376	1,899	52,959	金融
COSAN SA	40	189	5,272	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	68	240	6,692	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	58	278	7,776	公益事業
EMBRAER SA	223	416	11,607	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	681	460	12,834	素材
CCR SA	242	338	9,445	資本財・サービス
BRF SA	241	701	19,552	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	76	354	9,882	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	77	206	5,753	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA	200.26	221	6,163	コミュニケーション・サービス
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	117	588	16,394	コミュニケーション・サービス
LOJAS RENNEN S. A.	50.05	229	6,396	一般消費財・サービス
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	85	136	3,810	一般消費財・サービス
JBS SA	490	1,035	28,866	生活必需品
SUZANO SA	42.45	137	3,846	素材
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	70	154	4,303	金融
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	79	149	4,175	公益事業
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	150	536	14,950	金融
BR MALLS PARTICIPACOES SA	141.08	198	5,538	不動産
CIELO SA	347.28	229	6,390	情報技術
HYPERA SA	53	153	4,285	ヘルスケア
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	45	388	10,834	生活必需品
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	18	160	4,486	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS	45	148	4,151	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	32	57	1,596	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	82	355	9,917	金融
KLABIN SA - UNIT	98	154	4,311	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	292	627	17,503	エネルギー
LOJAS AMERICANAS SA	19	24	679	一般消費財・サービス
KROTON EDUCACIONAL SA	317	332	9,262	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	202.65	648	18,079	金融
AMBEV SA	650	1,146	31,967	生活必需品
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,511.01 49銘柄	30,851 <12.3%>	860,134
(マレーシア)				
	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYAN BANKING BHD	647	579	15,089	金融
GENTING BHD	450	291	7,590	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD	346	799	20,822	金融
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	391	326	8,488	素材
GENTING MALAYSIA BHD	675	218	5,675	一般消費財・サービス
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	737	389	10,129	金融
TENAGA NASIONAL BHD	441	537	13,981	公益事業
PETRONAS GAS BHD	103	181	4,718	公益事業
SAPURA ENERGY BHD	6,928	214	5,590	エネルギー
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,718 9銘柄	3,537 <1.3%>	92,086

銘柄	2019年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
<b>(南アフリカ)</b>				
GOLD FIELDS LTD	254.9	1,988	14,613	素材
NEPI ROCKCASTLE PLC	49	635	4,672	不動産
OLD MUTUAL LTD	690	1,496	11,000	金融
VODACOM GROUP LTD	162.5	2,047	15,049	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	100.9	1,673	12,301	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	100.1	2,537	18,648	金融
BIDVEST GROUP LTD	54.3	1,061	7,803	資本財・サービス
BID CORP LTD	51.1	1,596	11,731	生活必需品
NETCARE LTD	329.3	589	4,332	ヘルスケア
STANDARD BANK GROUP LTD	302.9	5,934	43,617	金融
SASOL LTD	151.9	5,422	39,857	素材
REMGRO LTD	75.4	1,407	10,345	金融
EXXARO RESOURCES LTD	46	792	5,828	エネルギー
PICK N PAY STORES LTD	85.7	600	4,416	生活必需品
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	96.4	691	5,083	一般消費財・サービス
SANLAM LTD	310.4	2,428	17,852	金融
TIGER BRANDS LTD	31.8	726	5,336	生活必需品
FIRSTRAND LTD	539	3,611	26,543	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	276.8	1,338	9,834	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	43.3	766	5,633	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	251.3	4,321	31,765	金融
NASPERS LTD-N SHS	14.2	4,896	35,991	一般消費財・サービス
INVESTEC LTD	69.9	628	4,617	金融
MTN GROUP LTD	544.1	5,807	42,686	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	137.8	952	6,998	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	70.3	710	5,219	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	57.9	1,376	10,115	素材
BARLOWORLD LTD	60.7	763	5,613	資本財・サービス
SAPPI LIMITED	157.1	911	6,702	素材
TELKOM SA SOC LTD	108.3	1,031	7,580	コミュニケーション・サービス
MONDI LTD	21.7	693	5,097	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE	47.3	898	6,605	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	31.9	645	4,743	一般消費財・サービス
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	276.4	630	4,633	ヘルスケア
SIBANYE GOLD LTD	555.7	830	6,106	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,156.3 35銘柄	62,446 <6.6%>	458,981
<b>(タイ)</b>		百株	千タイ・バーツ	千円
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	102	2,040	7,099	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	166	7,602	26,457	素材
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	110	2,128	7,407	金融
KASIKORNBANK PCL-NVDR	78	1,509	5,252	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	571	7,622	26,527	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	302	1,691	5,885	金融
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	200	3,970	13,815	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	1,790	3,490	12,146	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,233	1,787	6,221	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	299	3,782	13,162	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	2,843	1,347	4,689	エネルギー
PTT PCL-NVDR	3,860	17,949	62,462	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	347	2,090	7,275	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	423	3,510	12,217	生活必需品
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,034	2,972	10,345	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	614	3,822	13,301	素材
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,972 16銘柄	67,318 <3.3%>	234,268
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	392,145.96 356銘柄	— <89.7%>	6,274,186

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17日現在の時価を対顧客直物電信売相場場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	柄	2019年6月17日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		千口	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M		256	5,324	578,592
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	256 1銘柄	5,324	578,592 <8.3%>
(トルコ)		千口	千トルコ・リラ	千円
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI		171.87	189	3,476
トルコ・リラ通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	171.87 1銘柄	189	3,476 <0.0%>
(メキシコ)		千口	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		67.7	1,706	9,677
メキシコ・ペソ通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	67.7 1銘柄	1,706	9,677 <0.1%>
(南アフリカ)		千口	千南アフリカ・ランド	千円
REDEFINE PROPERTIES LTD		105	948	6,968
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		59.43	1,425	10,474
南アフリカ・ランド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	164.43 2銘柄	2,373	17,443 <0.2%>
合 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	660 5銘柄	—	609,190 <8.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17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	2019年6月17日現在	
	買 建 額	売 建 額
外 国 MSCI EMGMKT (アメリカ)	百万円 76	百万円 —

(注1) 外貨建の評価額は、2019年6月17日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
 (注2) 単位未満は切捨て。

# ダイワ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

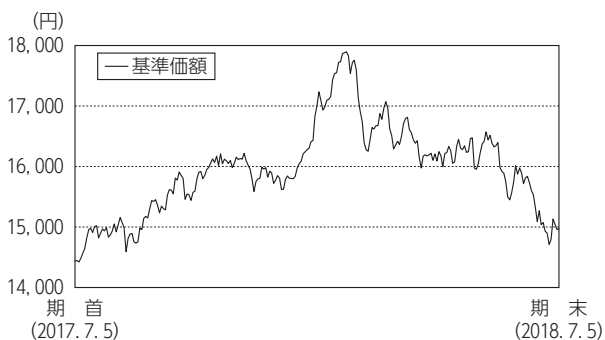
## 大和投資信託

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。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ライキなどによる経済的混乱を受けたブラジル・リ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 (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 (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

年月日	基準価額		FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)		株式 組入 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。

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設定時を除き、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックス採用銘柄の組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、D R等を組み入れることで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 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、乖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（D R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 E T F にも一部投資します。なお、株式および E T F の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、リバランス時等に、株式実質組入比率の維持を目的に株価指数先物取引の利用も検討します。

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

■売買および取引の状況

(1) 株式

(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 国	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 ( )	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 ( )	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 ( )	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 ( )	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 ( )	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
	マレーシア	百株 3,909 ( )	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 ( )	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		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	千口 717.5 ( )	千アメリカ・ドル 15,849 ( )	千口 430.5 ( )	千アメリカ・ドル 10,058 ( )
	メキシコ	千口 16.1 ( )	千メキシコ・ペソ 461 (△ 4)	千口 — ( )	千メキシコ・ペソ — ( )
南アフリカ	千口 26.9 ( )	千南アフリカ・ランド 408 ( )	千口 — ( )	千南アフリカ・ランド — ( )	

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(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 1,438	百万円 1,384	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。

■ 1万口当りの費用の明細

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



■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)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	千株 627	千円 67,637	円 107	CHINA EVERGRANDE GROUP (ケイマン諸島)	千株 59	千円 20,673	円 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)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	千口 717.5	千円 1,749,883	円 2,438	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	千口 430.5	千円 1,085,447	円 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 末		業 種 等	
			株数	金額		
			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		
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	
CTRIIP. 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	
ROSNEFT 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	23,424.37	5,786.33	4,250	469,382
	銘柄数 < 比率 >	21銘柄	25銘柄			<8.9%>
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
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	

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 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
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
WEICHAI 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
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

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港ドル	千円	
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 76銘柄	133,987.92 82銘柄	94,018 <25.0% >	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円
YANGZIJANG 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 1銘柄	28 <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
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% >	

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	
(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
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、金額 銘柄数 < 比率 >	8,916.32 14銘柄	11,553.17 12銘柄	31,805 <3.4%>	180,657
(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、金額 銘柄数 < 比率 >	11,781.84 9銘柄	16,470.03 10銘柄	303,561 <1.0%>	51,393
(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 INFRATEL 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

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	千インド・ルピー	千円	
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
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 <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 <1.2%>	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・レアル	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
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 RENNEN 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

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		
LOJAS AMERICANAS SA	百株 —	百株 19	千ブラジル・リアル 24	千円 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 銘柄数 < 比率 >	5,818.06 41銘柄	8,373.86 42銘柄	18,034	508,936 <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 銘柄数 < 比率 >	3,732 14銘柄	7,679 13銘柄	4,019	109,760 <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	
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・バーツ	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	

銘柄	柄	期首		当		期末		業種等
		株数	株数	株数	株数	評価額	評価額	
		百株	百株	千タイ・パーツ	千円	外貨建金額	邦貨換算金額	
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
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 銘柄数 < 比率 >	882.6 9銘柄	641.8 7銘柄	2,024	59,475		<1.1%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	183,546.11 346銘柄	270,005.85 353銘柄	—	4,320,647		<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	柄	期首		当		期末	
		口数	口数	口数	口数	評価額	評価額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)							
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M		75	362	7,428	820,300		
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	75 1銘柄	362 1銘柄	7,428	820,300		<15.5%>
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコ・ペソ	千円		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		22.5	38.6	1,077	6,121		
メキシコ・ペソ通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	22.5 1銘柄	38.6 1銘柄	1,077	6,121		<0.1%>
(南アフリカ)		千口	千口	南アフリカ・ランド	千円		
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	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	53.21 2銘柄	80.11 2銘柄	1,307	10,540		<0.2%>
合計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	150.71 4銘柄	480.71 4銘柄	—	836,962		<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。

■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
未収配当金	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)212,644,854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)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。

■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。



# ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債
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。	

### 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。

## 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)

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

<4643>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		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 6月15日)	円 9,858	円 0	% △ 1.4	521.587	% △ 1.3	% 99.4	% —	百万円 14,248
2 期末 (2018年 6月15日)	円 9,915	円 0	% 0.6	525.468	% 0.7	% 99.4	% —	百万円 25,120
3 期末 (2019年 6月17日)	円 10,149	円 0	% 2.4	538.684	% 2.5	% 99.4	% —	百万円 27,372

(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。

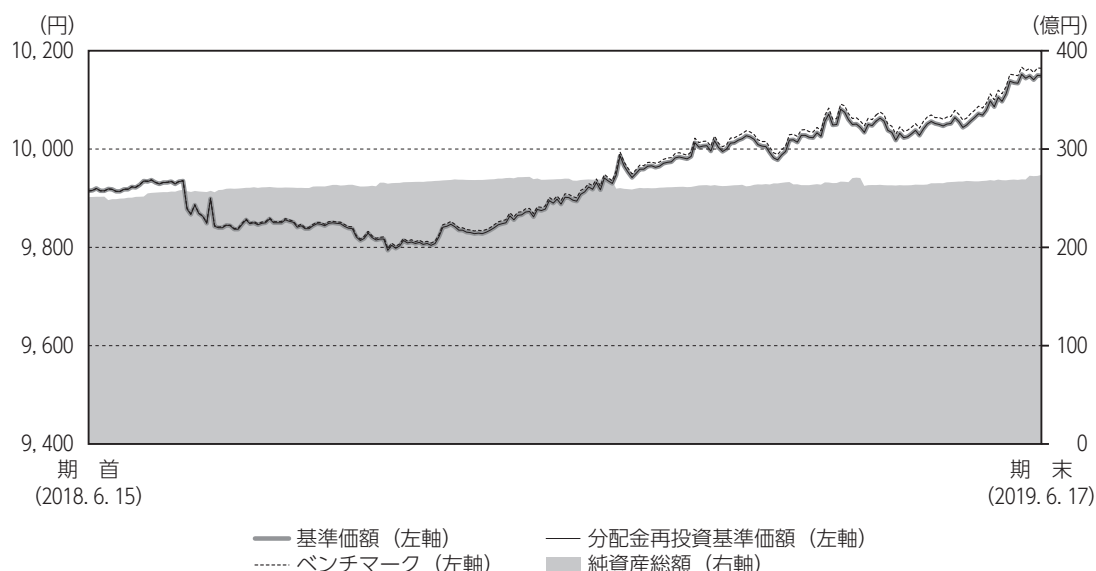
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(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：9,915円

期末：10,149円 (分配金0円)

騰落率：2.4% (分配金込み)

#### ■ 基準価額の主な変動要因

投資している債券の価格上昇 (金利は低下) や債券からの利息収入がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2018年6月15日	9,915	—	525.468	—	99.4	—
6月末	9,918	0.0	525.663	0.0	99.1	—
7月末	9,899	△ 0.2	524.694	△ 0.1	99.3	—
8月末	9,844	△ 0.7	521.874	△ 0.7	98.9	—
9月末	9,820	△ 1.0	520.614	△ 0.9	99.5	—
10月末	9,835	△ 0.8	521.502	△ 0.8	99.4	—
11月末	9,875	△ 0.4	523.683	△ 0.3	99.4	—
12月末	9,947	0.3	527.623	0.4	99.5	—
2019年1月末	9,985	0.7	529.658	0.8	99.4	—
2月末	10,005	0.9	530.781	1.0	99.4	—
3月末	10,075	1.6	534.623	1.7	99.4	—
4月末	10,041	1.3	532.961	1.4	99.5	—
5月末	10,105	1.9	536.316	2.1	99.2	—
(期末)2019年6月17日	10,149	2.4	538.684	2.5	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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### 国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は低下しました。

2018年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すると同時に長短金利操作と資産買い入れを柔軟化し、長期金利の変動を容認する方針を示しました。この決定を受け、長期金利は10月中旬まで上昇しました。しかし、10月下旬の世界的な株価の下落を受けて、長期金利は低下に転じました。2019年年初には、市場のリスク回避姿勢の強まりを背景に長期金利はマイナス圏まで急落しました。その後、米国金利の上昇や株高を受けて長期金利はいったんプラス圏まで回復したものの、国債への旺盛な需要を背景に低下しました。当作成期末にかけては、米中貿易摩擦の激化や欧州の景気鈍化懸念に加え、多くの国・地域の中央銀行が金融緩和的な姿勢を強める中で日本の追加緩和期待も浮上し、国内長期金利はマイナス幅を拡大させました。

## 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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■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

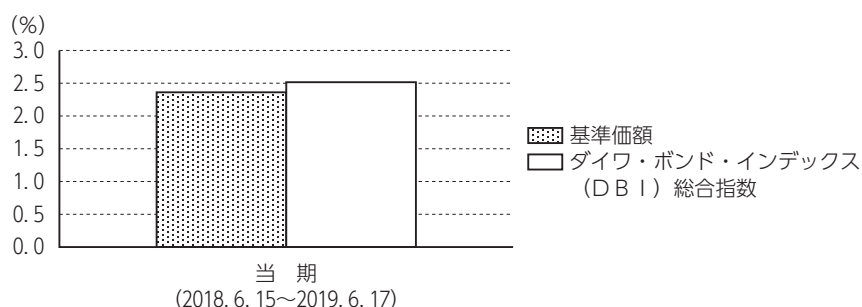
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

## ベンチマークとの差異について

当作成期の当ファンドの基準価額の騰落率は2.4%となりました。一方、ベンチマークの騰落率は2.5%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△0.2%程度でした。差異の内訳は、信託報酬要因によるベンチマークとの差異が△0.2%程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が△0.0%程度となっており、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、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、留保金につきましては、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	
	2018年6月16日 ~2019年6月17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)	267	

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■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 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	15円	0.146%	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9,941円です。
(投信会社)	(8)	(0.081)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、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)	(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	15	0.152	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17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	4,430,512	6,240,255	3,305,216	4,658,339

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	20,885	830	4.0	16,170	1,282	7.9
コール・ローン	82,031	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合33.6%

※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
	千口	千口	千円
日本債券インデックス マザーファンド	17,898,814	19,024,110	27,345,256

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17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	27,345,256	99.8
コール・ローン等、その他	58,479	0.2
投資信託財産総額	27,403,736	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

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	27,403,736,693円
コール・ローン等	58,479,756
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	27,345,256,937
(B) 負債	31,444,588
未払解約金	11,495,232
未払信託報酬	19,229,308
その他未払費用	720,048
(C) 純資産総額 (A - B)	27,372,292,105
元本	26,970,241,880
次期繰越損益金	402,050,225
(D) 受益権総口数	26,970,241,880口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,149円

\* 期首における元本額は25,335,886,514円、当作成期中における追加設定元本額は9,926,740,515円、同解約元本額は8,292,385,149円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,149円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 37,973円
受取利息	6,538
支払利息	△ 44,511
(B) 有価証券売買損益	631,375,192
売買益	685,848,661
売買損	△ 54,473,469
(C) 信託報酬等	△ 40,049,131
(D) 当期損益金 (A + B + C)	591,288,088
(E) 前期繰越損益金	88,998,701
(F) 追加信託差損益金	△ 278,236,564
(配当等相当額)	( 40,607,892)
(売買損益相当額)	(△ 318,844,456)
(G) 合計 (D + E + F)	402,050,225
次期繰越損益金 (G)	402,050,225
追加信託差損益金	△ 278,236,564
(配当等相当額)	( 40,607,892)
(売買損益相当額)	(△ 318,844,456)
分配準備積立金	680,324,762
繰越損益金	△ 37,973

(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	591,308,207
(c) 収益調整金	40,607,892
(d) 分配準備積立金	89,016,555
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	720,932,654
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	720,932,654
(h) 受益権総口数	26,970,241,880口

## &lt;補足情報&gt;

当ファンド（ダイワファンドラップ 日本債券インデックス）が投資対象としている「日本債券インデックスマザーファンド」の決算日（2018年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2019年6月17日）現在における日本債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を150～155ページに併せて掲載いたしました。

### ■日本債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
351 10年国債 0.1% 2028/6/20	900,693	124 5年国債 0.1% 2020/6/20	1,343,825
353 10年国債 0.1% 2028/12/20	709,640	123 5年国債 0.1% 2020/3/20	782,195
136 5年国債 0.1% 2023/6/20	705,588	120 5年国債 0.2% 2019/9/20	682,434
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	658,236	122 5年国債 0.1% 2019/12/20	631,562
352 10年国債 0.1% 2028/9/20	631,727	383 2年国債 0.1% 2019/12/15	621,595
139 5年国債 0.1% 2024/3/20	628,721	121 5年国債 0.1% 2019/9/20	551,303
127 5年国債 0.1% 2021/3/20	603,265	305 10年国債 1.3% 2019/12/20	507,480
394 2年国債 0.1% 2020/11/1	552,502	385 2年国債 0.1% 2020/2/15	501,364
133 5年国債 0.1% 2022/9/20	534,967	342 10年国債 0.1% 2026/3/20	463,132
342 10年国債 0.1% 2026/3/20	512,710	345 10年国債 0.1% 2026/12/20	407,146

(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、2019年6月17日現在における日本債券インデックスマザーファンド（55,985,054千円）の内容です。

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

作 成 期	2019年6月17日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	62,877,000	69,574,913	86.5	—	58.4	20.7	7.4
地方債証券	4,000,000	4,268,356	5.3	—	2.5	2.3	0.5
特殊債券（除く金融債券）	2,800,000	2,942,906	3.7	—	1.6	1.8	0.3
金融債券	100,000	99,870	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	3,100,000	3,220,570	4.0	—	2.1	0.9	1.0
合 計	72,877,000	80,106,616	99.5	—	64.7	25.7	9.1

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区 分	2019年6月17日現在				
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	391 2年国債	0.1000	100,000	100,320	2020/08/01
	392 2年国債	0.1000	50,000	50,172	2020/09/01
	125 5年国債	0.1000	940,000	943,374	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	130,000	131,940	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	150,000	151,861	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	91,680	2020/09/21
	394 2年国債	0.1000	550,000	552,194	2020/11/01
	126 5年国債	0.1000	790,000	793,460	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	700,000	714,700	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	56,198	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	1,380,000	1,387,162	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	200,000	205,260	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	265,922	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	66,592	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	110,955	2021/03/22
	399 2年国債	0.1000	100,000	100,537	2021/04/01
	400 2年国債	0.1000	200,000	201,124	2021/05/01
	128 5年国債	0.1000	1,000,000	1,006,040	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	227,227	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	250,000	256,542	2021/06/20
51 20年国債	2.0000	82,000	85,636	2021/06/21	
129 5年国債	0.1000	1,020,000	1,027,048	2021/09/20	

2019年6月17日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	317 10年国債	1.1000	214,000	220,332	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	205,464	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	54,721	2021/09/21
	130 5年国債	0.1000	880,000	886,872	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	103,288	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	230,000	236,982	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	69,833	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	68,939	2021/12/20
	131 5年国債	0.1000	920,000	928,022	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	180,864	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	133,996	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	148,576	2022/03/21
	132 5年国債	0.1000	680,000	686,582	2022/06/20
	324 10年国債	0.8000	410,000	422,587	2022/06/20
	133 5年国債	0.1000	430,000	434,510	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	320,319	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	200,000	213,876	2022/09/20
	134 5年国債	0.1000	610,000	617,002	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	30,975	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	466,218	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	48,053	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,572	2022/12/20
	135 5年国債	0.1000	880,000	890,824	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	360,927	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	104,637	2023/03/20
	136 5年国債	0.1000	700,000	709,338	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	520,710	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	98,934	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	140,611	2023/06/20
	137 5年国債	0.1000	400,000	405,672	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	638,964	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	377,942	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	98,220	2023/09/20
	138 5年国債	0.1000	650,000	659,763	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	400,000	415,116	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	191,887	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	202,010	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	620,000	629,827	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	780,000	811,106	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	60,600	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	133,948	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	122,258	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	800,000	833,616	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	94,005	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	140,310	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	780,000	810,295	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	196,595	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	286,195	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	308,868	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	134,850	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	82,440	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	490,000	507,850	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	90,788	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	57,283	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	146,773	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	680,000	705,867	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	68,848	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	56,738	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	60,464	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	770,000	800,538	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	86,677	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	99,774	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	440,000	455,250	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	107,207	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	830,000	848,492	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	67,177	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	93,755	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	64,079	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	830,000	849,197	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	117,846	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	91,365	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	700,000	716,779	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	23,552	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	71,098	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	630,000	645,384	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	364,476	2026/12/20



