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

運用報告書（全体版）

第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）

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/

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

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）

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、投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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/

<4660>