2019年6月17日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	346 10年国債	0.1000	800,000	819,864	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	117,326	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	153,546	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	330,000	338,190	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	60,120	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	65,238	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	600,000	614,850	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	47,999	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	120,000	142,993	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	800,000	819,704	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	150,000	179,467	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	670,000	686,374	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	187,557	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	75,000	92,085	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	101,010	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	600,000	614,532	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	98,667	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	208,115	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	12,059	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	102,984	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	630,000	644,779	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	152,471	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	182,920	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	550,000	562,716	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	109,318	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	277,000	331,125	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	380,000	388,633	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	65,964	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	316,963	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	50,000	61,716	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	183,630	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	20,776	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	200,000	245,728	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	86,306	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	223,840	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	30,442	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	140,000	174,717	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	215,000	265,980	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	37,865	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	116,874	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	112,350	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	210,000	249,032	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	170,000	207,882	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	160,000	193,840	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	48,258	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	249,910	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	193,000	238,928	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	107,610	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	136,659	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	165,000	203,039	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	35,533	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	146,849	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	230,000	281,050	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	171,519	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	80,000	97,026	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	31,253	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	320,000	389,008	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	230,000	282,483	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	80,000	98,490	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	112,089	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	200,000	241,118	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	71,390	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	70,000	85,476	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	87,000	103,971	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	235,000	283,898	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	335,000	409,956	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	33,459	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	50,993	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	200,000	245,260	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	200,000	247,954	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	51,594	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	255,158	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	200,000	240,268	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	49,282	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	380,000	468,179	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	77,467	2033/09/20

2019年6月17日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	146 20年国債	1.7000	230,000	283,923	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	95,994	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	250,000	305,587	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	110,060	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	330,000	399,201	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	136,084	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	252,000	305,282	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	100,000	136,477	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	250,000	299,515	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	108,261	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	370,000	432,478	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	107,296	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	350,000	409,391	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	76,694	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	400,000	474,864	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	82,903	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	400,000	468,888	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	81,171	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	275,000	313,662	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	97,281	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	230,000	239,591	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	83,589	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	400,000	402,980	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	128,584	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	100,000	105,709	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	205,014	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	280,000	300,722	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	249,820	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	270,000	294,659	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	280,000	300,507	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	211,888	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	300,000	321,702	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	290,000	310,978	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	241,547	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	370,000	389,709	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	330,000	347,169	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	281,852	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	300,000	326,904	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	300,000	315,414	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	307,498	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	200,000	206,228	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	180,000	249,357	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	235,000	332,012	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	311,000	422,558	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	233,000	327,751	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	195,000	267,231	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	270,000	371,722	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	300,000	407,901	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	190,000	255,173	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	172,000	235,469	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	140,000	188,764	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	225,618	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	176,000	234,124	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	170,000	226,412	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	165,000	220,268	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	257,474	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	140,000	180,594	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	210,000	276,523	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	250,000	316,935	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	93,000	118,118	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	215,000	240,430	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	240,000	237,624	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	235,000	244,684	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	200,000	213,348	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	218,000	244,048	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	200,000	224,098	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	210,000	235,206	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	257,830	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	109,055	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	300,000	336,144	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	200,000	218,432	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	180,000	206,548	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	218,428	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	166,633	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	150,000	155,434	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	113,267	2050/03/20

2019年6月17日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	4 40年国債	2.2000	107,000	165,220	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	187,256	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	155,301	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	172,414	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	307,229	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	220,352	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	375,000	440,835	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	365,398	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	80,000	82,601	2059/03/20
種別小計	銘柄数	259銘柄			
	金額		62,877,000	69,574,913	
地方債証券	688 東京都公債	0.9400	100,000	101,194	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	101,433	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	101,549	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	101,928	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	102,381	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	102,591	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	102,879	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	102,884	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	102,577	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	102,836	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	102,768	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	102,640	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	102,790	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	102,788	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	102,688	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	102,720	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	102,902	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,946	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	103,638	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	206,515	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,277	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,970	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,713	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	206,710	2025/04/16
	751 東京都公債	0.3700	100,000	102,554	2025/12/19
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	202,259	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	101,465	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,793	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	120,842	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	118,651	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	122,242	2029/06/20
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	121,090	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	119,027	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	119,265	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	111,816	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	136,506	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	121,511	2045/12/20
種別小計	銘柄数	37銘柄			
	金額		4,000,000	4,268,356	
特殊債券(除く金融債券)	110 政保道路機構	1.3000	100,000	101,457	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	104,433	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	102,481	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	102,644	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	102,862	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	102,950	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	102,979	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	102,903	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	103,101	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	103,099	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	103,505	2023/02/24
	19 政保政策投資C	0.6680	100,000	103,001	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,002	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,334	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	102,926	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	103,662	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,930	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,404	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,708	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	206,324	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	110,673	2027/08/25
	1 地方公共団体15年	1.3340	100,000	110,944	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	120,421	2029/07/31

日本債券インデックスマザーファンド

2019年6月17日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	31 地方公共団20 223 政保道路機構 284 政保道路機構	1.7440 1.4270 0.1490	100,000 100,000 200,000	120,935 119,242 197,973	2033/09/28 2034/07/31 2036/07/31
種別小計	銘 柄 数 金 額	26銘柄	2,800,000	2,942,906	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	99,870	2026/09/18
種別小計	銘 柄 数 金 額	1銘柄	100,000	99,870	
普通社債券	9 AUST・NZ 銀行 20 東京三菱銀行 15 トヨタファイナンス 17 シティグループ・インク 72東日本旅客鉄道 44 野村ホールディング 2 イオンFS 9三菱UFJ信託BK 劣 11 セブンアンドアイ 11三菱UFJ信託BK 372 中国電力 4 JX ホールディングス 30 大阪瓦斯 175 オリックス 21 西日本高速道 1 三菱UFJFG 劣後 5 野村不動産HD 63 中日本高速道 4 ファーストリテイリング 20 成田国際空港 17 パナソニック 509 関西電力 12 アサヒグループHD 15 デンソー 78 トヨタファイナンス 11 東京電力パワー 41 東海旅客鉄道 18 エヌティティ都市開 7 凸版印刷 332 北海道電力 107東日本旅客鉄	0.3430 2.5700 1.8000 2.0400 1.2800 0.7230 0.5720 1.6800 0.5140 1.3600 1.2040 1.1450 0.7590 1.0640 0.7540 0.9400 0.9240 0.5760 0.7490 0.1050 0.4700 0.4700 0.3300 0.2450 0.2650 0.7900 2.1660 1.0900 1.1040 0.9070 1.4150	100,000 100,000	100,286 102,865 102,092 102,359 101,957 101,081 100,826 103,071 101,460 103,657 103,834 103,787 102,718 104,206 103,362 103,208 104,037 103,346 103,831 100,214 101,959 101,358 101,284 100,749 100,960 99,782 119,489 108,165 108,814 104,587 121,210	2020/07/24 2020/07/27 2020/08/21 2020/09/16 2020/12/22 2021/02/25 2021/03/18 2021/04/28 2022/06/20 2022/06/27 2022/08/25 2022/12/14 2022/12/14 2023/11/24 2023/12/20 2024/06/26 2025/05/30 2025/11/13 2025/12/18 2026/08/21 2026/09/18 2027/05/25 2027/06/11 2027/06/18 2027/07/23 2028/01/25 2029/01/29 2029/09/20 2029/12/12 2036/04/25 2045/01/27
種別小計	銘 柄 数 金 額	31銘柄	3,100,000	3,220,570	
合 計	銘 柄 数 金 額	354銘柄	72,877,000	80,106,616	

(注) 単位未満は切捨て。

## 日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第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

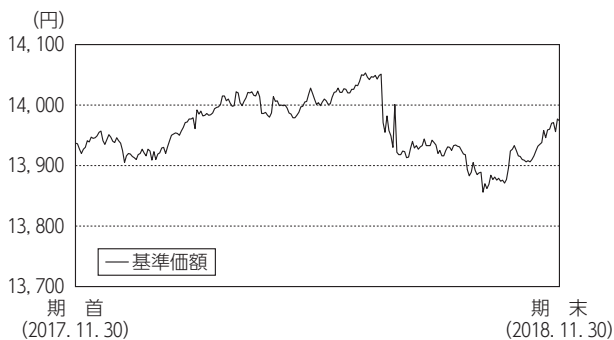
## 大和投資信託

Daiva 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：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せん。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。

年月日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債組入比率	債券先物比率
	円	%	ベンチマーク	騰落率		
(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。

■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	国債証券	23,825,721	( 13,083,950 )
	地方債証券	692,825	( 761,442 )
内	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 付	
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)

区 分	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	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		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券	383 2年国債	0.1000	450,000	451,138	2019/12/15
	122 5年国債	0.1000	630,000	631,581	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	500,000	507,490	2019/12/20
	385 2年国債	0.1000	500,000	501,505	2020/02/15
	123 5年国債	0.1000	780,000	782,472	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	260,087	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	400,000	407,460	2020/03/20

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

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	末		償還年月日
			額 面 金 額 千円	評 価 額 千円	
	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
	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



区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	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
	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
	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

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	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
	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

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	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15年	1.3340	100,000	110,154	2028/01/28
	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	銘 柄 数	1銘柄			
	金 額		100,000	98,303	2026/09/18
普通社債券	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。

## ■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 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3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	外国の公社債
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。	

### 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)

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

<2734>

## 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 6月15日)	円 9,710	円 0	% △ 2.9	円 9,751	% △ 2.5	% 93.8	% 4.0	百万円 33,745
2 期末 (2018年 6月15日)	円 9,475	円 0	% △ 2.4	円 9,567	% △ 1.9	% 95.4	% 2.1	百万円 61,154
3 期末 (2019年 6月17日)	円 9,905	円 0	% 4.5	円 10,050	% 5.1	% 97.3	% 1.4	百万円 72,847

(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。

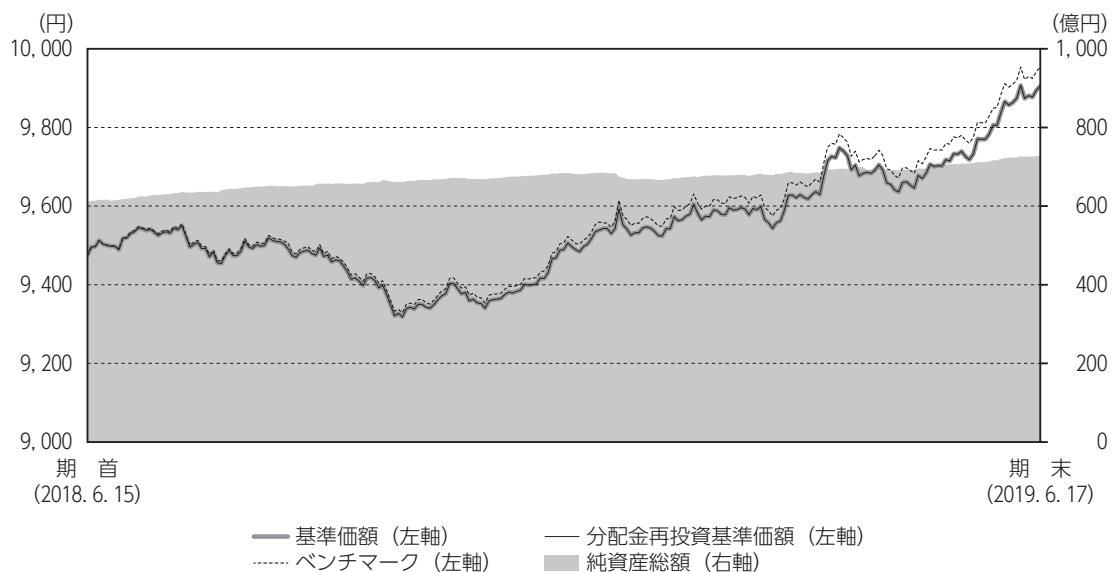
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(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 FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) です。

### ■ 基準価額・騰落率

期首：9,475円

期末：9,905円 (分配金0円)

騰落率：4.5% (分配金込み)

### ■ 基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に投資した結果、利息収入を得たことや各国の金利が低下 (債券価格は上昇) したため、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%
(期首)2018年 6月15日	9,475	—	9,567	—	95.4	2.1
6月末	9,519	0.5	9,612	0.5	93.7	4.0
7月末	9,471	△ 0.0	9,568	0.0	95.2	1.0
8月末	9,482	0.1	9,582	0.2	94.9	0.3
9月末	9,418	△ 0.6	9,520	△ 0.5	97.7	1.4
10月末	9,390	△ 0.9	9,495	△ 0.8	93.8	1.2
11月末	9,417	△ 0.6	9,523	△ 0.5	97.0	0.7
12月末	9,542	0.7	9,655	0.9	94.3	—
2019年 1月末	9,579	1.1	9,699	1.4	96.7	—
2月末	9,566	1.0	9,689	1.3	98.4	—
3月末	9,740	2.8	9,868	3.2	96.8	—
4月末	9,670	2.1	9,802	2.5	97.6	0.6
5月末	9,805	3.5	9,946	4.0	94.9	1.2
(期末)2019年 6月17日	9,905	4.5	10,050	5.1	97.3	1.4

(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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通じて低下しました。

当作成期首より、金利はおおむねレンジ内での推移となりました。2018年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。しかし10月以降は、株価や原油価格が下落し市場のリスク回避姿勢が強まる場面が見られたことや、FRB（米国連邦準備制度理事会）が利上げを一時停止する姿勢を示したことなどを受けて、金利は低下傾向となりました。その後も、米中の貿易摩擦や世界的な景気減速への懸念、また米国の利下げ観測の高まりなどが、金利の低下要因となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

外貨建資産については為替ヘッジを行い、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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

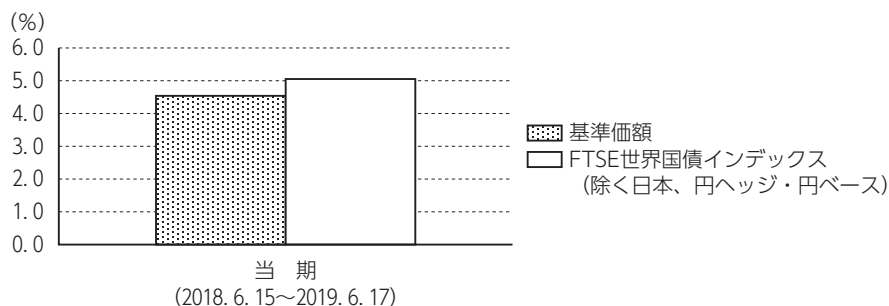
外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

## 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（FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の騰落率は5.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.5%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	
	2018年6月16日 ～2019年6月17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)	393

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

外貨建資産については為替ヘッジを行い、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 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	39円	0.413%	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9,546円です。
(投信会社)	(27)	(0.282)	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)	(10)	(0.109)	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	2	0.017	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)	(0)	(0.003)	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	41	0.430	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

	設 定		解 約	
	口数	金額	口数	金額
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	14,172,915	13,648,921	5,545,669	5,359,098

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	72,778,781	99.5
コール・ローン等、その他	385,661	0.5
投資信託財産総額	73,164,442	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1シンガポール・ドル=79.26円、1イギリス・ポンド=136.75円、1デンマーク・クローネ=16.32円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローネ=11.45円、1メキシコ・ペソ=5.67円、1マレーシア・リングギット=26.03円、1南アフリカ・ランド=7.35円、1ポーランド・ズロチ=28.63円、1ユーロ=121.87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(87,667,683千円)の投資信託財産総額(89,500,072千円)に対する比率は、98.0%です。

### ■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	当 期 末		
	期首 口数	口数	評価額
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	64,035,275	72,662,521	72,778,781

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>73,164,442,854円</b>
コール・ローン等	372,641,014
外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	72,778,781,170
マザーファンド (評価額)	
未収入金	13,020,670
<b>(B) 負債</b>	<b>316,964,333</b>
未払解約金	174,650,664
未払信託報酬	141,218,727
その他未払費用	1,094,942
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>72,847,478,521</b>
元本	73,543,593,762
次期繰越損益金	△ 696,115,241
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>73,543,593,762口</b>
<b>1万口当り基準価額 (C / D)</b>	<b>9,905円</b>

\* 期首における元本額は64,540,834,408円、当作成期間中における追加設定元本額は27,255,813,662円、同解約元本額は18,253,054,308円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,905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696,115,241円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 143,859円</b>
受取利息	19,058
支払利息	△ 162,917
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>3,250,457,987</b>
売買益	3,423,942,071
売買損	△ 173,484,084
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 279,312,488</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>2,971,001,640</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 596,261,070</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 3,070,855,811</b>
(配当等相当額)	( 522,621,308)
(売買損益相当額)	(△ 3,593,477,119)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 696,115,241</b>
次期繰越損益金 (G)	△ 696,115,241
追加信託差損益金	△ 3,070,855,811
(配当等相当額)	( 522,621,308)
(売買損益相当額)	(△ 3,593,477,119)
分配準備積立金	2,374,884,429
繰越損益金	△ 143,859

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

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

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「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	2,165,508,764
(c) 収益調整金	522,621,308
(d) 分配準備積立金	209,375,665
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,897,505,737
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,897,505,737
(h) 受益権総口数	73,543,593,762口

# 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書 第3期（決算日 2019年6月17日）

（作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17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いません。
主要投資対象	外国の公社債
株式組入制限	純資産総額の10%以下

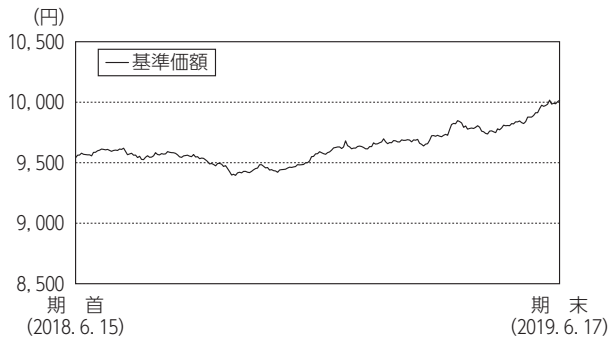
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<https://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：9,541円 期末：10,016円 騰落率：5.0%

【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、利息収入を得たことや各国の金利が低下（債券価格の上昇）したため、基準価額は上昇しました。

#### ◆投資環境について

##### ○海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通じて低下しました。

当作成期首より、金利はおおむねレンジ内での推移となりました。2018年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。しかし10月以降は、株価や原油価格が下落し市場のリスク回避姿勢が強まる場面が見られたことや、F R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げを一時停止する姿勢を示したことなどを受けて、金利は低下傾向となりました。その後も、米中の貿易摩擦や世界的な景気減速への懸念、また米国の利下げ観測の高まりなどが、金利の低下要因となりました。

#### ◆前作成期末における「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5.1%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0.06%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）		公社債比率	債券先比率
	騰落率	（ベンチマーク）騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2018年6月15日	円	%	円	%	%	%
	9,541	—	9,567	—	95.5	2.1
6月末	9,586	0.5	9,612	0.5	93.8	4.0
7月末	9,542	0.0	9,568	0.0	95.3	1.0
8月末	9,556	0.2	9,582	0.2	95.0	0.3
9月末	9,494	△ 0.5	9,520	△ 0.5	97.8	1.4
10月末	9,470	△ 0.7	9,495	△ 0.8	93.9	1.2
11月末	9,500	△ 0.4	9,523	△ 0.5	97.1	0.7
12月末	9,630	0.9	9,655	0.9	94.4	—
2019年1月末	9,671	1.4	9,699	1.4	96.8	—
2月末	9,661	1.3	9,689	1.3	98.5	—
3月末	9,840	3.1	9,868	3.2	96.9	—
4月末	9,772	2.4	9,802	2.5	97.7	0.6
5月末	9,913	3.9	9,946	4.0	95.0	1.2
(期末) 2019年6月17日	10,016	5.0	10,050	5.1	97.4	1.4

(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) 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・オプション）	0円 (0)
有価証券取引税	—
その他費用 （保管費用）	1 (1)
（その他）	(0)
合計	1

(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) 公 社 債

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

		買付額	売付額	
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 170,860	千アメリカ・ドル 52,969 ( — )	
	カナダ	千カナダ・ドル 4,182	千カナダ・ドル ( — )	
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 6,387	千オーストラリア・ドル 1,125 ( — )	
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,423	千シンガポール・ドル 424 ( — )	
	イギリス	千イギリス・ポンド 15,829	千イギリス・ポンド 6,082 ( — )	
	スイス	千スイス・フラン —	千スイス・フラン 681 ( — )	
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 7,007	千デンマーク・クローネ 2,883 ( — )	
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 4,083	千ノルウェー・クローネ ( — )	
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 14,408	千スウェーデン・クローネ ( — )	
	国	メキシコ	千メキシコ・ペソ 20,906	千メキシコ・ペソ 5,228 ( — )
		マレーシア	千マレーシア・リンギット 2,036	千マレーシア・リンギット 1,050 ( — )
		南アフリカ	千南アフリカ・ランド 19,752	千南アフリカ・ランド 1,220 ( — )
		ポーランド	千ポーランド・ズロチ 4,517	千ポーランド・ズロチ 2,506 ( — )
		ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,770	千ユーロ 502 ( — )

		買付額	売付額
外	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 6,330	千ユーロ 3,256 ( — )
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 5,747	千ユーロ 1,288 ( — )
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 25,716	千ユーロ 10,591 ( — )
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 18,230	千ユーロ 11,944 ( — )
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 16,761	千ユーロ 5,374 ( — )
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 22,321	千ユーロ 7,321 ( — )
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 885	千ユーロ 291 ( — )
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 2,999	千ユーロ ( — )
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 100,762	千ユーロ 40,569 ( — )

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 債券先物取引	百万円 16,896	百万円 17,108	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2020/6/30	千円 2,188,263	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/10/31	千円 1,914,759
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2021/6/30	1,966,586	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2019/11/15	1,146,722
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2028/5/15	912,364	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2019/12/31	870,119
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2025/5/15	895,115	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2020/3/15	610,810
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	832,915	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) 2.75% 2023/11/15	782,564	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.5% 2020/4/25	388,911
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/11/15	777,663	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2021/5/25	385,267
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15	776,906	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2.25% 2021/9/4	363,040
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 6.125% 2027/11/15	635,595	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2020/6/30	326,570
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2021/5/15	614,568	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2025/8/15	270,813

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

■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		評 価 額		%			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 366,488	千アメリカ・ドル 381,573	千円 41,461,750	46.6	—	19.5	18.2	8.9	
カナダ	千カナダ・ドル 19,654	千カナダ・ドル 21,696	1,757,455	2.0	—	0.9	0.6	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 20,397	千オーストラリア・ドル 23,311	1,742,068	2.0	—	1.3	0.5	0.2	
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 3,817	302,610	0.3	—	0.2	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 32,222	千イギリス・ポンド 41,758	5,710,491	6.4	—	5.1	0.9	0.4	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 19,850	千デンマーク・クローネ 25,711	419,606	0.5	—	0.3	0.1	0.0	
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 14,251	177,997	0.2	—	0.1	0.0	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 28,650	千スウェーデン・クローネ 32,659	373,950	0.4	—	0.1	0.2	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 98,630	千メキシコ・ペソ 99,114	561,981	0.6	—	0.4	0.1	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 11,280	千マレーシア・リンギット 11,609	302,195	0.3	—	0.3	0.1	—	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 61,020	千南アフリカ・ランド 56,787	417,390	0.5	—	0.4	0.0	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 15,215	千ポーランド・ズロチ 15,891	454,983	0.5	—	0.2	0.2	0.1	
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 4,748	千ユーロ 5,520	672,752	0.8	—	0.5	0.2	0.1	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 11,700	千ユーロ 14,283	1,740,789	2.0	—	1.2	0.7	0.0	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 14,870	千ユーロ 17,677	2,154,367	2.4	—	1.9	0.4	0.1	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 57,480	千ユーロ 69,733	8,498,374	9.5	—	6.3	2.5	0.7	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 35,845	千ユーロ 44,336	5,403,291	6.1	—	3.7	1.6	0.7	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 34,672	千ユーロ 42,488	5,178,019	5.8	—	3.9	1.4	0.5	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 55,917	千ユーロ 62,417	7,606,787	8.5	—	5.1	2.5	0.9	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 3,300	千ユーロ 3,713	452,575	0.5	—	0.3	0.2	—	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 8,780	千ユーロ 10,865	1,324,130	1.5	—	1.0	0.4	0.1	
ユーロ (小計)	227,312	271,035	33,031,087	37.1	—	24.0	10.0	3.1	
合計	—	—	86,713,568	97.4	—	52.8	31.1	13.5	

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

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	%	千アメリカ・ドル 32,370	千アメリカ・ドル 32,672	千円 3,550,140	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	10,040	10,321	1,121,492	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	18,946	19,031	2,067,915	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	14,500	14,404	1,565,218	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	14,020	13,976	1,518,644	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	24,540	24,502	2,662,436	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	6,310	6,478	703,910	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	12,905	13,399	1,456,033	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,000	5,201	565,156	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	12,580	12,961	1,408,374	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	22,990	23,115	2,511,732	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	2,800	3,293	357,823	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	6,750	8,877	964,662	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,285	139,661	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	2,700	3,428	372,571	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,800	5,326	578,748	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,130	1,506	163,698	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	6,030	7,095	770,957	2039/02/15

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	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	410	540	58,740	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	490	666	72,444	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,770	2,454	266,749	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,970	3,287	357,235	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	9,600	10,158	1,103,846	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,314	142,833	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	3,085	335,245	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	1,195	129,949	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,200	3,679	399,813	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,190	3,520	382,532	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	11,810	12,033	1,307,528	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	15,450	15,422	1,675,775	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	8,300	8,397	912,511	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,570	1,698	184,510	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	9,820	9,864	1,071,874	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	16,720	16,680	1,812,525	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	8,700	8,861	962,840	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,300	2,488	270,398	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,958	212,801	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,165	5,051	548,949	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,070	2,033	220,954	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,500	2,421	263,095	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,350	2,352	255,670	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,480	2,621	284,845	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,370	3,432	372,962	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,000	5,005	543,935	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,350	3,441	373,933	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	2,434	264,520	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,500	1,526	165,816	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,239	352,030	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,310	6,499	706,213	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,800	1,857	201,852	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	5,300	5,868	637,714	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	7,900	8,425	915,550	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	5,500	5,577	606,056	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,622	176,333	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	950	1,103	119,912	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,650	2,871	312,064	2049/02/15
通貨小計	銘柄数 金 額	56銘柄		366,488	381,573	41,461,750	
<b>カナダ</b>				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	610	821	66,511	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,264	102,437	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	450	686	55,607	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	848	1,288	104,331	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	370	525	42,560	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	5,820	5,922	479,702	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	416	33,704	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,040	1,440	116,690	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,238	1,245	100,901	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	230	242	19,677	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	300	372	30,195	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	592	622	50,416	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	820	826	66,924	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,959	1,932	156,560	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	901	73,039	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,240	1,211	98,166	2022/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	629	50,954	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	300	304	24,660	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	1,042	84,412	2024/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		19,654	21,696	1,757,455	
<b>オーストラリア</b>				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,770	1,928	144,115	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,080	1,235	92,339	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,383	1,617	120,868	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,089	1,371	102,509	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	656	708	52,966	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	920	1,078	80,607	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,343	100,417	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	859	1,178	88,056	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	998	1,197	89,497	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	952	71,145	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	400	403	30,190	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	849	63,477	2039/06/21

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,449	108,308	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,158	2,322	173,544	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	475	575	43,029	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	500	560	41,920	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,300	2,397	179,161	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,400	1,584	118,408	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	500	555	41,505	2030/05/21
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		20,397	23,311	1,742,068	
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	226	17,972	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	1,000	1,043	82,739	2022/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	159	12,611	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	300	324	25,704	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	390	394	31,238	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	89	95	7,551	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	207	16,482	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	120	137	10,918	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	413	32,766	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	350	27,779	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	204	16,172	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	260	20,673	2036/08/01
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		3,642	3,817	302,610	
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	812	111,062	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,160	1,622	221,812	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,725	1,822	249,181	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	249	34,122	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	200	202	27,754	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	720	770	105,322	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,100	1,226	167,738	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,050	1,090	149,148	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	856	117,060	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,000	1,145	156,710	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	863	1,270	173,789	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	700	970	132,780	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	175	217	29,789	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,565	2,276	311,368	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	200	318	43,571	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	450	821	112,275	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	620	1,015	138,894	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	600	773	105,743	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	411	666	91,135	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,283	175,552	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,243	3,812	521,380	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,630	2,471	337,920	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,040	1,136	155,479	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	787	1,437	196,604	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,500	1,556	212,806	2020/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	742	794	108,597	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,380	1,432	195,855	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,425	1,961	268,295	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	2,290	2,447	334,759	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	748	1,327	181,515	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,900	2,107	288,153	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,290	1,859	254,309	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	32銘柄		32,222	41,758	5,710,491	
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	9,758	159,263	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,310	2,518	41,095	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,925	47,744	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,330	2,677	43,693	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,200	5,601	91,419	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,229	36,389	2020/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		19,850	25,711	419,606	
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	2,750	34,350	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,150	1,186	14,821	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,408	17,593	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	154	1,931	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,452	18,135	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	3,093	38,632	2027/02/17

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	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	千ノルウェー・クローネ 4,000	千ノルウェー・クローネ 4,206	千円 52,532	2028/04/26
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		13,650	14,251	177,997	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	千スウェーデン・クローネ 2,780	千スウェーデン・クローネ 3,008	34,445	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,920	2,998	34,331	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	12,950	14,531	166,385	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,150	4,525	51,815	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,368	27,114	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,280	2,486	28,472	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,741	31,385	2028/05/12	
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		28,650	32,659	373,950	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 9,200	千メキシコ・ペソ 8,314	47,144	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	11,509	65,257	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	6,843	38,801	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	7,032	39,873	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	4,800	4,766	27,023	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	3,315	18,801	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,877	38,996	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	5,296	30,032	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	5,500	5,506	31,221	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,700	13,388	75,913	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,700	2,705	15,341	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	8,900	8,632	48,947	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,750	4,659	24,416	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	10,266	58,210	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		98,630	99,114	561,981	
マレーシア	MALAYSIAN 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 1,855	48,300	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,250	1,264	32,908	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	600	590	15,360	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,171	30,494	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,100	1,113	28,989	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	600	607	15,815	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,478	38,485	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	400	402	10,477	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,000	2,049	53,349	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	1,076	28,014	2037/04/07
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		11,280	11,609	302,195	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	千南アフリカ・ランド 8,010	千南アフリカ・ランド 8,937	65,691	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	1,200	1,204	8,853	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	2,610	1,821	13,387	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,900	2,933	21,559	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	15,900	14,067	103,392	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	5,250	4,696	34,519	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	2,850	2,639	19,400	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	2,300	2,045	15,037	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	9,700	8,886	65,315	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	5,000	4,674	34,359	2035/02/28
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	5,300	4,880	35,874	2040/01/31	
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		61,020	56,787	417,390	
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 1,350	38,672	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	640	650	18,620	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,018	57,786	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,520	1,524	43,636	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,839	52,657	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	800	813	23,281	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,072	87,976	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	779	22,326	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	772	22,117	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,500	1,547	44,304	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,430	1,522	43,603	2025/07/25
	通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		15,215	15,891	454,983
ユーロ（アイルランド）	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	千ユーロ 688	千ユーロ 909	110,780	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	910	977	119,162	2020/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	420	488	59,539	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	600	707	86,177	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	826	100,696	2030/05/15



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	千円	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	310	377	46,053	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	320	343	41,891	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	170	193	23,634	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	532	64,950	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	163	19,866	2033/05/15
国 小 計	銘柄数 金 額	10銘柄		4,748	5,520	672,752	
ユーロ（オランダ）				千ユーロ	千ユーロ		
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	869	105,988	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	655	1,089	132,719	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,356	165,275	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	175	182	22,279	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	630	1,110	135,343	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,100	2,272	276,959	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	545	66,444	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	590	784	95,555	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	822	100,179	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	740	1,205	146,875	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	380	428	52,268	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	718	87,555	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	670	710	86,554	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	470	508	61,935	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	409	49,938	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	650	79,322	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	620	75,594	2029/07/15
国 小 計	銘柄数 金 額	17銘柄		11,700	14,283	1,740,789	
ユーロ（ベルギー）				千ユーロ	千ユーロ		
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	670	713	86,975	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,022	1,103	134,456	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	610	732	89,246	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	644	78,517	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	564	641	78,167	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	120	152	18,551	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	411	50,159	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,730	1,850	225,492	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	522	63,665	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	399	48,655	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,280	1,366	166,562	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	553	67,431	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	100	114	13,998	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	500	741	90,316	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	450	750	91,508	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	550	620	75,675	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	534	563	68,698	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	665	1,114	135,800	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	300	396	48,310	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	846	103,207	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	437	53,260	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,000	1,112	135,597	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	340	559	68,184	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	921	112,260	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	407	49,666	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	25銘柄		14,870	17,677	2,154,367	
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	3,391	413,266	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,000	1,538	187,532	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,700	2,916	355,430	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,310	2,173	264,884	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,532	2,851	347,509	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	650	703	85,693	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,065	1,722	209,862	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,452	177,044	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,043	1,841	224,363	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,040	1,312	159,988	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,270	4,451	542,496	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,314	3,618	440,973	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,097	255,581	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,910	2,371	288,981	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,195	3,500	426,665	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,340	2,077	253,221	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,730	2,978	363,024	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,200	2,495	304,159	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,486	3,116	379,750	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,360	1,520	185,259	2024/11/25

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,100	2,205	268,723	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,312	281,790	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,070	1,104	134,573	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,300	2,751	335,357	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,526	185,973	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,634	199,176	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,224	149,244	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,300	1,389	169,388	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,100	2,339	285,092	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,950	2,081	253,651	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,224	149,290	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	500	560	68,281	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,248	152,140	2029/05/25
国 小 計	銘柄数 金 額	33銘柄		57,480	69,733	8,498,374	
ユーロ（ドイツ）				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	855	1,339	163,214	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	1,219	148,607	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,496	2,544	310,058	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,060	1,770	215,712	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	970	1,673	203,897	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	890	1,504	183,403	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	720	1,308	159,453	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	610	1,194	145,591	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	806	1,361	165,986	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,658	202,139	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,548	2,394	291,864	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,243	151,513	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,460	1,624	197,968	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	500	556	67,808	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	725	1,145	139,557	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,094	133,402	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	200	216	26,424	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,263	153,969	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,800	1,974	240,602	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	943	114,990	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	950	982	119,768	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	737	89,871	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	700	752	91,678	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	960	1,209	147,355	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	484	58,986	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,300	1,367	166,656	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,440	3,482	424,401	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,721	209,816	2021/04/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,829	222,978	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,529	186,440	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	511	62,338	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	150	153	18,759	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,028	125,338	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	514	62,733	2024/04/05
国 小 計	銘柄数 金 額	34銘柄		35,845	44,336	5,403,291	
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	3,540	431,472	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,400	1,531	186,604	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	610	698	85,081	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,865	2,110	257,232	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,000	1,017	124,022	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,000	1,123	136,892	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	389	511	62,394	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	480	713	86,963	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,749	1,889	230,228	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	1,250	1,275	155,420	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	600	657	80,160	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,579	192,440	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	670	732	89,300	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	950	1,036	126,269	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	350	444	54,216	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	3,000	3,026	368,849	2021/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	873	106,436	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	280	457	55,699	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	800	1,206	147,002	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,300	2,186	266,485	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	943	1,563	190,557	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,600	1,715	209,089	2020/10/31

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	724	803	97,914	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	600	697	84,972	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,310	2,781	339,028	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,588	1,904	232,146	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,100	1,577	192,260	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	890	1,600	195,086	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	833	101,597	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,084	2,397	292,190	2024/10/31
国 小 計	銘柄数 金 額	30銘柄		34,672	42,488	5,178,019	
ユーロ（イタリア）	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,600	2,182	265,953	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,135	2,861	348,720	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,600	1,673	203,922	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	705	724	88,287	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	910	110,921	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	507	61,827	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	810	98,801	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,200	1,189	144,983	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	750	704	85,851	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,400	1,363	166,229	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	3,000	2,982	363,518	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	900	803	97,933	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,300	1,279	155,986	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	500	509	62,036	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,500	1,513	184,439	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	350	368	44,907	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	697	85,055	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	500	60,950	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,000	2,107	256,875	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	200	220	26,922	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	1,063	129,612	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,000	1,012	123,451	2026/07/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	740	936	114,160	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,288	1,750	213,339	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,351	164,707	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,450	1,855	226,183	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	770	891	108,684	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,118	258,139	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,170	2,469	301,008	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,700	2,004	244,295	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,114	1,431	174,443	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	3,050	3,193	389,203	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,850	2,160	263,316	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	3,250	3,439	419,220	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,320	1,439	175,393	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	780	866	105,600	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,770	3,169	386,231	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	80	97	11,940	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,375	1,735	211,484	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	830	943	114,929	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,335	284,570	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,513	184,426	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	700	724	88,319	2021/12/15
国 小 計	銘柄数 金 額	43銘柄		55,917	62,417	7,606,787	
ユーロ（フィンランド）	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	190	202	24,724	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	189	23,085	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	220	263	32,086	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	210	25,632	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	167	20,403	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	525	64,000	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	253	30,907	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	150	18,385	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	980	1,050	127,989	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	210	308	37,562	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	392	47,796	2024/04/15
国 小 計	銘柄数 金 額	11銘柄		3,300	3,713	452,575	
ユーロ（オーストリア）	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	840	922	112,389	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,290	1,381	168,405	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	120	143	17,463	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	400	421	51,315	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	643	78,428	2028/02/20

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	
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	578	70,535	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	480	503	61,317	2020/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	660	721	87,958	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	510	831	101,347	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	400	448	54,673	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	860	978	119,222	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	620	1,268	154,569	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	380	601	73,349	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	680	747	91,067	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	280	362	44,178	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	280	311	37,906	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	16銘柄		8,780	10,865	1,324,130	
通貨小計	銘柄数 金 額	219銘柄		227,312	271,035	33,031,087	
合 計	銘柄数 金 額	423銘柄				86,713,568	

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外 US 5YR NOTE (CBT) (アメリカ)	230	—
US ULTRA BOND CBT (アメリカ)	209	—
LONG GILT FUTURE (イギリス)	142	—
EURO-BUND FUTURE (ドイツ)	41	—
EURO-BOBL FUTURE (ドイツ)	81	—
EURO-SCHATZ FUT (ドイツ)	109	—
EURO-BTP FUTURE (イタリア)	144	—
EURO-OAT FUTURE (フランス)	259	—

(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

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	86,713,568	96.9
コール・ローン等、その他	2,786,503	3.1
投資信託財産総額	89,500,072	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1シンガポール・ドル=79.26円、1イギリス・ポンド=136.75円、1デンマーク・クローネ=16.32円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローネ=11.45円、1メキシコ・ペソ=5.67円、1マレーシア・リンギット=26.03円、1南アフリカ・ランド=7.35円、1ポーランド・ズロチ=28.63円、1ユーロ=121.87円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産（87,667,683千円）の投資信託財産総額（89,500,072千円）に対する比率は、98.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	176,607,894,216円
コール・ローン等	2,036,392,001
公社債（評価額）	86,713,568,595
未収入金	87,128,276,856
未収利息	561,770,663
前払費用	44,471,503
差入委託証拠金	123,414,598
(B) 負債	87,596,926,828
未払金	87,473,747,910
未払解約金	123,178,918
(C) 純資産総額 (A - B)	89,010,967,388
元本	88,872,666,940
次期繰越損益金	138,300,448
(D) 受益権総口数	88,872,666,940口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,016円

\* 期首における元本額は68,969,365,389円、当作成期間中における追加設定元本額は30,384,881,483円、同解約元本額は10,481,579,932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）72,662,521,137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）3,492,377,916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）12,717,767,887円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,016円です。

■損益の状況

当 期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,914,568,883円
受取利息	1,916,390,638
その他収益金	540,345
支払利息	△ 2,362,100
(B) 有価証券売買損益	2,153,224,671
売買益	13,090,799,650
売買損	△ 10,937,574,979
(C) 先物取引等損益	56,791,778
取引益	70,082,234
取引損	△ 13,290,456
(D) その他費用	△ 10,889,673
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	4,113,695,659
(F) 前期繰越損益金	△ 3,167,814,868
(G) 解約差損益金	287,624,890
(H) 追加信託差損益金	△ 1,095,205,233
(I) 合計 (E + F + G + H)	138,300,448
次期繰越損益金 (I)	138,300,448

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

# ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17日)

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、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いません。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債	
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。		

#### 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いません。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)

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

<2735>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末 (2017年 6月15日)	円 10,622	円 0	% 6.2	10,625	% 6.3	% 98.8	% —	百万円 1,404
2 期末 (2018年 6月15日)	10,709	0	0.8	10,815	1.8	98.6	—	2,405
3 期末 (2019年 6月17日)	10,978	0	2.5	11,109	2.7	98.5	—	3,676

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注4) 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。

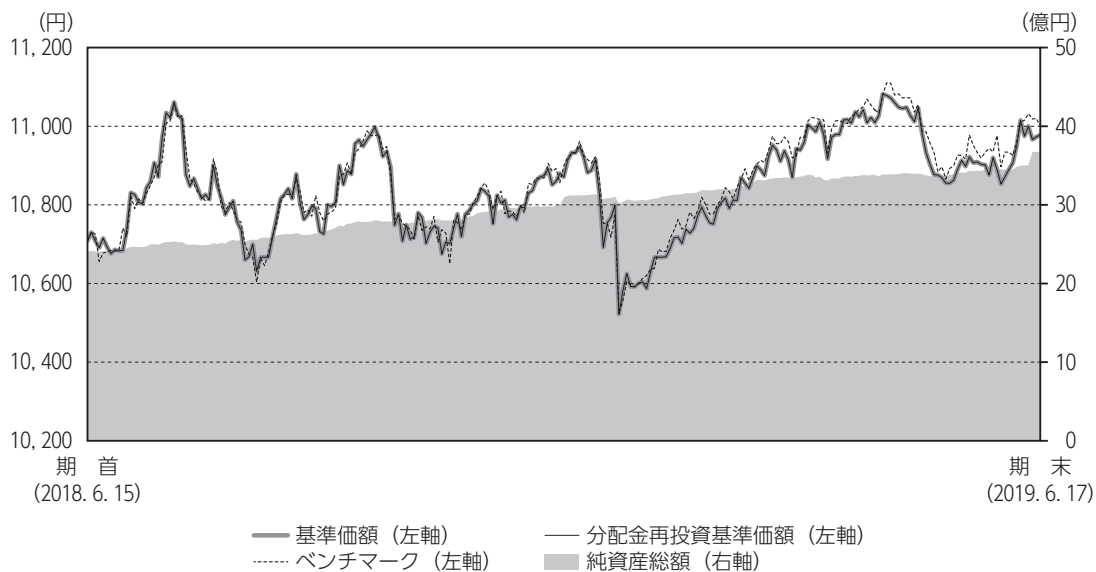
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(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 FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) です。

### ■ 基準価額・騰落率

期首：10,709円

期末：10,978円 (分配金 0円)

騰落率：2.5% (分配金込み)

### ■ 基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に投資した結果、為替市場で円高が進んだものの、債券市場で金利が低下 (債券価格は上昇) したことなどから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%
(期首)2018年 6月15日	10,709	—	10,815	—	98.6	—
6月末	10,738	0.3	10,826	0.1	98.2	—
7月末	10,814	1.0	10,922	1.0	98.1	—
8月末	10,804	0.9	10,942	1.2	97.9	—
9月末	10,980	2.5	11,085	2.5	97.8	—
10月末	10,777	0.6	10,862	0.4	98.1	—
11月末	10,871	1.5	10,976	1.5	98.2	—
12月末	10,799	0.8	10,880	0.6	98.5	—
2019年 1月末	10,728	0.2	10,889	0.7	98.1	—
2月末	10,875	1.6	11,016	1.9	98.1	—
3月末	11,016	2.9	11,118	2.8	98.3	—
4月末	10,982	2.5	11,097	2.6	98.3	—
5月末	10,890	1.7	11,085	2.5	98.1	—
(期末)2019年 6月17日	10,978	2.5	11,109	2.7	98.5	—

(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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通じて低下しました。

当作成期首より、金利はおおむねレンジ内での推移となりました。2018年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。しかし10月以降は、株価や原油価格が下落し市場のリスク回避姿勢が強まる場面が見られたことや、F R B (米国連邦準備制度理事会) が利上げを一時停止する姿勢を示したことなどをを受けて、金利は低下傾向となりました。その後も、米中の貿易摩擦や世界的な景気減速への懸念、また米国の利下げ観測の高まりなどが、金利の低下要因となりました。

### ■為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると円高が進みました。

当作成期首より、米ドルは利上げ観測の高まりなどから上昇しました。2018年9月中旬以降は、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。12月以降は、株価や原油価格が急落する中で市場のリスク回避姿勢が強まり、円高が進行しました。しかし2019年1月に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり市場のリスク選好姿勢が回復したことなどから、米ドルを中心に上昇に転じました。4月以降は、米中の貿易摩擦への懸念などから、円高が進行しました。その後も、世界的な景気減速への懸念や米国の利下げ観測の高まりなどが、円高の要因となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

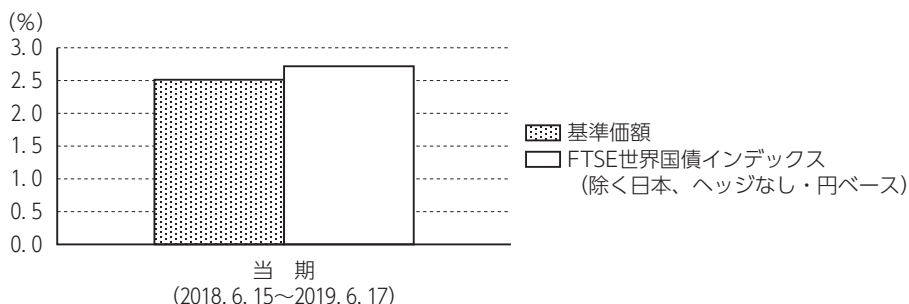
ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマーク（FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））の騰落率は2.7%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。

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。

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	
	2018年 6月16日 ~2019年 6月17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)	978

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





## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	45円	0.413%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は10,843円です。
(投信会社)	(31)	(0.282)	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)	(12)	(0.109)	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＝当期中の売買委託手数料／当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＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.034	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.025)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.008)	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
合計	48	0.446	

(注1) 当期中の費用(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まず。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まず。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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
外国債券インデックスマザーファンド	516,321	1,422,825	87,338	241,494

(注) 単位未満は切捨て。

### ■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

### ■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
外国債券インデックスマザーファンド	885,845	1,314,828	3,672,973

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス マザーファンド	3,672,973 千円	99.6 %
コール・ローン等、その他	14,528	0.4
投資信託財産総額	3,687,501	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1シンガポール・ドル=79.26円、1イギリス・ポンド=136.75円、1デンマーク・クローネ=16.32円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローネ=11.45円、1メキシコ・ペソ=5.67円、1マレーシア・リンギット=26.03円、1南アフリカ・ランド=7.35円、1ポーランド・ズロチ=28.63円、1ユーロ=121.87円です。  
 (注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（174,318,188千円）の投資信託財産総額（175,280,413千円）に対する比率は、99.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>3,687,501,755円</b>
コール・ローン等	14,528,190
外国債券インデックス マザーファンド（評価額）	3,672,973,565
<b>(B) 負債</b>	<b>11,098,190</b>
未払解約金	4,224,609
未払信託報酬	6,739,279
その他未払費用	134,302
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>3,676,403,565</b>
元本	3,348,730,912
次期繰越損益金	327,672,653
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,348,730,912口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	10,978円

- \*期首における元本額は2,246,613,872円、当作成期間中における追加設定元本額は1,649,381,625円、同解約元本額は547,264,585円です。  
 \*当期末の計算口数当りの純資産額は10,978円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 5,440円</b>
受取利息	514
支払利息	△ 5,954
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>80,353,924</b>
売買益	88,829,606
売買損	△ 8,475,682
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 12,606,395</b>
<b>(D) 当期損益金（A+B+C）</b>	<b>67,742,089</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 5,303,523</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>265,234,087</b>
（配当等相当額）	（ 26,486,268）
（売買損益相当額）	（ 238,747,819）
<b>(G) 合計（D+E+F）</b>	<b>327,672,653</b>
次期繰越損益金（G）	327,672,653
追加信託差損益金	265,234,087
（配当等相当額）	（ 26,486,268）
（売買損益相当額）	（ 238,747,819）
分配準備積立金	62,444,006
繰越損益金	△ 5,440

- (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	54,700,792
(c) 収益調整金	265,234,087
(d) 分配準備積立金	7,743,214
(e) 当期分配対象額（a+b+c+d）	327,678,093
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e-f）	327,678,093
(h) 受益権総口数	3,348,730,912口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2018年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2019年6月17日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を186～197ページに併せて掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

（2018年6月16日から2019年6月17日まで）

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2029/2/15	734,613	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.625% 2020/2/15	479,739
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2028/11/15	724,869	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/11/30	466,429
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) 3.375% 2019/11/15	448,780
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2021/4/30	600,890	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) 2.875% 2028/5/15	567,325	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) 2.625% 2021/6/15	555,205	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.75% 2019/10/25	439,441
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2049/2/15	512,864	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2020/1/31	434,765
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.375% 2048/11/15	507,113	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2020/5/15	431,651
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2048/8/15	463,906	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.5% 2020/4/25	427,619
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2023/10/31	449,830	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2019/9/30	382,988

(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、2019年6月17日現在における外国債券インデックスマザーファンド（62,737,394千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB格以下組入率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
作成期	2019年6月17日現在								
	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%	
アメリカ	728,495	752,838	81,803,400	46.7	—	19.9	17.5	9.2	
カナダ	千カナダ・ドル 37,208	千カナダ・ドル 41,013	3,322,082	1.9	—	0.9	0.5	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 40,609	千オーストラリア・ドル 46,401	3,467,590	2.0	—	1.3	0.4	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 8,333	千シンガポール・ドル 8,742	692,961	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
イギリス	千イギリス・ポンド 63,168	千イギリス・ポンド 81,416	11,133,679	6.4	—	4.9	0.8	0.6	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 40,671	千デンマーク・クローネ 53,887	879,448	0.5	—	0.4	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,082	千ノルウェー・クローネ 33,445	417,736	0.2	—	0.1	0.1	0.1	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 46,615	千スウェーデン・クローネ 53,287	610,139	0.3	—	0.2	0.1	0.1	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 249,388	千メキシコ・ペソ 252,178	1,429,851	0.8	—	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 29,529	千マレーシア・リンギット 30,283	788,287	0.4	—	0.3	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 140,977	千南アフリカ・ランド 128,269	942,780	0.5	—	0.5	0.0	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 34,677	千ポーランド・ズロチ 36,168	1,035,498	0.6	—	0.2	0.3	0.1	
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 8,738	千ユーロ 10,018	1,220,954	0.7	—	0.5	0.1	0.1
	オランダ	千ユーロ 22,924	千ユーロ 28,115	3,426,445	2.0	—	1.3	0.6	0.1
	ベルギー	千ユーロ 28,321	千ユーロ 34,974	4,262,337	2.4	—	1.9	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 117,043	千ユーロ 141,299	17,220,199	9.8	—	6.5	2.4	1.0
	ドイツ	千ユーロ 76,845	千ユーロ 93,130	11,349,798	6.5	—	3.7	2.0	0.8
	スペイン	千ユーロ 67,402	千ユーロ 82,550	10,060,409	5.7	—	3.8	1.4	0.5
	イタリア	千ユーロ 113,474	千ユーロ 124,281	15,146,188	8.6	—	5.1	2.6	0.9
	フィンランド	千ユーロ 7,885	千ユーロ 8,770	1,068,868	0.6	—	0.4	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 16,983	千ユーロ 20,682	2,520,605	1.4	—	0.9	0.4	0.1
	小計	千ユーロ 459,615	千ユーロ 543,823	66,275,805	37.8	—	24.1	10.1	3.6
合 計	—	—	172,799,261	98.6	—	53.5	30.4	14.7	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17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)

2019年6月17日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,874	312,329	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,551	494,519	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,190	455,299	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,610	283,633	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,549	276,988	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,162	234,995	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,239	352,001	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,454	266,724	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,527	274,681	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,147	341,973	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,376	475,549	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,670	507,478	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,445	265,719	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,127	231,200	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,826	307,169	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,689	509,581	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	1,996	216,914	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,886	204,967	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,338	254,089	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,213	566,504	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,503	271,989	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,019	219,425	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,439	591,041	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,652	179,576	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,736	188,738	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,838	308,479	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,060	549,915	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	7,907	7,962	865,180	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,739	297,657	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,504	380,747	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	691	75,157	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,408	261,715	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	769	83,577	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,070	116,279	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	825	89,681	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	932	101,325	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	899	97,763	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	937	101,836	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	773	986	107,167	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,351	146,819	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,591	2,121	230,481	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,326	1,735	188,545	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	747	1,044	113,497	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	718	78,028	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	691	75,097	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,249	1,469	159,689	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,453	157,940	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,419	154,232	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,595	173,355	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	2,710	3,687	400,659	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,950	211,915	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,968	213,867	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,909	207,519	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,432	264,338	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,805	196,234	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,662	180,635	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,606	174,579	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,796	195,216	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,466	159,351	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,316	251,756	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,630	2,727	296,400	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,326	2,567	278,945	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,398	3,595	390,715	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,064	3,661	397,856	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,363	474,136	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	4,325	470,028	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,657	4,204	456,911	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,857	310,513	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,162	5,288	574,701	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,629	4,004	435,175	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,305	141,835	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,649	396,598	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,171	235,948	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,032	655,535	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,993	433,920	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,889	313,922	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,192	346,926	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,407	261,573	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,773	627,397	2025/02/15

2019年6月17日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,705	402,688	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,805	196,212	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,886	313,617	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,856	636,339	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	4,147	450,698	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,607	283,331	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,831	307,671	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	2,997	325,703	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	2,989	324,787	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,846	309,331	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,121	339,211	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,190	238,062	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,769	626,861	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,776	410,321	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,449	266,109	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,847	309,408	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,466	267,976	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,853	310,087	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,948	646,320	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,092	336,045	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	4,012	436,047	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,562	278,427	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,081	334,884	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,322	687,039	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,034	329,772	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,492	3,528	383,352	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,099	336,749	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,254	570,947	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,553	277,515	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,368	366,023	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,266	354,917	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,262	4,211	457,644	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,968	322,576	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,097	227,907	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,029	6,875	747,059	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,427	263,823	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,055	223,326	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,362	365,374	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,674	290,630	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,480	269,503	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,464	267,787	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,946	320,171	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,423	589,334	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,246	352,760	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,642	395,790	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,645	396,136	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,715	295,087	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,355	255,975	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,457	267,002	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,995	325,506	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,506	598,377	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,959	321,546	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,477	269,164	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,350	3,541	384,770	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,519	273,774	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,395	260,252	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,009	218,304	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,543	276,360	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,340	5,438	590,984	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,013	327,449	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,523	274,211	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	3,839	417,217	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,013	327,498	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,328	253,001	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,550	5,618	610,553	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,906	315,775	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,855	636,245	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	3,786	411,476	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,004	326,514	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,019	328,118	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,994	325,367	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,014	218,932	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,700	2,686	291,879	2020/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,995	325,442	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,416	262,533	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,000	1,989	216,131	2020/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,002	652,210	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,300	1,292	140,468	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,904	315,580	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,037	330,028	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,800	3,914	425,295	2047/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

2019年6月17日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,180	345,563	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,000	217,387	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,500	2,482	269,748	2020/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,504	272,136	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,442	374,032	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,000	995	108,197	2020/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,514	273,198	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,591	607,574	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,100	3,193	346,951	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,566	387,497	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,600	3,590	390,182	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,998	217,157	2020/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,238	351,919	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,300	1,324	143,939	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,303	250,297	2021/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,566	387,589	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,300	6,651	722,790	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,514	273,209	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,393	368,772	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,683	291,564	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,823	306,766	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,600	3,891	422,802	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,200	3,226	350,604	2021/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,970	322,793	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,014	327,520	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,500	2,522	274,056	2021/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,900	4,318	469,261	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,932	753,300	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,000	3,042	330,576	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,584	280,858	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,000	217,420	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,400	1,405	152,770	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,002	217,598	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,586	281,070	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	5,000	5,077	551,677	2021/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,576	279,989	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,300	3,315	360,313	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,142	341,437	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,352	364,275	2021/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,322	361,055	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,589	281,410	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,000	6,402	695,706	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,200	4,543	493,735	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,547	276,857	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,637	286,547	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,518	273,695	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,731	405,508	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,772	409,936	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	3,572	388,136	2021/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,300	3,334	362,371	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,657	288,774	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,126	339,755	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,070	333,656	2021/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,658	288,902	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,300	3,341	363,045	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,172	453,346	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,097	445,284	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	6,400	6,969	757,302	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,400	5,111	555,384	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,528	274,779	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,169	344,391	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,132	340,342	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,800	2,855	310,296	2021/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,000	1,008	109,597	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	1,500	1,562	169,776	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,583	280,774	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,000	2,033	221,012	2022/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,907	750,546	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,052	331,671	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,028	329,047	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,114	447,066	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,604	283,023	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,600	4,985	541,697	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,030	329,275	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,586	281,049	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,378	367,119	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,554	386,204	2022/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,547	276,762	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,700	3,744	406,830	2022/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,430	372,746	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,300	1,376	149,534	2049/05/15

2019年6月17日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,500	1,537	167,064	2029/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,565	387,379	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,875	312,471	2026/04/30	
通貨小計	銘柄数	244銘柄						
	金 額			728,495	752,838	81,803,400		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	425	572	46,340	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	575	46,646	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,370	111,020	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,719	139,264	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,689	136,812	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,935	156,784	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,876	1,908	154,625	2020/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	990	80,216	2021/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,821	147,539	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	2,162	175,147	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,260	102,124	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,484	120,206	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,197	1,487	120,478	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,215	98,447	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,831	1,813	146,881	2020/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,137	92,144	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,837	1,816	147,121	2021/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,480	1,460	118,279	2021/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,202	97,386	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	820	66,499	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,384	112,146	2022/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,258	101,909	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,623	131,524	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	616	49,917	2023/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	550	592	47,982	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	300	300	24,377	2020/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,100	1,182	95,769	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,200	2,214	179,409	2020/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	600	625	50,647	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	303	24,621	2021/02/01	
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,050	1,057	85,624	2021/05/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,000	1,008	81,693	2024/09/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	401	32,490	2021/08/01		
通貨小計	銘柄数	33銘柄						
	金 額			37,208	41,013	3,322,082		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,636	197,039	2021/05/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,473	184,849	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,418	180,734	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,261	243,706	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,671	199,675	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,304	2,701	201,868	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,698	3,021	225,771	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,358	1,862	139,209	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,417	255,399	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,461	109,220	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	644	48,187	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,216	165,667	2020/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	712	884	66,075	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,672	2,978	222,615	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,078	2,236	167,111	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,517	113,417	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,845	137,895	2021/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,800	3,141	234,752	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	750	781	58,422	2022/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	2,150	160,696	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,570	1,743	130,325	2030/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	290	333	24,947	2041/05/21	
	通貨小計	銘柄数	22銘柄					
		金 額			40,609	46,401	3,467,590	
	シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	708	56,173	2020/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	862	68,347	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	457	36,239	2022/09/01
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.0000	623	660	52,381	2024/09/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	359	388	30,759	2030/09/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.2500	495	500	39,649	2021/06/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	400	428	33,939	2042/04/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	491	510	40,465	2023/07/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.3750	468	537	42,581	2033/09/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	125	135	10,714	2029/07/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.3750	524	541	42,923	2025/06/01	

外国債券インデックスマザーファンド

2019年6月17日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	224	17,796	2020/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	568	603	47,814	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	255	20,215	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	460	455	36,096	2021/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	200	15,871	2022/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	300	300	23,853	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	200	15,867	2023/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	580	46,033	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	190	192	15,235	2024/02/01
通貨小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			8,333	8,742	692,961	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,312	316,282	2020/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,821	1,971	269,660	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,512	343,593	2021/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,351	321,627	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,547	211,623	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,300	1,297	177,437	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,210	1,227	167,916	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,200	1,283	175,537	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,430	1,594	218,060	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,110	2,191	299,717	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,000	2,012	275,165	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	2,300	2,461	336,548	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	930	1,037	141,853	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	600	610	83,503	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	70	75	10,300	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	340	362	49,621	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,262	172,694	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,397	191,107	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,858	254,179	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,832	250,569	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,956	404,281	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,321	317,416	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	3,116	426,146	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,417	467,313	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,587	217,126	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,596	2,587	353,897	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,330	1,881	257,283	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,588	354,017	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,888	258,311	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,510	206,607	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,310	1,917	262,210	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,374	2,510	343,245	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	1,862	254,658	2020/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,422	331,267	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	803	859	117,525	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	2,196	300,402	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,326	318,194	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,966	2,706	370,153	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,075	283,887	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,873	392,891	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,392	1,543	211,110	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	3,061	418,722	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	42銘柄					
	金 額			63,168	81,416	11,133,679	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	11,512	21,856	356,701	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	7,550	8,230	134,317	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,309	86,655	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	7,363	8,460	138,075	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,510	138,887	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,520	24,810	2020/11/15
通貨小計	銘柄数	6銘柄					
	金 額			40,671	53,887	879,448	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,345	91,749	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,204	5,369	67,070	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,437	55,418	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,500	43,717	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,391	42,359	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,557	44,427	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,680	45,966	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,100	2,163	27,028	2029/09/06
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			32,082	33,445	417,736	



2019年6月17日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	9,095	9,842	112,692	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	6,488	74,295	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,498	108,760	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,660	87,711	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,095	5,972	68,389	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	6,194	70,932	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,550	4,890	56,001	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,738	31,356	2029/11/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金額		46,615	53,287	610,139		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	15,290	13,818	78,351	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	7,000	7,036	39,895	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	9,894	56,101	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,800	4,888	27,715	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	20,633	20,949	118,782	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	24,534	139,111	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	24,168	23,997	136,065	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	10,700	60,670	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	14,344	15,177	86,056	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	12,194	12,917	73,242	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	18,950	107,448	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	27,193	154,187	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,042	73,950	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	24,599	23,860	135,286	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	18,654	18,296	103,742	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	6,921	39,243	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金額		249,388	252,178	1,429,851		
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	563	14,676	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	820	21,348	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,241	32,328	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,946	50,665	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,580	41,127	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,342	34,942	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	875	22,795	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	739	19,244	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	627	16,334	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,003	26,132	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,403	36,532	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,186	1,180	30,724	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	660	17,195	2020/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	648	16,870	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,091	28,418	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	869	22,641	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	750	19,543	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	703	18,312	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,175	30,597	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	837	21,789	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	710	18,504	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	968	25,205	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	658	17,148	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	354	9,220	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	506	13,192	2022/03/10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	768	20,005	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	890	898	23,379	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050	1,130	29,414	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,201	1,221	31,798	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	500	505	13,161	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	700	747	19,469	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	400	437	11,377	2038/06/08
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	250	254	6,616	2026/07/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	410	415	10,815	2029/08/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	600	643	16,757	2048/07/06	
通貨小計	銘柄数	35銘柄					
	金額		29,529	30,283	788,287		
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	19,434	21,684	159,380	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,612	8,370	61,519	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,639	34,102	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,213	45,670	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	9,999	8,409	61,807	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	7,439	7,524	55,302	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	20,052	17,740	130,391	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	11,021	9,859	72,464	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	11,862	10,985	80,746	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	11,944	10,624	78,090	2044/01/31

外国債券インデックスマザーファンド

2019年6月17日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	10,743	9,841	72,338	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	6,166	5,764	42,372	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	7,179	6,611	48,593	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額			140,977	128,269	942,780	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,599	74,411	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,431	98,254	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,146	61,456	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	3,059	87,589	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,908	83,265	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,358	67,516	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,850	2,919	83,577	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	300	295	8,456	2020/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,190	2,246	64,317	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	750	775	22,202	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	800	777	22,247	2021/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,074	30,773	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,370	67,869	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,188	34,018	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,225	2,421	69,313	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,750	2,837	81,224	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,759	79,004	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	17銘柄					
	金 額			34,677	36,168	1,035,498	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,494	182,111	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	821	100,175	2020/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	586	71,447	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	715	87,182	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	924	112,691	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	533	65,064	2022/03/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	781	952	116,024	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,152	140,466	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	627	76,463	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	—	50	50	6,178	2022/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	532	64,950	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	700	760	92,712	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	200	220	26,843	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	323	39,443	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	300	321	39,198	2050/05/15
国小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			8,738	10,018	1,220,954	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	709	86,499	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,857	226,413	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,252	274,558	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	916	111,737	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,197	145,898	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,549	2,730	332,773	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,583	192,948	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,568	191,093	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,552	189,166	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,518	184,998	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,249	2,034	247,901	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,708	208,248	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,344	163,817	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,418	172,850	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,220	148,702	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,200	1,297	158,132	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	819	99,877	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,150	1,247	152,033	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	723	88,193	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	400	415	50,598	2040/01/15
国小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			22,924	28,115	3,426,445	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,490	181,610	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,124	1,213	147,876	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	669	81,638	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,389	169,307	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	944	1,073	130,832	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	440	558	68,023	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	490	504	61,445	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,497	182,479	2027/06/22

2019年6月17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	0.5000	650	679	82,765	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	460	592	72,198	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	336	41,015	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,140	1,217	148,344	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	550	608	74,175	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	800	858	104,683	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	402	48,994	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,528	308,158	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,843	346,512	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	990	120,667	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,832	223,333	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,805	341,849	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,607	195,927	2021/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,322	161,197	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,526	186,056	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	990	120,724	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,488	181,429	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	853	1,403	171,063	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,732	211,190	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	810	98,835	2034/06/22
国小計	銘柄数	28銘柄					
	金 額			28,321	34,974	4,262,337	
ユーロ (フランス)				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,333	162,459	2023/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	4,247	517,653	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,023	4,651	566,910	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,815	586,877	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,459	4,079	497,214	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,364	2,538	309,401	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,494	425,831	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,624	4,242	517,069	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,097	4,959	604,459	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,084	5,443	663,411	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	2,251	274,410	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,971	483,965	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,245	395,501	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	4,150	4,531	552,214	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	4,006	488,294	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,199	3,971	484,006	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	2,952	359,760	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,438	3,780	460,712	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,652	445,070	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,500	426,652	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,087	5,122	624,311	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,399	3,799	463,012	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,292	3,456	421,255	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,601	2,818	343,442	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,220	270,631	2020/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,420	5,070	617,897	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,737	3,927	478,659	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,269	2,513	306,304	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	887	1,050	128,059	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,770	2,803	341,644	2021/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,800	2,889	352,155	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,070	496,025	2022/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,420	1,698	207,046	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,725	332,095	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,250	2,828	344,728	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,449	298,489	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,100	4,383	534,223	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,425	295,632	2021/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,550	1,726	210,425	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,100	2,241	273,163	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,449	298,580	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	406	49,508	2022/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	800	896	109,250	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,248	152,140	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	407	49,633	2025/03/25
国小計	銘柄数	45銘柄					
	金 額			117,043	141,299	17,220,199	
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,284	156,564	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,367	2,141	260,953	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,076	253,003	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,250	1,836	223,870	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,617	197,102	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,417	294,671	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	3,061	373,111	2034/07/04

外国債券インデックスマザーファンド

2019年6月17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	4.0000	2,071	3,501	426,773	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,226	271,292	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,739	333,906	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,001	243,957	2020/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,374	2,321	282,959	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,495	182,246	2020/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,451	298,706	2021/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,810	220,596	2021/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,508	183,855	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	3,002	365,939	2022/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,390	291,280	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,338	3,617	440,812	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,762	214,753	2022/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,524	185,769	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,974	240,578	2023/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,779	216,816	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,737	211,698	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,409	3,804	463,714	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,762	214,792	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,671	203,733	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,329	283,872	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,340	285,248	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,316	282,331	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,948	359,305	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,685	205,420	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,471	301,228	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,350	1,700	207,218	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	1,613	196,621	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,577	192,296	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,700	1,784	217,494	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	805	98,115	2020/06/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	350	352	43,003	2020/09/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	707	86,170	2020/12/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	404	49,337	2021/03/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,465	178,643	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,598	194,758	2021/04/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,423	173,428	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,160	1,183	144,181	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,148	261,820	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	730	749	91,296	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	925	112,804	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,050	1,080	131,739	2024/04/05
国小計	銘柄数	49銘柄					
	金額			76,845	93,130	11,349,798	
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,352	3,589	437,424	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,908	232,589	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,348	286,208	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	2,028	247,164	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,650	1,679	204,636	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,946	237,235	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,788	217,933	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,452	1,911	232,897	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	950	1,412	172,114	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,730	1,868	227,727	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	2,080	2,122	258,620	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,973	240,482	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,450	1,734	211,392	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,242	273,232	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,300	1,308	159,489	2021/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,000	1,023	124,749	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,100	2,290	279,121	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	850	1,080	131,667	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,400	1,429	174,229	2023/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,200	1,305	159,116	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,200	1,210	147,539	2021/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,900	2,074	252,786	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	800	896	109,215	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	400	406	49,554	2024/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	3,230	393,674	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,493	303,927	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,308	2,200	268,125	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,066	251,869	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,873	3,105	378,488	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,807	342,155	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,802	219,675	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,790	340,132	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,761	336,555	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,298	280,124	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,140	382,764	2023/01/31

2019年6月17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	4.4000	1,901	2,280	277,903	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,538	309,364	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,499	2,696	328,577	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,346	285,925	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,412	294,013	2024/10/31
国小計	銘柄数	40銘柄					
	金額			67,402	82,550	10,060,409	
ユーロ (イタリア)				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,462	178,270	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,513	184,505	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,205	390,697	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,897	231,197	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,468	178,953	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,649	200,983	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,668	203,396	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,617	197,068	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	1,918	233,830	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,524	185,746	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	779	94,987	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,343	163,690	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,338	285,013	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,786	1,763	214,954	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,675	204,236	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	867	105,769	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,568	1,507	183,658	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	681	83,114	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,350	164,552	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	648	578	70,512	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,700	1,673	203,982	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	2,010	2,046	249,385	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,322	161,190	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,250	1,261	153,699	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	970	973	118,645	2020/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,450	1,526	186,043	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,300	1,306	159,264	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,700	1,694	206,563	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,200	1,190	145,122	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	1,900	1,902	231,867	2020/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,200	1,204	146,739	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,500	182,852	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	900	892	108,729	2023/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,284	156,496	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,500	1,491	181,788	2021/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,550	1,633	199,078	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,400	1,462	178,253	2023/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,100	1,146	139,770	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	700	726	88,543	2021/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,000	1,074	130,917	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	850	938	114,419	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,050	1,049	127,948	2022/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	1,063	129,612	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	500	504	61,448	2024/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	500	506	61,725	2026/07/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,454	3,106	378,582	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,872	471,896	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,655	2,236	272,590	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,197	389,659	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,231	393,804	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	2,918	355,689	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,034	2,627	320,156	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,562	312,244	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,497	304,362	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,625	319,917	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,318	282,523	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,417	294,629	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,269	276,556	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,486	303,084	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,235	272,395	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,888	230,139	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,185	266,318	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,951	359,708	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,125	259,062	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,413	1,783	217,329	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,492	303,800	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,836	223,779	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,435	296,843	2024/09/01

外国債券インデックスマザーファンド

2019年6月17日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	千ユーロ 1,938	千ユーロ 2,140	千円 260,888	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,649	200,990	2021/12/15
国小計	銘柄数	70銘柄					
	金 額			113,474	124,281	15,146,188	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	千ユーロ 432	千ユーロ 437	53,295	2020/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	442	53,873	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	300	36,571	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	432	52,712	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	24,895	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	200	239	29,169	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	770	782	95,400	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	315	38,448	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	412	50,329	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	525	64,000	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	522	63,711	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	845	103,077	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	493	60,176	2021/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	489	59,598	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	655	79,928	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	481	58,638	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	597	72,800	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	592	72,240	2024/04/15
国小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			7,885	8,770	1,068,868	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	千ユーロ 873	千ユーロ 958	116,805	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,206	146,996	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	534	637	77,711	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	150	180	22,030	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	918	111,951	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	580	610	74,407	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	440	676	82,384	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	407	49,656	2022/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,000	1,072	130,714	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	300	313	38,231	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,256	153,136	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,308	159,426	2020/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,462	178,183	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,273	2,075	252,972	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,182	144,053	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	893	108,937	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	991	120,886	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	650	79,279	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	986	120,255	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,053	128,432	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	803	97,980	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,035	126,173	2024/10/21
国小計	銘柄数	22銘柄					
	金 額			16,983	20,682	2,520,605	
通貨小計	銘柄数	307銘柄					
	金 額			459,615	543,823	66,275,805	
合 計	銘柄数	771銘柄					
	金 額					172,799,261	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17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

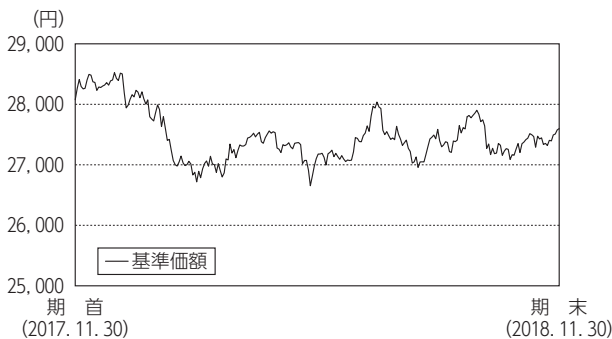
## 大和投資信託

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、長期間を中心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。

#### ◆前作成期末における「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(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	%	(ベンチマーク)	%		
(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。

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	7 ( 7)
(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 ( — )
	国	デンマーク	千デンマーク・クローネ 4,310
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 ( — )

■ 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	
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。

		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 ( — )	
	国	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。



■組入資産明細表

(1)外国(外貨建) 公社債(通貨別)

区 分	額 面 金 額	当 期			末				
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 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	
ユ	アイルランド	千ユーロ 8,673	千ユーロ 9,523	1,230,284	0.7	—	0.5	0.1	0.1
	オランダ	千ユーロ 22,798	千ユーロ 26,808	3,463,419	2.0	—	1.3	0.6	0.2
	ベルギー	千ユーロ 26,571	千ユーロ 31,303	4,044,133	2.4	—	1.8	0.5	0.1
	フランス	千ユーロ 113,965	千ユーロ 131,955	17,047,346	10.1	—	6.3	2.6	1.2
イ	ドイツ	千ユーロ 76,121	千ユーロ 89,090	11,509,642	6.8	—	4.0	1.9	0.9
	スペイン	千ユーロ 66,328	千ユーロ 76,226	9,847,645	5.8	—	3.8	1.3	0.7
ロ	イタリア	千ユーロ 109,311	千ユーロ 114,286	14,764,662	8.7	—	4.9	2.8	1.0
	フィンランド	千ユーロ 7,817	千ユーロ 8,443	1,090,767	0.6	—	0.4	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 16,583	千ユーロ 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	当 期		償 還 年 月 日
					末		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	千アメリカ・ドル 4,020	千アメリカ・ドル 4,044	千円 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

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		額	
					外 貨 建 金 額	千 円		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	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	
	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	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		額	
					外 貨 建 金 額	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	1.8750	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	
	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	
	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	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		外 貨 換 算 金 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	2.7500	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	
	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	246銘柄						
	金 額			692,133	675,826	76,686,011		
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	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	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
	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	
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,634	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				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	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				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,327	337,466	2020/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,821	1,934	280,567	2025/09/01
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,517	365,012	2021/01/22
	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

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					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	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	2.242	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	
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

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				%	千メキシコ・ペソ	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
						千メキシコ・ペソ	千円	
		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
		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
		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

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	
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	千ポーランド・ズロチ 2,591	千ポーランド・ズロチ 2,668	千円 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
		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	
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	千ユーロ 985	千ユーロ 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



区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 間	末			償 還 年 月 日
					額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	千 円	
			%	千ユーロ	千ユーロ			
	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	
	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	45銘柄						
	金 額			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	
	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	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	千 円	邦 貨 換 算 金 額	
					千 ユーロ	千 ユーロ	千 円	
	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 金 額	49銘柄		76,121	89,090	11,509,642		
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ			
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,352	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	
	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 金 額	40銘柄		66,328	76,226	9,847,645		
ユーロ (イタリア)				千ユーロ	千ユーロ			
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,446	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	153,028	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	

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	
	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
	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	
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	
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
	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

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	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
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 A694,267,908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)26,063,629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)173,213,023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)53,368,772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)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30 739,083,378円、ダイワ・ライフ・バランス50 367,446,516円、ダイワ・ライフ・バランス70 237,136,801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40V A249,101,467円、ダイワ世界バランスファンド60V A154,628,203円、ダイワ・バランスファンド35V A5,694,073,062円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50V A17,320,918円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75V A8,186,659円、ダイワ・バランスファンド25V 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25 35,273,760円、ダイワライフスタイル50 62,560,835円、ダイワライフスタイル75 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。

# ダイワファンドラップ 外国債券インデックス 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3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17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、分配を行な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)

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

<2733>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配) 円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %			
1 期末(2017年 6 月15日)	10,747	0	7.5	98.3	—	百万円 599
2 期末(2018年 6 月15日)	10,746	0	△ 0.0	98.1	—	1,195
3 期末(2019年 6 月17日)	11,026	0	2.6	98.0	—	1,344

(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。

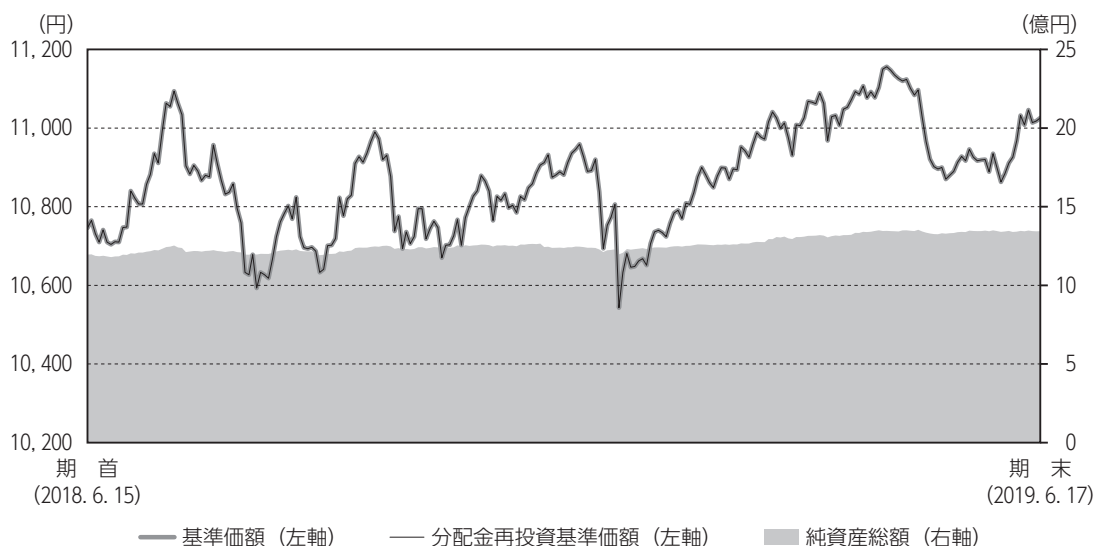
(注 4) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

(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：10,746円

期末：11,026円(分配金0円)

騰落率：2.6%(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	3.0%	79.8%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	3.2%	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、為替市場で円高が進んだものの、利息収入を得たことや債券市場で金利が低下(債券価格は上昇)したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		
(期首)2018年6月15日	10,746	—	98.1	—
6月末	10,748	0.0	97.7	—
7月末	10,876	1.2	97.8	—
8月末	10,724	△ 0.2	97.6	—
9月末	10,966	2.0	97.5	—
10月末	10,767	0.2	97.6	—
11月末	10,906	1.5	97.4	—
12月末	10,806	0.6	98.0	—
2019年1月末	10,806	0.6	97.7	—
2月末	10,972	2.1	97.7	—
3月末	11,048	2.8	97.7	—
4月末	11,029	2.6	98.0	—
5月末	10,899	1.4	97.8	—
(期末)2019年6月17日	11,026	2.6	98.0	—

(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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■ 海外債券市況

海外の債券市場では、当作成期を通して金利は低下しました。

先進国では、当作成期首より、金利はおおむねレンジ内での推移となりました。2018年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。しかし10月以降は、株価や原油価格が下落し市場のリスク回避姿勢が強まる場面が見られたことや、F R B (米国連邦準備制度理事会) が利上げを一時停止する姿勢を示したことなどを受けて、金利は低下傾向となりました。その後も、米中の貿易摩擦や世界的な景気減速への懸念、また米国の利下げ観測の高まりなどが、金利の低下要因となりました。

新興国でもおおむね先進国と同様の動きとなり、一部の国を除き金利は低下しました。

### ■ 為替相場

為替相場は、当作成期を通して円高となりました。

先進国では、当作成期首より、米ドルが利上げ観測の高まりなどから上昇しました。2018年9月中旬以降は、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。12月以降は、株価や原油価格が急落する中で市場のリスク回避姿勢が強まり、円高が進行しました。しかし2019年1月に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり市場のリスク選好姿勢が回復したことなどから、米ドルを中心に上昇に転じました。4月以降は、米中の貿易摩擦への懸念などから、円高が進行しました。その後も、世界的な景気減速への懸念や米国の利下げ観測の高まりなどが、円高の要因となりました。

新興国でもおおむね先進国と同様の動きとなり、円高新興国通貨安となりました。



## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「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 (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。

### ■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・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)) に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## ポートフォリオについて

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■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少額であったため、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	
	2018年6月16日 ~2019年6月17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)		1,025

(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 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	46円	0.423%	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10,869円です。
(投信会社)	(32)	(0.293)	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)	(12)	(0.109)	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	0.058	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)	(0.050)	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	52	0.482	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

	設 定		解 約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	52,414	69,127	32,547	43,350
外国債券インデックスマザーファンド	76,945	212,029	46,132	127,316

(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	千円	口数	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	179,670		199,537	270,113
外国債券インデックスマザーファンド	353,339		384,151	1,073,127

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	270,113	20.0
外国債券インデックスマザーファンド	1,073,127	79.5
コール・ローン等、その他	5,772	0.5
投資信託財産総額	1,349,013	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1シンガポール・ドル=79.26円、1イギリス・ポンド=136.75円、1トルコ・リラ=18.39円、1デンマーク・クローネ=16.32円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローネ=11.45円、1メキシコ・ペソ=5.67円、1フィリピン・ペソ=2.09円、1アルゼンチン・ペソ=2.47円、100チリ・ペソ=15.52円、100コロンビア・ペソ=3.32円、100インドネシア・ルピア=0.76円、1ブラジル・レアル=27.88円、1チェコ・コルナ=4.77円、1ルーマニア・レイ=25.80円、1ロシア・ルーブル=1.69円、1マレーシア・リンギット=26.03円、1南アフリカ・ランド=7.35円、1タイ・バーツ=3.48円、1ペルー・ソル=32.46円、1ポーランド・ズロチ=28.63円、100ハンガリー・フォリント=37.80円、1ウルグアイ・ペソ=3.08円、1ユーロ=121.87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(12,451,323千円)の投資信託財産総額(12,626,991千円)に対する比率は、98.6%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(174,318,188千円)の投資信託財産総額(175,280,413千円)に対する比率は、99.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項目	当期末
(A) 資産	1,349,013,087円
コール・ローン等	4,010,802
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	270,113,362
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,073,127,310
未収入金	1,761,613
(B) 負債	4,525,999
未払解約金	1,751,509
未払信託報酬	2,721,693
その他未払費用	52,797
(C) 純資産総額(A-B)	1,344,487,088
元本	1,219,423,623
次期繰越損益金	125,063,465
(D) 受益権総口数	1,219,423,623口
1万口当り基準価額(C/D)	11,026円

- \*期首における元本額は1,112,542,866円、当作成期間中における追加設定元本額は364,448,905円、同解約元本額は257,568,148円です。  
 \*当期末の計算口数当りの純資産額は11,026円です。

<補足情報>

当ファンド(ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし))が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日(2018年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2019年6月17日)現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。186~197ページをご参照ください。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項目	当期
(A) 配当等収益	6,872円
その他収益金	9,051
支払利息	△ 2,179
(B) 有価証券売買損益	35,145,545
売買益	38,805,929
売買損	△ 3,660,384
(C) 信託報酬等	△ 5,445,191
(D) 当期損益金(A+B+C)	29,707,226
(E) 前期繰越損益金	△ 6,727,339
(F) 追加信託差損益金	102,083,578
(配当等相当額)	( 23,458,194)
(売買損益相当額)	( 78,625,384)
(G) 合計(D+E+F)	125,063,465
次期繰越損益金(G)	125,063,465
追加信託差損益金	102,083,578
(配当等相当額)	( 23,458,194)
(売買損益相当額)	( 78,625,384)
分配準備積立金	22,979,887

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。  
 (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。  
 (注3) 収益分配金の計算過程は下記「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	5,783円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	12,330,655
(c) 収益調整金	102,083,578
(d) 分配準備積立金	10,643,449
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	125,063,465
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	125,063,465
(h) 受益権総口数	1,219,423,623口

★「外国債券インデックスマザーファンド」の第19期にかかる運用状況については198~212ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（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（2019年6月17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219～223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

(2018年6月16日から2019年6月17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	153,255	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1	187,216
Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2024/4/25	103,150	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/1/1	99,865
Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2031/5/29	82,518	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2020/6/11	96,322
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/7/1	81,275	Poland Government Bond (ポーランド) 1.5% 2020/4/25	64,024
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21	81,242	Thailand Government Bond (タイ) 2.55% 2020/6/26	63,804
Colombian TES (コロンビア) 6% 2028/4/28	77,072	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/4/1	60,982
Colombian TES (コロンビア) 6.25% 2025/11/26	71,140	Mexican Bonos (メキシコ) 5% 2019/12/11	53,765
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.25% 2029/5/15	71,130	Peru Government Bond (ペルー) 7.84% 2020/8/12	53,754
Poland Government Bond (ポーランド) 2.75% 2028/4/25	69,216	Colombian TES (コロンビア) 7% 2019/9/11	48,022
Mexican Bonos (メキシコ) 7.5% 2027/6/3	67,678	MALAYSIAN GOVERNMENT (マレーシア) 4.378% 2019/11/29	42,910

(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、2019年6月17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（9,313,186千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2019年6月17日現在							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB/B格以下組入率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	%	%	%	%	%
トルコ	31,160	23,807	437,815	3.5	—	1.2	1.9	0.4
メキシコ	203,250	206,017	1,168,116	9.3	—	6.3	2.0	1.0
フィリピン	15,000	15,075	31,506	0.2	—	—	—	0.2
アルゼンチン	22,900	15,043	37,156	0.3	0.3	0.2	0.1	—
チリ	2,425,000	2,762,905	428,802	3.4	—	2.5	0.3	0.6
コロンビア	24,080,000	26,093,010	866,287	6.9	—	5.0	1.2	0.7
インドネシア	157,949,000	160,625,612	1,220,754	9.7	—	6.7	2.7	0.3
ブラジル	44,450	43,843	1,222,363	9.7	—	2.5	4.2	2.9
チェコ	106,000	110,714	528,109	4.2	—	2.7	1.2	0.3
ルーマニア	11,040	11,258	290,477	2.3	—	0.5	1.4	0.4
ロシア	578,410	579,013	978,532	7.8	—	4.8	2.8	0.2
マレーシア	28,520	29,080	756,961	6.0	—	3.8	1.9	0.4
南アフリカ	148,590	135,708	997,460	7.9	—	7.3	0.6	—
タイ	287,960	311,065	1,082,506	8.6	—	5.4	3.2	—
ペルー	11,900	13,621	442,147	3.5	—	3.5	—	—
ポーランド	37,050	38,393	1,099,209	8.7	—	2.9	4.4	1.4
ハンガリー	1,191,300	1,326,486	501,411	4.0	—	1.8	1.6	0.5
ウルグアイ	8,100	7,597	23,401	0.2	—	0.1	0.1	—
合 計	—	—	12,113,022	96.1	0.3	57.2	29.7	9.1

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17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)

2019年6月17日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	千トルコ・リラ 1,660	千トルコ・リラ 1,303	千円 23,972	2022/01/12
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	586	10,777	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	1,878	34,552	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	1,390	974	17,925	2023/09/27
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	498	9,174	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,129	20,764	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	1,490	970	17,839	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	9.4000	1,180	1,036	19,057	2020/07/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,610	1,367	25,157	2021/02/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	1,904	35,023	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	9.2000	2,010	1,614	29,695	2021/09/22
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	1,935	35,601	2022/03/02
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,198	40,422	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,490	27,416	2022/08/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	1,700	1,187	21,837	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,134	20,854	2023/01/18
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	1,000	786	14,456	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	2,000	1,810	33,287	2023/06/14
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			31,160	23,807	437,815	
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 9,399	53,293	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	9,500	9,549	54,143	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	9,894	56,101	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	16,250	16,499	93,549	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	18,350	20,354	115,407	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	23,230	23,065	130,784	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	8,910	50,524	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	11,230	11,882	67,374	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	14,100	14,936	84,691	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	21,950	21,451	121,627	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,950	22,998	130,401	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	19,450	18,865	106,968	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	11,320	11,103	62,955	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,130	7,106	40,294	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			203,250	206,017	1,168,116	
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 15,075	31,506	2021/01/15
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			15,000	15,075	31,506	
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 3,058	7,555	2021/10/03
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	1,400	917	2,266	2023/10/17
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	16,800	11,066	27,334	2026/10/17
通貨小計	銘柄数	3銘柄					
	金 額			22,900	15,043	37,156	
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 425,000	千チリ・ペソ 439,267	68,174	2021/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	470,000	509,188	79,026	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	500,000	587,385	91,162	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	556,874	86,426	2043/01/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	320,000	358,118	55,579	2030/09/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	260,630	40,449	2023/03/01
Chile Government International Bond	国債証券	5.5000	50,000	51,441	7,983	2020/08/05	
通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額			2,425,000	2,762,905	428,802	
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 113,070	3,753	2027/06/28
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	98,985	3,286	2021/04/14
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	43,483	1,443	2023/03/21
	Colombian TES	国債証券	11.0000	2,265,000	2,431,454	80,724	2020/07/24
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,335,000	4,583,438	152,170	2022/05/04
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,450,000	4,162,701	138,201	2024/07/24
	Colombian TES	国債証券	6.0000	3,590,000	3,586,661	119,077	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	3,310,000	3,653,015	121,280	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	3,034,152	100,733	2030/09/18
	Colombian TES	国債証券	7.0000	2,200,000	2,319,768	77,016	2032/06/30
Colombian TES	国債証券	6.2500	2,000,000	2,066,280	68,600	2025/11/26	
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			24,080,000	26,093,010	866,287	

2019年6月17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	千インドネシア・ルピア 8,250,000	千インドネシア・ルピア 8,392,395	千円 63,782	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000	4,249,840	32,298	2031/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	2,800,000	2,681,756	20,381	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	6,881,418	52,298	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	5,000,000	5,195,600	39,486	2024/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,000,000	5,117,000	38,889	2039/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	9,000,000	9,365,580	71,178	2029/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000	2,539,872	19,303	2020/11/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	1,600,000	1,773,392	13,477	2021/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	4,700,000	5,501,068	41,808	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	4,180,000	4,982,392	37,866	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	9,210,000	9,451,117	71,828	2021/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,324,321	25,264	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000	10,667,108	81,070	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	4,853,977	36,890	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	9,924,134	75,423	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	8,660,000	8,646,577	65,713	2022/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	8,910,000	8,450,422	64,223	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000	7,829,043	59,500	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	6,975,000	6,179,710	46,965	2033/05/15
Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,020,000	12,417,862	94,375	2034/03/15	
Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	13,761,212	104,585	2024/03/15	
Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	7,820,000	8,439,813	64,142	2029/03/15	
通貨小計	銘柄数 金額	23銘柄		157,949,000	160,625,612	1,220,754	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	千ブラジル・レアル 5,030	千ブラジル・レアル 5,308	148,004	2021/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	6,410	7,004	195,289	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,990	5,553	154,827	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,750	4,215	117,528	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,500	1,702	47,458	2029/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	8,340	7,858	219,105	2020/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,030	4,443	123,896	2021/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	4,000	3,404	94,903	2022/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	4,200	3,443	96,003	2022/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,200	909	25,345	2023/07/01
通貨小計	銘柄数 金額	10銘柄		44,450	43,843	1,222,363	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	千チェコ・コルナ 6,500	千チェコ・コルナ 6,677	31,849	2020/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	8,200	8,616	41,102	2021/09/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	12,600	13,652	65,120	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	10,331	49,279	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	10,200	11,201	53,431	2022/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	16,960	80,901	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	10,900	10,579	50,463	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	10,000	9,308	44,399	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	2,900	2,772	13,223	2023/10/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	8,000	7,294	34,796	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	13,320	63,540	2029/07/23
	通貨小計	銘柄数 金額	11銘柄		106,000	110,714	528,109
ルーマニア	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 1,519	39,215	2023/04/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.9500	940	981	25,317	2021/06/11
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,178	30,414	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,130	1,124	29,014	2021/03/22
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	1,200	1,314	33,924	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,071	27,638	2022/12/19
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	800	767	19,791	2024/04/29
	Romania Government Bond	国債証券	3.4000	800	790	20,391	2022/03/08
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,505	38,854	2023/06/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.0000	1,000	1,004	25,915	2021/10/27
通貨小計	銘柄数 金額	10銘柄		11,040	11,258	290,477	
ロシア	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 14,991	25,335	2021/04/14
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	41,760	43,467	73,460	2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	21,910	22,107	37,361	2022/07/20
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,277	24,129	2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	36,160	35,250	59,572	2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,300	23,984	40,533	2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	29,300	29,484	49,828	2021/08/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	24,000	25,758	43,531	2031/09/17

2019年6月17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	
			%	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル	千円	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	56,100	57,161	96,602	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	39,000	39,234	66,306	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	47,000	47,259	79,868	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	35,600	35,119	59,351	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	49,000	48,821	82,508	2021/12/15
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	31,000	29,968	50,646	2024/02/28
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	25,000	24,141	40,799	2034/05/10
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	39,000	37,352	63,125	2029/05/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	22,000	22,649	38,277	2026/10/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	28,000	27,984	47,293	2024/07/17
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			578,410	579,013	978,532	
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	2,000	2,029	52,823	2022/04/14
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,200	1,244	32,397	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,053	53,443	2023/11/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,000	1,048	27,303	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,500	1,549	40,344	2029/07/09
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,350	1,371	35,698	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,500	2,488	64,764	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,797	46,780	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,350	1,375	35,798	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	1,740	1,748	45,519	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	900	911	23,723	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,300	1,317	34,297	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,207	31,432	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,420	1,455	37,877	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,120	2,139	55,690	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,100	1,183	30,815	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,415	36,852	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,033	52,932	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	700	709	18,464	2029/08/15
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金 額			28,520	29,080	756,961	
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	10.5000	22,050	24,603	180,834	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	10,220	7,366	54,145	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	9,880	6,894	50,676	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,440	7,098	52,170	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	9,880	9,993	73,449	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	21,020	18,596	136,686	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	14,500	12,971	95,338	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	12,100	11,206	82,366	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	13,100	11,652	85,648	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	10,300	9,436	69,355	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	10,100	9,442	69,406	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	7,000	6,446	47,381	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			148,590	135,708	997,460	
タイ				千タイ・バーツ	千タイ・バーツ		
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	23,050	28,691	99,845	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	19,300	20,675	71,951	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	20,610	22,986	79,992	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	30,600	32,006	111,381	2021/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	22,700	26,062	90,697	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	21,200	21,267	74,010	2022/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	19,100	21,599	75,166	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	23,400	23,649	82,300	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	26,000	26,193	91,153	2022/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	25,000	29,016	100,977	2032/06/25
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	21,000	20,626	71,779	2046/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	14,000	14,344	49,917	2023/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	13,000	13,868	48,262	2028/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	9,000	10,077	35,069	2038/06/17
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			287,960	311,065	1,082,506	
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	1,238	40,204	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,970	2,220	72,092	2028/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	1,850	2,033	66,003	2032/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	1,900	2,089	67,824	2029/02/12
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,947	63,229	2026/08/12

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2019年6月17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	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	千ペルー・ソル 1,565	千ペルー・ソル 1,835	千円 59,573	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,920	2,255	73,220	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額			11,900	13,621	442,147	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 2,210	千ポーランド・ズロチ 2,487	71,221	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,640	3,699	105,906	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,260	2,280	65,299	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	2,230	2,236	64,019	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,890	2,928	83,845	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,252	93,126	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,072	87,976	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	2,000	1,969	56,374	2020/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,500	3,590	102,791	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	500	516	14,801	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	1,720	1,807	51,744	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,820	1,994	57,116	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,530	2,752	78,814	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,200	3,301	94,515	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,350	2,502	71,655	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			37,050	38,393	1,099,209	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	千ハンガリー・フォリント 98,500	千ハンガリー・フォリント 105,508	39,882	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	179,581	67,881	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	89,000	93,043	35,170	2021/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	143,654	54,301	2022/10/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	85,000	88,498	33,452	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	0.5000	60,000	60,162	22,741	2021/04/21
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	50,000	67,696	25,589	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	99,500	109,982	41,573	2020/11/12
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	158,146	59,779	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	147,646	55,810	2022/06/24
Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	172,567	65,230	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			1,191,300	1,326,486	501,411	
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 5,231	16,113	2022/06/20
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,366	7,287	2028/03/15
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			8,100	7,597	23,401	
合 計	銘柄数	206銘柄					
	金 額					12,113,022	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。



# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

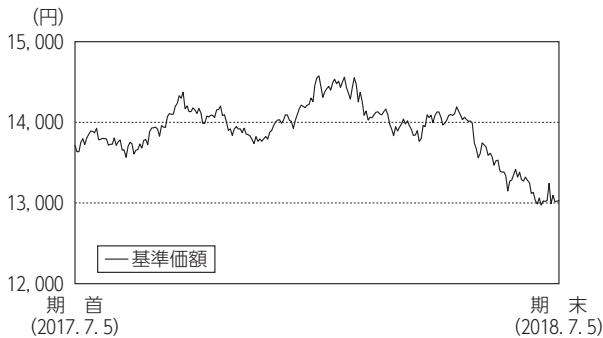
## 大和投資信託

Daiva 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の下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

#### ◆投資環境について

##### ○新興国債券市況

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

#### ◆ポートフォリオについて

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		J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算) (ベンチマーク)		公社債組入比率
	円	騰落率 %	円	騰落率 %	
(期首) 2017年7月5日	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) J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算) は、J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (米ドルベース) は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

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

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (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 ( —)	
	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 ( —)	
	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 ( —)	
	国	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 ( —)
		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	千円	銘 柄	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
トルコ	千トルコ・リラ 25,910	千トルコ・リラ 19,824	千円 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	
ペルー	千ペルー・ソル 7,210	千ペルー・ソル 7,758	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		末		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	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区分	銘柄	種類	年利率	当 期			末		償還年月日
				額面金額	評 価 額				
					外貨建金額	邦貨換算金額			
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円			
	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	
	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	16銘柄							
	金額			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	千フィリピン・ペソ				
				15,000	14,947	30,941		2021/01/15	
通貨小計	銘柄数	1銘柄							
	金額			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	千アルゼンチン・ペソ				
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	4,700	4,110	16,152		2021/10/03	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	9,400	8,470	33,289		2023/10/17	
		国債証券		7,800	7,214	28,352		2026/10/17	
通貨小計	銘柄数	3銘柄							
	金額			21,900	19,795	77,795			
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ				
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	325,000	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	5銘柄							
	金額			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	千コロンビア・ペソ				
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	90,000	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	12銘柄							
	金額			17,515,000	18,749,500	712,481			
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア				
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	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			

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		
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	千ブラジル・レアル 3,030	千ブラジル・レアル 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 金 額	10銘柄		36,400	32,046	904,358	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	千チェコ・コルナ 6,500	千チェコ・コルナ 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
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	2,900	2,736	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 金 額	12銘柄		73,900	77,219	382,238	
ルーマニア	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 金 額	9銘柄		8,210	8,184	226,137	
ロシア	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 金 額	16銘柄		388,310	389,810	678,270	
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 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

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千マレーシア・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	16銘柄					
	金 額			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	14銘柄					
	金 額			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	11銘柄					
	金 額			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
	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	7銘柄					
	金 額			7,210	7,758	260,309	
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	2,513	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	15銘柄					
	金 額			26,390	26,948	791,753	
ハンガリー				千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
	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

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	
			%	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント	千円	
	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	13銘柄					
	金 額			912,600	961,505	380,563	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	9.8750	千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		2022/06/20
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,300	2,276	8,011	2028/03/15
				2,800	2,405	8,466	
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			5,100	4,681	16,478	
合 計	銘柄数	200銘柄					
	金 額					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
	千円	%
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・リアル=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・バーツ=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。

■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、iFree 新興国債券インデックス1,371,592,775円、iFree 8資産バランス783,201,691円、DC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。

■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。

# ダイワファンドラップ J-REITインデックス

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17日)

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果を東証REIT指数（配当込み、以下同じ。）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。	
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。	

#### 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）

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

<4640>



## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数先 物率	純資産 総額
	(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 6月15日)	円 9,906	円 0	% △ 0.9	3,274.94	% △ 0.7	% 98.3	% 1.4	百万円 1,224
2 期末 (2018年 6月15日)	10,250	0	3.5	3,398.25	3.8	98.3	1.5	2,355
3 期末 (2019年 6月17日)	11,818	0	15.3	3,934.65	15.8	98.4	1.4	3,254

(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。

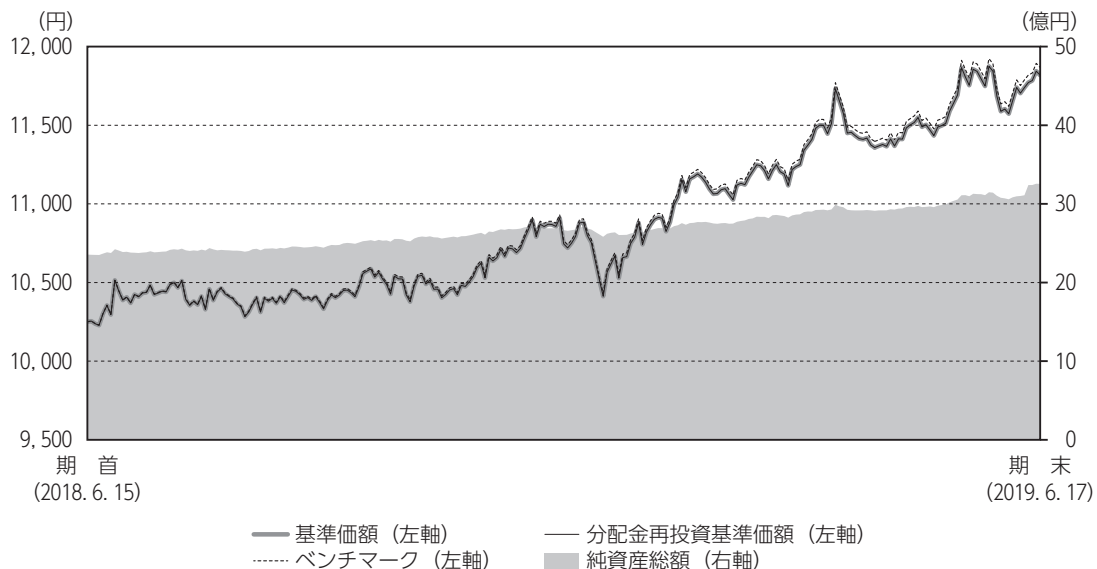
(注3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含まず。

(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：10,250円

期末：11,818円（分配金0円）

騰落率：15.3%（分配金込み）

### ■ 基準価額の変動要因

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

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6月15日	10,250	—	3,398.25	—	98.3	1.5
6月末	10,407	1.5	3,450.92	1.5	97.9	1.5
7月末	10,458	2.0	3,468.88	2.1	97.4	1.5
8月末	10,422	1.7	3,457.71	1.7	97.9	1.5
9月末	10,586	3.3	3,513.39	3.4	98.2	1.4
10月末	10,422	1.7	3,459.73	1.8	97.9	1.4
11月末	10,870	6.0	3,610.49	6.2	98.2	1.5
12月末	10,667	4.1	3,543.83	4.3	98.3	1.4
2019年1月末	11,159	8.9	3,709.11	9.1	97.9	1.4
2月末	11,213	9.4	3,728.00	9.7	97.7	1.5
3月末	11,577	12.9	3,851.10	13.3	98.1	1.5
4月末	11,490	12.1	3,822.76	12.5	98.3	1.4
5月末	11,685	14.0	3,889.57	14.5	98.5	1.4
(期末)2019年6月17日	11,818	15.3	3,934.65	15.8	98.4	1.4

(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

(2018.6.16 ~ 2019.6.17)

### 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、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、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ました。12月は、米中貿易摩擦懸念の高まりで一時下落する局面もあり、不安定な動きとなりました。2019年に入ると、公募増資等のエクイティ調達の実績が発表されたものの、米国金融政策の軟化などにより国内株式市場が反発したことや、今後の国内外での金利上昇懸念が後退したことが好感され、当作成期末にかけて上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

「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（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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を通じて行いました。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

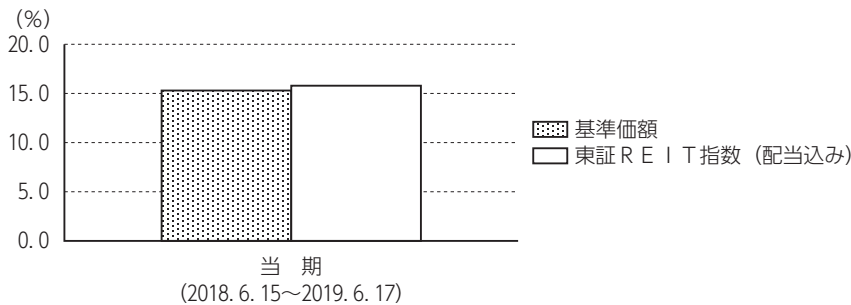
ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物含む。）については、当作成期を通じて99~100%程度としました。

## 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15.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は15.3%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったことから、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	
	2018年6月16日 ~2019年6月17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)	1,818	

- (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 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	37円	0.337%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は10,879円です。
(投信会社)	(22)	(0.206)	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)	(12)	(0.109)	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＝当期中の売買委託手数料／当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)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当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＝当期中のその他費用／当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	37	0.343	

(注1) 当期中の費用（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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

	設 定		解 約	
	口数	金額	口数	金額
ダイワ J-REIT マザーファンド	千口	千円	千口	千円
	283,653	772,522	101,220	270,771

(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期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

#### (2) マザーファンドにおける当期中の利害関係人との取引状況

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資信託証券	百万円 55,278	百万円 4,049	% 7.3	百万円 14,705	百万円 298	% 2.0
不動産投信指数先物取引	14,153	—	—	13,928	—	—
コール・ローン	584,081	—	—	—	—	—

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

種類	当 期		
	ダイワJ-REITマザーファンド		
	買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	1,021	246	5,079

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

種類	当 期	
	ダイワJ-REITマザーファンド	
	買付額	
	百万円	
投資信託証券	3,042	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	20千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	2.0%

(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	当 期 末		
	期 首	期 中	評 価 額
	千円	千円	千円
ダイワJ-REITマザーファンド	931,979	1,114,412	3,252,858

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17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	3,252,858	99.4
コール・ローン等、その他	18,557	0.6
投資信託財産総額	3,271,415	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

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,271,415,815円
コール・ローン等	15,515,511
ダイワJ-REITマザーファンド (評価額)	3,252,858,304
未収入金	3,042,000
(B) 負債	16,936,005
未払解約金	12,068,718
未払信託報酬	4,789,339
その他未払費用	77,948
(C) 純資産総額 (A - B)	3,254,479,810
元本	2,753,769,433
次期繰越損益金	500,710,377
(D) 受益権総口数	2,753,769,433口
1万口当り基準価額 (C / D)	11,818円

\* 期首における元本額は2,297,924,064円、当作成期間中における追加設定元本額は1,052,662,291円、同解約元本額は596,816,922円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,818円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,149円
受取利息	878
支払利息	△ 8,027
(B) 有価証券売買損益	366,893,169
売買益	400,204,451
売買損	△ 33,311,282
(C) 信託報酬等	△ 9,190,150
(D) 当期損益金 (A + B + C)	357,695,870
(E) 前期繰越損益金	77,712,443
(F) 追加信託差損益金	65,302,064
(配当等相当額)	( 41,004,005)
(売買損益相当額)	( 24,298,059)
(G) 合計 (D + E + F)	500,710,377
次期繰越損益金 (G)	500,710,377
追加信託差損益金	65,302,064
(配当等相当額)	( 41,004,005)
(売買損益相当額)	( 24,298,059)
分配準備積立金	435,415,462
繰越損益金	△ 7,149

(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	357,700,099
(c) 収益調整金	65,302,064
(d) 分配準備積立金	77,715,363
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	500,717,526
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	500,717,526
(h) 受益権総口数	2,753,769,433口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2019年3月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2019年6月17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237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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	4.572	3,250,735	711,009	日本ビルファンド	1.816	1,168,280	643,326
ジャパンリアルエステイト	4.721	2,960,640	627,121	ジャパンリアルエステイト	1.748	1,031,278	589,976
野村不動産マスターF	18.178	2,832,835	155,838	野村不動産マスターF	5.439	829,619	152,531
大和ハウスリート投資法人	10.107	2,570,887	254,367	日本リートファンド	3.502	721,685	206,078
GLP投資法人	20.572	2,373,960	115,397	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.137	717,360	173,401
日本リートファンド	8.923	1,938,679	217,267	オリックス不動産投資	3.522	619,115	175,785
ジャパン・ホテル・リート投資法人	22.748	1,890,087	83,088	日本プロロジスリート	2.296	518,603	225,872
API投資法人	4.032	1,885,283	467,580	日本プライムリアルティ	1.146	464,331	405,175
ユナイテッド・アーバン投資法人	10.412	1,825,165	175,294	大和ハウスリート投資法人	1.736	446,047	256,939
積水ハウス・リート投資	22.626	1,755,063	77,568	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5.09	413,226	81,183

(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、2019年6月17日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（95,580,504千口）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	2019年6月17日現在				ファンド名	2019年6月17日現在			
	口数	評価額	比率			口数	評価額	比率	
	千口	千円	%		千口	千円	%		
<b>不動産投信</b>				日本ビルファンド	27.499	20,871,741	7.5		
エスコンジャパンリート	2.915	309,573	0.1	ジャパンリアルエステイト	28.397	18,656,829	6.7		
サンケイリアルエステイト	2.807	306,805	0.1	日本リートファンド	53.669	11,705,208	4.2		
日本アコモデーションファンド投資法人	9.436	5,567,240	2.0	オリックス不動産投資	56.58	11,191,524	4.0		
MCUBS MidCity投資法人	32	3,318,400	1.2	日本プライムリアルティ	17.975	8,708,887	3.1		
森ヒルズリート	32.567	4,972,980	1.8	プレミアム投資法人	26.998	3,679,827	1.3		
産業ファンド	34.851	4,656,093	1.7	東急リアル・エステイト	19.039	3,567,908	1.3		
アドバンス・レジデンス	27.675	8,703,787	3.1	グローバル・ワン不動産投資法人	19.644	2,624,438	0.9		
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	17.554	3,245,734	1.2	ユナイテッド・アーバン投資法人	62.629	11,285,745	4.0		
API投資法人	14.918	7,078,591	2.5	森トラスト総合リート	20.295	3,559,743	1.3		
GLP投資法人	70.365	8,570,457	3.1	インヴェンシブル投資法人	97.966	5,819,180	2.1		
コンフォリア・レジデンシャル	11.776	3,591,680	1.3	フロンティア不動産投資	9.66	4,578,840	1.6		
日本プロロジスリート	38.09	9,236,825	3.3	平和不動産リート	17.684	2,233,489	0.8		
星野リゾート・リート	4.321	2,350,624	0.8	日本ロジスティクスファンド投資法人	18.554	4,605,102	1.7		
Oneリート投資法人	4.139	1,152,297	0.4	福岡リート投資法人	14.686	2,571,518	0.9		
イオンリート投資	29.148	3,987,446	1.4	ケネディクス・オフィス投資法人	8.784	6,746,112	2.4		
ヒューリックリート投資法	22.955	4,221,424	1.5	いちごオフィスリート投資法人	23.559	2,391,238	0.9		
日本リート投資法人	9.166	3,941,380	1.4	大和証券オフィス投資法人	6.554	5,079,350	1.8		
インベスコ・オフィス・Jリート	173.075	3,028,812	1.1	阪急阪神リート投資法人	12.777	1,899,939	0.7		
日本ヘルスケア投資法	1.3	226,590	0.1	スターツプロシード投資法人	4.44	774,336	0.3		
積水ハウス・リート投資	83.033	6,626,033	2.4	大和ハウスリート投資法人	38.101	9,765,286	3.5		
トーセイ・リート投資法人	5.466	641,708	0.2	ジャパン・ホテル・リート投資法人	91.405	7,952,235	2.9		
ケネディクス商業リート	10.408	2,761,242	1.0	日本賃貸住宅投資法人	31.94	2,676,572	1.0		
ヘルスケア&メディカル投資	5.948	728,630	0.3	ジャパンエクセレント投資法人	25.428	4,101,536	1.5		
サムティ・レジデンシャル	5.684	616,145	0.2						
野村不動産マスターF	88.353	14,613,586	5.2	合 計	口数、金額	1,583,881	274,642,114		
いちごホテルリート投資	4.966	634,654	0.2	銘柄数 < 比率 >	63銘柄			<98.4%>	
ラサールロジポート投資	23.463	2,984,493	1.1						
スターアジア不動産投	8.815	1,024,303	0.4						
マリモ地方創生リート	2.442	291,330	0.1						
三井不ロジパーク	6.891	2,480,760	0.9						
大江戸温泉リート	4.583	387,721	0.1						
さくら総合リート	6.144	564,633	0.2						
投資法人みらい	30.592	1,502,067	0.5						
森トラスト・ホテルリート投	6.662	926,684	0.3						
三菱地所物流REIT	3.005	822,468	0.3						
CRE ロジスティクスファンド	2.843	339,454	0.1						
ザイマックス・リート	2.619	327,898	0.1						
タカラレーベン不動産投	4.25	415,225	0.1						
伊藤忠アドバンスロジ	4.393	439,739	0.2						

(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	2019年6月17日現在	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
国内 東証REIT	3,831	—

(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30期 (決算日 2019年3月15日)

(作成対象期間 2018年9月19日～2019年3月15日)

ダイワJ-REIT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	東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」(配当込み)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
投資信託証券組入制限	無制限

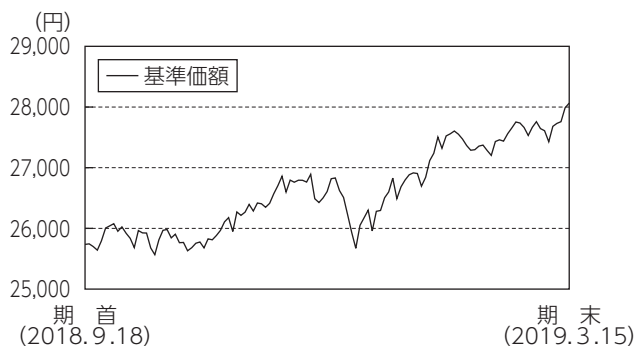
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

### ■ 当期中の基準価額と市況等の推移



### ◆ 前作成期末における「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(不動産投資指数先物を含む。)については、当期中を通じて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9.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は9.0%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。

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	不動産投資指数先物比率
	円	%	(ベンチマーク)	%		
(期首)2018年9月18日	25,737	-	3,467.41	-	98.1	1.5
9月末	26,077	1.3	3,513.39	1.3	98.4	1.4
10月末	25,679	△0.2	3,459.73	△0.2	98.1	1.4
11月末	26,795	4.1	3,610.49	4.1	98.4	1.5
12月末	26,300	2.2	3,543.83	2.2	98.4	1.4
2019年1月末	27,524	6.9	3,709.11	7.0	98.1	1.4
2月末	27,664	7.5	3,728.00	7.5	97.9	1.5
(期末)2019年3月15日	28,065	9.0	3,782.23	9.1	98.4	1.5

(注1) 騰落率は期首比。

(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) 不動産投資指数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・オプション)	0円 (0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(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。

### 《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：25,737円 期末：28,065円 騰落率：9.0%

##### 【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、国内長期金利が低下したことなどを背景に国内リート市況が上昇し、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

#### ◆ 投資環境について

##### ○ 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、当期中期首より、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、軟調な推移となりました。2018年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ました。しかし12月は、米中貿易摩擦懸念の高まりにより一時下落する局面もあり、不安定な動きとなりました。2019年に入ると、公募増資等のエクイティ調達の発表があったものの、米国金融政策の軟化などにより国内株式市場が反発したことや、今後の国内外での金利上昇懸念が後退したことが好感され、当期中期末にかけて上昇しました。

### ■ 売買および取引の状況

#### (1) 投資信託証券

(2018年9月19日から2019年3月15日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	143,303 千口	23,523,803 千円	38,407 (-) 千口	6,156,912 (-) 千円

(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9月19日から2019年3月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投資指数先物取引	百万円 7,232	百万円 6,935	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。





# ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17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。

#### ★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。	

## 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)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<2736>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率				
1 期末 (2017年 6月15日)	円 9,844	円 0	% △ 1.6	9,995	% △ 0.1	% —	% 98.2	% —	百万円 5,285
2 期末 (2018年 6月15日)	9,722	0	△ 1.2	10,123	1.3	0.8	99.1	1.0	8,688
3 期末 (2019年 6月17日)	10,760	0	10.7	11,570	14.3	0.6	98.4	1.0	10,895

(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：9,722円

期末：10,760円 (分配金0円)

騰落率：10.7% (分配金込み)

#### ■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートに投資し、為替ヘッジした結果、米国を中心としたリート市場の上昇の影響が大きく、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		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
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2018年6月15日	9,722	—	10,123	—	0.8	99.1	1.0
6月末	9,912	2.0	10,335	2.1	0.6	99.1	1.0
7月末	9,864	1.5	10,311	1.9	1.0	97.7	1.0
8月末	10,175	4.7	10,672	5.4	1.1	96.3	1.6
9月末	9,797	0.8	10,310	1.9	1.6	99.7	1.0
10月末	9,708	△ 0.1	10,244	1.2	1.2	96.7	1.0
11月末	9,869	1.5	10,434	3.1	0.8	98.9	1.0
12月末	9,214	△ 5.2	9,754	△ 3.6	0.8	95.7	0.6
2019年1月末	10,185	4.8	10,821	6.9	0.7	98.1	0.8
2月末	10,235	5.3	10,900	7.7	1.1	99.7	0.8
3月末	10,609	9.1	11,326	11.9	0.4	97.9	1.0
4月末	10,497	8.0	11,234	11.0	0.5	99.0	1.0
5月末	10,435	7.3	11,203	10.7	0.7	96.7	1.0
(期末)2019年6月17日	10,760	10.7	11,570	14.3	0.6	98.4	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

(2018.6.16～2019.6.17)

### ■海外リート市況

海外リート市況は、欧州の一部地域を除き、当作成期を通じては上昇しました。

米国リート市況は、当作成期首より、主要リートの好調な決算発表や米国長期金利が安定的に推移したことを受けて、上昇しました。2018年9月からは、米国長期金利が上昇したことや米中貿易摩擦が悪材料となり、下落に転じました。12月には、F R B (米国連邦準備制度理事会) の利上げ継続姿勢に対する投資家懸念の高まりからさらに売られましたが、2019年に入ると米中貿易摩擦の緩和期待やF R Bが金融引き締めに対して慎重姿勢に転じたことが好感され、堅調な展開となりました。当作成期末にかけてはボックス圏での推移となりました。カナダリート市況は、当作成期を通じては上昇基調でした。

欧州リート市況は、当作成期首より、英国のE U (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ました。2019年に入ると、欧米の長期金利低下や好調な業績見通しなどを受けて一時上昇しましたが、当作成期末にかけては、英国のE U離脱に関する政治的混乱が続いたことから、ドイツを除き欧州リート市況は上値が重い展開となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港は、2018年9月以降は中国株の下落などの影響もあり売られました。2019年に入ると、米中貿易交渉への懸念が一時後退したことや堅調な業績見通しを受けて、上昇して当作成期末を迎えました。シンガポールは、中国の景気刺激策への期待や大型商業施設リートに対する好調な業績見通しが好材料となり、当作成期を通じては上昇しました。オーストラリアは、2018年9月に、商業施設リートの業績懸念などで一時売られました。2019年に入ると、中国景気の先行きに対する安心感と他国と比べ堅調な国内景気が好感されたことで上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク（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、ETF（上場投資信託証券）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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### ■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、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

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、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

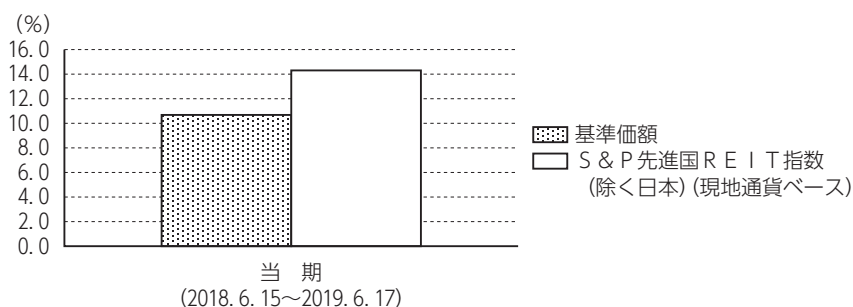
## ベンチマークとの差異について

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。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、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	
	2018年6月16日 ～2019年6月17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)	1,330

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）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 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
<b>信託報酬</b>	43円	0.429%	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10,061円です。
(投信会社)	(30)	(0.299)	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)	(11)	(0.109)	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
<b>売買委託手数料</b>	1	0.012	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)	
(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)	(0.008)	
<b>有価証券取引税</b>	1	0.013	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)	(1)	(0.013)	
<b>その他費用</b>	9	0.092	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)	(6)	(0.056)	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)	(3)	(0.031)	信託事務の処理等に関するその他の費用
<b>合計</b>	55	0.545	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,110,041	2,514,100	612,458	1,427,290

(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
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	3,999,701	4,497,284	10,918,058			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17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	10,918,058	99.4
コール・ローン等、その他	68,416	0.6
投資信託財産総額	10,986,474	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1香港・ドル=13.87円、1シンガポール・ドル=79.26円、1ニュージーランド・ドル=70.62円、1イギリス・ポンド=136.75円、1イスラエル・シケル=30.11円、100韓国・ウォン=9.17円、1ユーロ=121.87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(22,482,002千円)の投資信託財産総額(22,744,101千円)に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	21,369,862,839円
コール・ローン等	62,263,405
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)	10,918,058,430
未収入金	10,389,541,004
(B) 負債	10,474,194,862
未払金	10,424,397,568
未払解約金	27,724,774
未払信託報酬	21,793,856
その他未払費用	278,664
(C) 純資産総額(A-B)	10,895,667,977
元本	10,126,367,998
次期繰越損益金	769,299,979
(D) 受益権総口数	10,126,367,998口
1万口当り基準価額(C/D)	10,760円

\*期首における元本額は8,936,929,166円、当作成期間中における追加設定元本額は3,628,593,466円、同解約元本額は2,439,154,634円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,760円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,162円
受取利息	2,280
その他収益金	20,112
支払利息	△ 29,554
(B) 有価証券売買損益	982,216,663
売買益	2,184,349,699
売買損	△ 1,202,133,036
(C) 信託報酬等	△ 42,487,515
(D) 当期損益金(A+B+C)	939,721,986
(E) 前期繰越損益金	149,475,593
(F) 追加信託差損益金	△ 319,897,600
(配当等相当額)	( 258,405,632)
(売買損益相当額)	(△ 578,303,232)
(G) 合計(D+E+F)	769,299,979
次期繰越損益金(G)	769,299,979
追加信託差損益金	△ 319,897,600
(配当等相当額)	( 258,405,632)
(売買損益相当額)	(△ 578,303,232)
分配準備積立金	1,089,204,741
繰越損益金	△ 7,162

(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	939,720,575
(c) 収益調整金	258,405,632
(d) 分配準備積立金	149,484,166
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,347,610,373
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,347,610,373
(h) 受益権総口数	10,126,367,998口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の決算日（2018年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2019年6月17日）現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を247～252ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 171.1	千円 1,578,395	円 9,224	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 172.4	千円 1,578,108	円 9,153

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	11.8	230,073	19,497	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A (アメリカ)	31.913	72,464	2,270
PROLOGIS INC (アメリカ)	24.2	180,760	7,469	LASALLE HOTEL PROPERTIES (アメリカ)	16.4	62,339	3,801
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	60	145,952	2,432	EDUCATION REALTY TRUST INC (アメリカ)	11.5	54,161	4,709
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	5.9	139,986	23,726	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	1.6	31,443	19,652
WELLTOWER INC (アメリカ)	16.5	129,078	7,822	SELECT INCOME REIT (アメリカ)	13.3	25,369	1,907
WP CAREY INC (アメリカ)	15.1	119,758	7,931	ALEXANDER & BALDWIN INC (アメリカ)	9.233	24,026	2,602
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)	5.79	118,778	20,514	PROLOGIS INC (アメリカ)	2.9	22,628	7,802
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	14	107,119	7,651	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	0.8	19,595	24,494
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	5.1	104,565	20,503	LINK REIT (香港)	12	15,130	1,260
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	7.9	101,418	12,837	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)	0.67	12,421	18,539

(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、2019年6月17日現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド（9,341,984千口）の内容です。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた外貨建ファンドの明細

(i) 外国投資信託受益証券

ファンド名	2019年6月17日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	千口 14.3	千アメリカ・ドル 1,282	千円 139,379	% 0.6

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(ii) 外国投資信託証券

ファンド名	2019年6月17日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール) MANULIFE US REAL ESTATE INV	229.527	199	21,698	0.1
(アメリカ) PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21.9	624	67,843	0.3
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	91	9,914	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	19.582	341	37,087	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	18	380	41,327	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	23.1	4,806	522,315	2.3
SIMON PROPERTY GROUP INC	51.747	8,430	916,071	4.0
BOSTON PROPERTIES INC	25.9	3,501	380,492	1.7
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25.867	1,322	143,711	0.6
VORNADO REALTY TRUST	28.864	1,910	207,627	0.9
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11.1	206	22,409	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9.1	271	29,525	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.1	125	13,622	0.1



ファンド名	2019年6月17日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
QTS REALTY TRUST INC-CL A	8.8	403	43,880	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	62	4,852	527,231	2.3
APPLE HOSPITALITY REIT INC	36.2	570	61,991	0.3
EPR PROPERTIES	12.5	975	105,943	0.5
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	42	4,582	0.0
CITY OFFICE REIT INC	5.3	65	7,072	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	13.333	261	28,381	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10.829	308	33,570	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	141	15,406	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	10	288	31,348	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4.7	201	21,924	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8.6	683	74,318	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18.3	315	34,321	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.9	109	11,870	0.1
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4.113	41	4,504	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	123.3	2,257	245,313	1.1
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43.308	1,070	116,328	0.5
CORESITE REALTY CORP	6.1	701	76,185	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	25.7	877	95,310	0.4
RLJ LODGING TRUST	29.371	519	56,488	0.2
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	18	2,035	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	30.4	550	59,855	0.3
CYRUSONE INC	18.2	1,072	116,501	0.5
KIMCO REALTY CORP	70.2	1,314	142,871	0.6
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3.7	40	4,382	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	34.15	985	107,054	0.5
WHITESTONE REIT	5.8	73	8,010	0.0
TIER REIT INC	9	259	28,242	0.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33.6	1,336	145,235	0.6
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20.7	427	46,447	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	33	929	101,011	0.4
COLONY CAPITAL INC	78.811	401	43,674	0.2
INVITATION HOMES INC	63.697	1,739	189,021	0.8
JBG SMITH PROPERTIES	20.032	815	88,590	0.4
CLIPPER REALTY INC	1.4	18	1,971	0.0
GLADSTONE LAND CORP	2.5	30	3,327	0.0
AMERICOLD REALTY TRUST	30.8	1,017	110,609	0.5
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10.5	204	22,225	0.1
VICI PROPERTIES INC	60	1,363	148,190	0.7
SPIRIT MTA REIT	5.87	50	5,491	0.0
RETAIL VALUE INC	2.009	69	7,548	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	16.6	307	33,423	0.1
BRT APARTMENTS CORP	1.3	16	1,829	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7.3	89	9,701	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1.4	151	16,502	0.1
SAFEHOLD INC	1.3	38	4,169	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	118	12,924	0.1
AMERICAN FINANCE TRUST INC	8.3	89	9,713	0.0
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	7.5	159	17,374	0.1
CORECIVIC INC	19.124	455	49,456	0.2
STORE CAPITAL CORP	33.2	1,167	126,876	0.6
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15.7	182	19,874	0.1
LIFE STORAGE INC	7.8	765	83,152	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6.4	302	32,858	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	13.682	163	17,721	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6.6	100	10,972	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	33.6	495	53,888	0.2
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	23.3	353	38,407	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	17.1	684	74,323	0.3
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19.5	426	46,318	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	20.7	644	70,019	0.3
VENTAS INC	59.679	3,984	432,919	1.9
CARETRUST REIT INC	15.903	387	42,094	0.2
GEO GROUP INC/THE	19.5	453	49,242	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49.7	904	98,287	0.4
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7.7	184	20,063	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	29.687	576	62,677	0.3
UMH PROPERTIES INC	5.6	74	8,117	0.0
IRON MOUNTAIN INC	48	1,523	165,493	0.7
TERRENO REALTY CORP	9.9	469	51,043	0.2
VEREIT INC	161.208	1,536	166,935	0.7
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14.32	641	69,662	0.3
SUN COMMUNITIES INC	14.4	1,859	202,034	0.9
ACADIA REALTY TRUST	13.611	383	41,677	0.2
ALEXANDER'S INC	0.6	231	25,193	0.1

ファンド名	2019年6月17日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
PROLOGIS INC	105.602	8,443	917,518	4.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19	2,874	312,364	1.4
BRANDYWINE REALTY TRUST	28.5	433	47,133	0.2
SAUL CENTERS INC	1.7	96	10,529	0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22.945	25	2,742	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	14.5	349	37,939	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	16.1	1,709	185,719	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	70.007	681	74,091	0.3
SITE CENTERS CORP	24.078	323	35,110	0.2
DUKE REALTY CORP	59.8	1,898	206,307	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	6.1	704	76,496	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10.967	3,281	356,537	1.6
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21.1	772	83,890	0.4
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12.4	1,650	179,390	0.8
GETTY REALTY CORP	5.703	178	19,359	0.1
WELLTOWER INC	64.7	5,323	578,453	2.6
HCP INC	79.6	2,556	277,816	1.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17.2	760	82,663	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	27.4	672	73,062	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20.9	680	73,988	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	20.275	685	74,442	0.3
KILROY REALTY CORP	16.8	1,299	141,219	0.6
LIBERTY PROPERTY TRUST	24.6	1,235	134,293	0.6
LTC PROPERTIES INC	6.4	292	31,815	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	34.8	327	35,544	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19.028	2,241	243,540	1.1
MACERICH CO/THE	17.6	607	66,035	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15	1,860	202,156	0.9
NATL HEALTH INVESTORS INC	7.1	558	60,669	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	27.1	1,498	162,782	0.7
REALTY INCOME CORP	50.617	3,708	402,988	1.8
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	18.4	525	57,081	0.3
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8.6	56	6,158	0.0
PUBLIC STORAGE	25.1	6,107	663,595	2.9
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3.3	562	61,101	0.3
REGENCY CENTERS CORP	27.92	1,922	208,936	0.9
RPT REALTY	11.7	148	16,158	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15.1	244	26,596	0.1
SL GREEN REALTY CORP	14	1,225	133,169	0.6
SENIOR HOUSING PROP TRUST	38	304	33,115	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	9.8	429	46,641	0.2
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4.4	94	10,231	0.0
UDR INC	45.9	2,131	231,619	1.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.9	167	18,200	0.1
WP CAREY INC	28.6	2,445	265,706	1.2
WASHINGTON REIT	12.8	350	38,137	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20.1	571	62,092	0.3
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11.3	41	4,481	0.0
AGREE REALTY CORP	6.1	412	44,833	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	35.448	1,294	140,628	0.6
CUBESMART	31.3	1,063	115,567	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38.226	520	56,572	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	34.778	4,165	452,570	2.0
CEDAR REALTY TRUST INC	10.8	30	3,344	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	21.2	2,290	248,926	1.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5.275	89	9,686	0.0
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2.06	123	13,434	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	13.35	213	23,224	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14.8	203	22,096	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	68	7,410	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23	1,081	117,461	0.5
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4.7	100	10,877	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33.242	331	36,048	0.2
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	8.049	128	13,993	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	63.5	1,145	124,474	0.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16.3	125	13,584	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	27.1	1,118	121,586	0.5
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	34.6	423	46,017	0.2
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,785,754 156銘柄	149,538 16,248,841	<71.6%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	156	12,711	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	15.4	210	17,051	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	3.1	39	3,181	0.0

ファンド名	2019年6月17日現在				
	□ 数	評 価 額		比 率	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	千口	千カナダ・ドル	千円	%	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7.7	151	12,249	0.1	
SLATE OFFICE REIT	5.1	30	2,495	0.0	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1.2	23	1,921	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	10.2	125	10,162	0.0	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	15.2	198	16,067	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4.2	27	2,262	0.0	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3.9	238	19,292	0.1	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9.4	115	9,365	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7.6	109	8,833	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	25.3	351	28,505	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1.7	31	2,533	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8	116	9,396	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11.4	387	31,414	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12.5	607	49,167	0.2	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13.79	172	13,962	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23.866	542	43,940	0.2	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25.6	687	55,655	0.2	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	129	10,475	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.7	152	12,350	0.1	
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4.9	133	10,787	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6.5	99	8,071	0.0	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8.8	424	34,385	0.2	
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	247.556 25銘柄	5,262 426,239	<1.9%>	
<b>(オーストラリア)</b>		千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	36.52	140	10,479	0.0	
CROMWELL PROPERTY GROUP	278.284	333	24,955	0.1	
RURAL FUNDS GROUP	50.595	117	8,771	0.0	
VIVA ENERGY REIT	76.33	206	15,458	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	37.424	193	14,430	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	145.16	378	28,312	0.1	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	39.307	169	12,689	0.1	
NATIONAL STORAGE REIT	105.195	194	14,503	0.1	
APN INDUSTRIA REIT	11.76	34	2,601	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	83.31	117	8,809	0.0	
SCENTRE GROUP	906.41	3,408	254,687	1.1	
ARENA REIT	42.89	123	9,198	0.0	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21.3	74	5,555	0.0	
BWP TRUST	78.55	296	22,130	0.1	
DEXUS	184.47	2,516	188,033	0.8	
GPT GROUP	306.72	1,892	141,423	0.6	
CHARTER HALL RETAIL REIT	59.4	282	21,085	0.1	
MIRVAC GROUP	676.34	2,171	162,242	0.7	
STOCKLAND	414.45	1,807	135,037	0.6	
ABACUS PROPERTY GROUP	52.35	220	16,470	0.1	
GOODMAN GROUP	272.84	3,997	298,703	1.3	
VICINITY CENTRES	547.06	1,411	105,475	0.5	
CHARTER HALL GROUP	78.8	907	67,838	0.3	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	28.46	90	6,784	0.0	
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,533.925 24銘柄	21,084 1,575,678	<6.9%>	
<b>(香港)</b>		千口	千香港・ドル	千円	%
YUJEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	227	1,205	16,718	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	153	899	12,478	0.1	
FORTUNE REIT	232	2,454	34,044	0.2	
PROSPERITY REIT	195	647	8,979	0.0	
LINK REIT	360.5	34,553	479,262	2.1	
CHAMPION REIT	327	2,132	29,571	0.1	
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,494.5 6銘柄	41,892 581,055	<2.6%>	
<b>(シンガポール)</b>		千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	153.628	251	19,969	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	81.2	82	6,500	0.0	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	365.1	511	40,512	0.2	
AIMS APAC REIT	89	125	9,946	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	86	6,854	0.0	
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	271.65	325	25,837	0.1	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	465.075	958	75,935	0.3	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	434.2	1,293	102,555	0.5	
CAPITALAND MALL TRUST	478.9	1,245	98,689	0.4	
SUNTEC REIT	379.4	717	56,834	0.3	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	389.7	615	48,802	0.2	

ファンド名	2019年6月17日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL REIT	308.4	388	30,799	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	104.96	166	13,227	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	213.6	277	22,008	0.1
ESR-REIT	294.337	166	13,180	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	130.6	210	16,665	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	114.968	295	23,418	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	243.8	184	14,589	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	108	163	12,925	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69.3	211	16,752	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267.2	61	4,871	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	216.48	465	36,890	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST	174.5	134	10,649	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	318.4	643	50,977	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	127.1	82	6,548	0.0
SPH REIT	89.6	94	7,527	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	95	57	4,555	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124.4	54	4,338	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	108.9	105	8,329	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST	166.873	117	9,324	0.0
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,506.071 30銘柄	10,093 800,019	<3.5%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	51.48	111	7,852	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	128.52	171	12,116	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	243.92	382	27,044	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	56.8	136	9,606	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	168.25	317	22,397	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	190.24	320	22,637	0.1
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	839.21 6銘柄	1,439 101,655	<0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	383.93	244	33,444	0.1
CAPITAL & REGIONAL PLC	59.27	8	1,201	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	86.57	78	10,737	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117.17	105	14,388	0.1
PICTON PROPERTY INCOME LTD	88.11	83	11,470	0.1
REGIONAL REIT LTD	46.31	50	6,915	0.0
NEWRIVER REIT PLC	46.33	87	11,948	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	100.49	77	10,540	0.0
LXI REIT PLC	54.038	68	9,370	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54.33	46	6,300	0.0
RDI REIT PLC	41.036	41	5,645	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	127.151	1,070	146,336	0.6
HANSTEEN HOLDINGS PLC	60.79	58	8,047	0.0
SEGRO PLC	183.55	1,319	180,472	0.8
HAMMERSON PLC	127.61	360	49,298	0.2
UNITE GROUP PLC	44.52	422	57,837	0.3
BRITISH LAND CO PLC	163.33	880	120,432	0.5
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	45.691	325	44,537	0.2
INTU PROPERTIES PLC	145.67	125	17,107	0.1
DERWENT LONDON PLC	18.83	603	82,503	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	192.04	266	36,450	0.2
WORKSPACE GROUP PLC	20.96	182	24,936	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	33.82	222	30,362	0.1
SHAFTESBURY PLC	39.16	320	43,831	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	25.31	258	35,407	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	116.04	238	32,625	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	76.6	43	5,897	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	284.57	427	58,411	0.3
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,783.226 28銘柄	8,017 1,096,457	<4.8%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シケル	千円	%
REIT 1 LTD	28.84	499	15,048	0.1
イスラエル・シケル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	28.84 1銘柄	499 15,048	<0.1%>
(韓国)	千口	千韓国・ウォン	千円	%
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6	38,820	3,559	0.0
韓国・ウォン通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	6 1銘柄	38,820 3,559	<0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	58.05	94	11,503	0.1

ファンド名	2019年6月17日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
GREEN REIT PLC	千口 111.57	千ユーロ 195	千円 23,822	% 0.1
HIBERNIA REIT PLC	116.24	159	19,407	0.1
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	285.86 3銘柄	449 54,732	<0.2%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV	6.47	150	18,372	0.1
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6.53	156	19,083	0.1
NSI NV	2.731	101	12,331	0.1
VASTNED RETAIL NV	2.45	71	8,763	0.0
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	18.181 4銘柄	480 58,550	<0.3%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	4.144	348	42,523	0.2
COFINIMMO	3.56	400	48,852	0.2
BEFIMMO	3.72	193	23,529	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3.31	83	10,185	0.0
RETAIL ESTATES	1.14	91	11,211	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2.92	419	51,101	0.2
MONTEA	1.65	127	15,523	0.1
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	20.444 7銘柄	1,665 202,927	<0.9%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23.29	3,163	385,590	1.7
ICADE	7.46	596	72,732	0.3
ALTAREA	0.54	97	11,845	0.1
GECINA SA	9.211	1,234	150,420	0.7
KLEPIERRE	34.83	1,032	125,771	0.6
COVIVIO	10.442	991	120,830	0.5
MERCIALYS	8.07	92	11,290	0.0
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	93.843 7銘柄	7,208 878,480	<3.9%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26.6	382	46,648	0.2
HAMBORNER REIT AG	11.98	107	13,125	0.1
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	38.58 2銘柄	490 59,774	<0.3%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10.53	72	8,854	0.0
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	45.083	458	55,876	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	61.78	756	92,156	0.4
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	117.393 3銘柄	1,287 156,887	<0.7%>
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZZ	6.24	37	4,547	0.0
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	6.24 1銘柄	37 4,547	<0.0%>
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	580.541 27銘柄	11,618 1,415,901	<6.2%>
合計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	20,805.623 304銘柄	- 22,264,457	<98.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、2019年6月17日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2019年6月17日現在	
	買建額	売建額
外	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	191	—
国		
STOXX 600 REAL (ドイツ)	26	—

(注1) 外貨建の評価額は、2019年6月17日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ダイワ・グローバル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

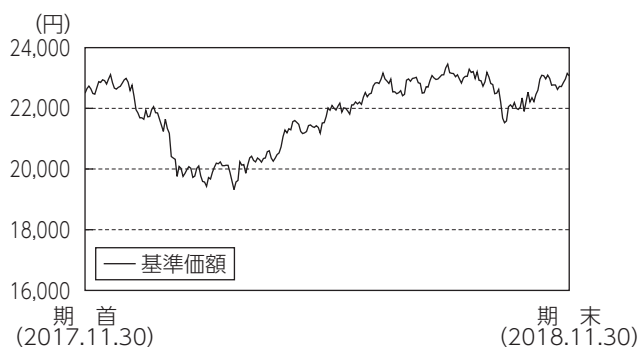
## 大和投資信託

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	ベンチマーク	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	1.2			
2月末	19,773	△ 12.1	22,698	△ 11.7	0.6	98.1	1.1			
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グローバル株指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。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や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（ETF）ならびに不動産投資指数先物取引を利用することがあります。

S & P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (先物・オプション)	4円 (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 (出資証券)	5 (0)
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(5)
その他費用 (保管費用)	31 (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	
		数	金額	数	金額
外	アメリカ	千口 153.3 (-)	千アメリカ・ドル 12,354 (-)	千口 141.1 (-)	千アメリカ・ドル 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) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

(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	
		数	金額	数	金額
外	アメリカ	千口 1,275.9 (△ 71.997)	千アメリカ・ドル 44,010 (△ 2,011)	千口 89.783 (-)	千アメリカ・ドル 2,487 (-)
	カナダ	千口 95.3 (-)	千カナダ・ドル 1,674 (-)	千口 25.9 (-)	千カナダ・ドル 416 (-)
	オーストラリア	千口 1,546.05 (21.247)	千オーストラリア・ドル 6,049 (40)	千口 255.6 (-)	千オーストラリア・ドル 2,258 (-)
	香港	千口 510 (-)	千香港ドル 9,641 (-)	千口 106 (-)	千香港ドル 327 (-)
	シンガポール	千口 2,232.6 (37.108)	千シンガポール・ドル 3,058 (3)	千口 - (-)	千シンガポール・ドル - (-)
	ニュージーランド	千口 266.95 (-)	千ニュージーランド・ドル 373 (-)	千口 23.13 (-)	千ニュージーランド・ドル 35 (-)
	イギリス	千口 1,075.11 (△ 34.623)	千イギリス・ポンド 2,779 (△ 52)	千口 13.85 (-)	千イギリス・ポンド 52 (-)

		買 付		売 付	
		数	金額	数	金額
外	ユーロ (アイルランド)	千口 82.4 (-)	千ユーロ 124 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (オランダ)	千口 6.02 (-)	千ユーロ 206 (-)	千口 1.23 (-)	千ユーロ 37 (-)
	ユーロ (ベルギー)	千口 6.99 (5.59)	千ユーロ 455 (-)	千口 5.59 (-)	千ユーロ 3 (-)
	ユーロ (フランス)	千口 33.34 (-)	千ユーロ 3,455 (△ 4)	千口 0.45 (-)	千ユーロ 13 (-)
	ユーロ (ドイツ)	千口 15.49 (-)	千ユーロ 182 (△ 9)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (スペイン)	千口 79.52 (△ 12.987)	千ユーロ 787 (△ 226)	千口 16.1 (-)	千ユーロ 191 (-)
	ユーロ (イタリア)	千口 52.18 (△ 24.32)	千ユーロ 61 (-)	千口 3.04 (-)	千ユーロ 3 (-)
国	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 275.94 (△ 31.717)	千ユーロ 5,272 (△ 239)	千口 26.41 (-)	千ユーロ 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) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

(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	
		数	金額	数	金額
外	アメリカ	千口 - (0.488)	千アメリカ・ドル - (-)	千口 0.488 (-)	千アメリカ・ドル 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) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

(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 不動産投資指数先物取引	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) 単位未満は四捨五入してあります。

■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	柄	□ 数	金額	平均単価	銘柄	柄	□ 数	金額	平均単価
		千□	千円	円			千□	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	柄	□ 数	金額	平均単価	銘柄	柄	□ 数	金額	平均単価
		千□	千円	円			千□	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		未
	□ 数	外貨建金額	評価額	比率	
	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
(アメリカ) 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		未
	□ 数	外貨建金額	評価額	比率	
	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
<b>不動産ファンド</b>					
(シンガポール)	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
MANULIFE US REAL ESTATE INV	168.727	129	14,741		0.1
(アメリカ)					
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

ファンド名	当		期		未
	□ 数	外貨建金額	評価額	比率	
	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
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
CLIPPER REALTY INC	1.4	18	2,068		0.0
GLADSTONE LAND CORP	0.9	11	1,341		0.0
INFREAREIT 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



ファンド名	当期			
	□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	%
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 COMMUNA	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
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
WELLTOWER 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

ファンド名	当期			
	□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	%
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
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	□数、金額 銘柄数<比率>	3,451.612 157銘柄	125,013 14,185,226	<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	□数、金額 銘柄数<比率>	210.056 25銘柄	4,163 355,649	<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
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	□数、金額 銘柄数<比率>	4,210.397 26銘柄	16,726 1,389,610	<7.0%>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	□数	当 期		末 比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(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	□数、金額 6銘柄	31,011	449,980	< 2.3%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・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
OUE HOSPITALITY TRUST	166.873	115	9,544	0.0
シンガポール・ドル通貨計	□数、金額 29銘柄	7,863	651,814	< 3.3%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	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	□数、金額 6銘柄	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
SEGRO 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	□数、金額 27銘柄	6,894	999,728	< 5.0%>

ファンド名	□数	当 期		末 比 率	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シェケル	千円	%	
REIT 1 LTD	9.34	131	4,035	0.0	
イスラエル・シェケル通貨計	□数、金額 1銘柄	131	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	□数、金額 3銘柄	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	
VASTNED RETAIL NV	2.45	81	10,571	0.1	
国 小 計	□数、金額 4銘柄	17.161	535	69,225	< 0.3%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%	
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	□数、金額 6銘柄	16.478	1,176	151,965	< 0.8%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	%	
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	□数、金額 7銘柄	85.921	6,736	870,251	< 4.4%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	%	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	24.32	299	38,708	0.2	
HAMBORNER REIT AG	11.98	106	13,697	0.1	
国 小 計	□数、金額 2銘柄	36.3	405	52,405	< 0.3%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	%	
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	□数、金額 3銘柄	112.723	1,132	146,310	< 0.7%>
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千円	%	
BENI STABILI SPA	143.4	105	13,662	0.1	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	38	4,911	0.0	
国 小 計	□数、金額 2銘柄	149.64	143	18,573	< 0.1%>
ユーロ通貨計	□数、金額 27銘柄	671,273	10,479	1,353,810	< 6.8%>
合 計	□数、金額 304銘柄	18,945,301	-	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	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REIT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REIT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REIT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REIT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REIT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REIT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REIT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REIT 263,443,683円、ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド26,470,390円、ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用) 222,841,400円、ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用) 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 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3期

(決算日 2019年6月17日)

(作成対象期間 2018年6月16日～2019年6月17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／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。		

#### 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)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<2737>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	10,729	0	7.3	10,780	7.8	—	99.1	—	609
2期末(2018年6月15日)	10,864	0	1.3	11,093	2.9	0.8	97.8	1.0	1,189
3期末(2019年6月17日)	11,931	0	9.8	12,298	10.9	0.6	98.2	1.0	1,667

(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。

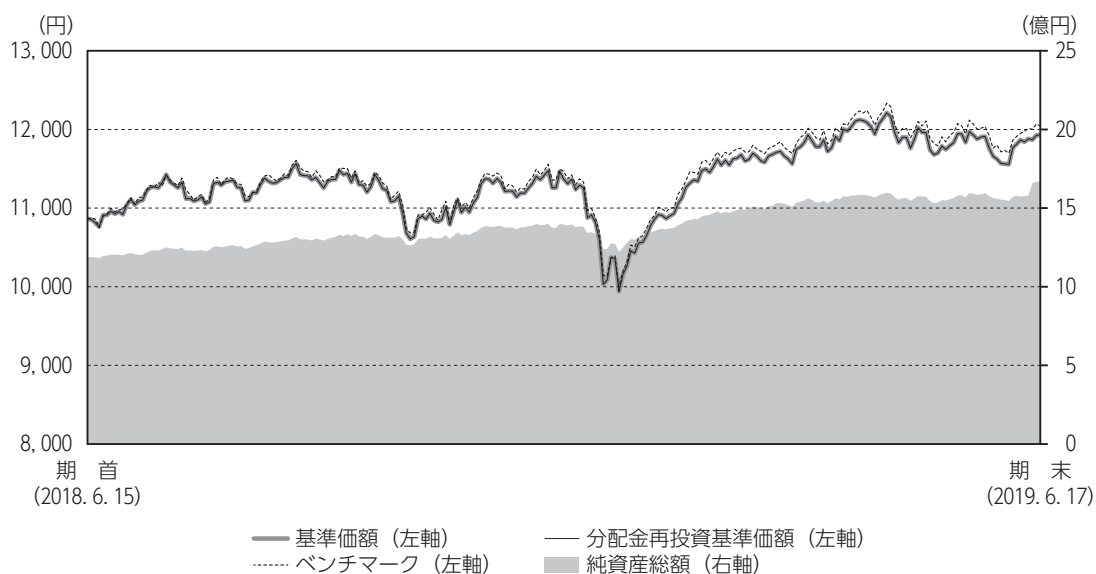
(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

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：10,864円

期末：11,931円(分配金0円)

騰落率：9.8%(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、米国を中心としたリート市況上昇の影響が大きく、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 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
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2018年6月15日	円	%			%	%	%
	10,864	—	11,093	—	0.8	97.8	1.0
6月末	11,039	1.6	11,286	1.7	0.6	98.1	1.0
7月末	11,078	2.0	11,348	2.3	1.0	97.1	1.0
8月末	11,425	5.2	11,758	6.0	1.1	97.0	1.6
9月末	11,272	3.8	11,550	4.1	1.5	97.1	1.0
10月末	11,102	2.2	11,366	2.5	1.2	97.5	1.0
11月末	11,361	4.6	11,661	5.1	0.8	97.9	0.9
12月末	10,354	△ 4.7	10,614	△ 4.3	0.9	98.2	0.6
2019年1月末	11,316	4.2	11,708	5.5	0.7	98.2	0.8
2月末	11,581	6.6	11,939	7.6	1.1	97.9	0.8
3月末	12,003	10.5	12,329	11.1	0.4	98.3	1.0
4月末	11,962	10.1	12,299	10.9	0.5	98.4	1.0
5月末	11,623	7.0	12,051	8.6	0.8	98.2	1.0
(期末)2019年6月17日	11,931	9.8	12,298	10.9	0.6	98.2	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

(2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17)

### 海外リート市況

海外リート市況は、欧州の一部地域を除き、当作成期を通じては上昇しました。

米国リート市況は、当作成期首より、主要リートの好調な決算発表や米国長期金利が安定的に推移したことを受けて、上昇しました。2018年9月からは、米国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、下落に転じました。12月には、F R B (米国連邦準備制度理事会) の利上げ継続姿勢に対する投資家懸念の高まりからさらに売られましたが、2019年に入ると、米中貿易摩擦の緩和期待やF R Bが金融引き締めに対して慎重姿勢に転じたことが好感され、堅調な展開となりました。当作成期末にかけてはボックス圏での推移となりました。カナダリート市況は、当作成期を通じては上昇基調でした。

欧州リート市況は、当作成期首より、英国のE U (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ました。2019年に入ると、欧米の長期金利低下や好調な業績見通しなどを受けて一時上昇しましたが、当作成期末にかけては、英国のE U離脱に関する政治的混乱が続いたことから、ドイツを除き欧州リート市況は上値が重い展開となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港は、2018年9月以降は中国株の下落などの影響もあり売られました。2019年に入ると、米中貿易交渉への懸念が一時後退したことや堅調な業績見通しを受けて、上昇して当作成期末を迎えました。シンガポールは、中国の景気刺激策への期待や大型商業施設リートに対する好調な業績見通しが好材料となり、当作成期を通じては上昇しました。オーストラリアは、当作成期首からリートの好業績に支えられて緩やかに上昇しました。しかし2018年9月に、商業施設リートの業績懸念などで売られました。2019年に入ると、中国景気の先行きに対する安心感と他国と比べ堅調な国内景気が好感されたことで上昇しました。

## ■為替相場

為替相場は下落しました。

米ドルは、当作成期首から、米中貿易摩擦への懸念が後退したことでリスク選好姿勢が強まったことや米国金利が上昇したことを受けて、上昇しました。2018年12月には、株価や原油価格が下落し市場のリスク回避姿勢が強まったことを受けて、米ドル安となりました。2019年に入ると、米国の金融引き締め姿勢後退を受けて再び米ドル高となりましたが、当作成期末にかけては、米中貿易交渉の激化から再び米ドル安となりました。

ユーロは、当作成期首からイタリアの政局混迷を受けて売られました。その後は、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。2018年10月以降は、トルコの債務危機や株価の下落などから円が買われて、ユーロ安になりました。2019年に入るとユーロは下げ止まったものの、当作成期末にかけては市場のリスク回避姿勢が強まり、円高となりました。英ポンドもユーロとほぼ同じ動きとなりましたが、2019年に入ると大幅下落による割安感の台頭で、一時的に英ポンドが買い戻される局面もありました。

オーストラリア・ドルは、当作成期首から、米中貿易摩擦の激化で中国の影響を受け、上値が重い展開となりました。2018年12月にはリスク回避の動きによる円高の影響でオーストラリア・ドルも下落しましたが、2019年に入り下げ止まりました。当作成期末にかけては、リスク回避的な動きを受け、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

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク（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、ETF（上場投資信託証券）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

（2018. 6. 16 ~ 2019. 6. 17）

### ■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いました。

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



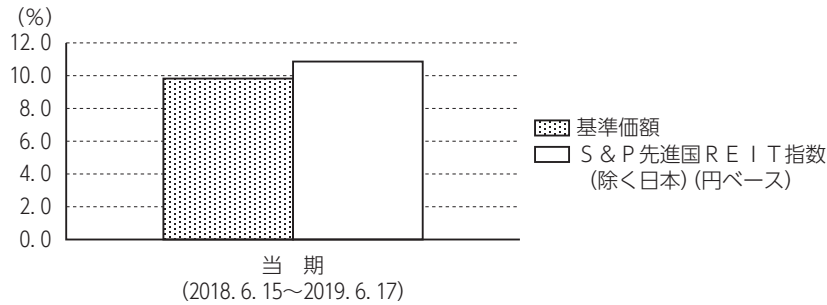
## ベンチマークとの差異について

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10.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は9.8%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が少額であったため、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	
	2018年6月16日 ～2019年6月17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)	1,930

- (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

主としてダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券に投資します。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）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 (2018. 6. 16~2019. 6. 17)		項目の概要
	金額	比率	
<b>信託報酬</b>	49円	0.429%	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11,356円です。
(投信会社)	(34)	(0.299)	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)	(12)	(0.109)	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
<b>売買委託手数料</b>	1	0.012	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)	
(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)	(0.008)	
<b>有価証券取引税</b>	1	0.013	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)	(1)	(0.013)	
<b>その他費用</b>	10	0.089	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)	(6)	(0.056)	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)	(3)	(0.028)	信託事務の処理等に関するその他の費用
<b>合計</b>	<b>62</b>	<b>0.543</b>	

(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

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

	設 定		解 約	
	口数	金額	口数	金額
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	191,579	443,976	44,739	103,795

(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	口数	評価額
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	540,038	686,878	1,667,535

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	1,667,535 千円	99.7 %
コール・ローン等、その他	4,766	0.3
投資信託財産総額	1,672,302	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。  
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1カナダ・ドル=81.00円、1オーストラリア・ドル=74.73円、1香港・ドル=13.87円、1シンガポール・ドル=79.26円、1ニュージーランド・ドル=70.62円、1イギリス・ポンド=136.75円、1イスラエル・シケル=30.11円、100韓国・ウォン=9.17円、1ユーロ=121.87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(22,482,002千円)の投資信託財産総額(22,744,101千円)に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	1,672,302,313円
コール・ローン等	4,709,600
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)	1,667,535,713
未収入金	57,000
(B)負債	4,600,150
未払解約金	1,393,062
未払信託報酬	3,166,684
その他未払費用	40,404
(C)純資産総額(A-B)	1,667,702,163
元本	1,397,806,976
次期繰越損益金	269,895,187
(D)受益権総口数	1,397,806,976口
1万口当り基準価額(C/D)	11,931円

- \*期首における元本額は1,094,522,792円、当作成期間中における追加設定元本額は579,621,490円、同解約元本額は276,337,306円です。  
 \*当期末の計算口数当りの純資産額は11,931円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

項 目	当 期
(A)配当等収益	2,111円
受取利息	148
その他収益金	4,269
支払利息	△ 2,306
(B)有価証券売買損益	125,804,552
売買益	140,223,517
売買損	△ 14,418,965
(C)信託報酬等	△ 6,048,311
(D)当期損益金(A+B+C)	119,758,352
(E)前期繰越損益金	27,152,697
(F)追加信託差損益金	122,984,138
(配当等相当額)	( 42,884,760)
(売買損益相当額)	( 80,099,378)
(G)合計(D+E+F)	269,895,187
次期繰越損益金(G)	269,895,187
追加信託差損益金	122,984,138
(配当等相当額)	( 42,884,760)
(売買損益相当額)	( 80,099,378)
分配準備積立金	146,911,049

- (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	2,111円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	119,755,520
(c)収益調整金	122,984,138
(d)分配準備積立金	27,153,418
(e)当期分配対象額(a+b+c+d)	269,895,187
(f)分配金	0
(g)翌期繰越分配対象額(e-f)	269,895,187
(h)受益権総口数	1,397,806,976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253～258ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド(ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし))が投資対象としている「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の決算日(2018年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2019年6月17日)現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。247～252ページをご参照ください。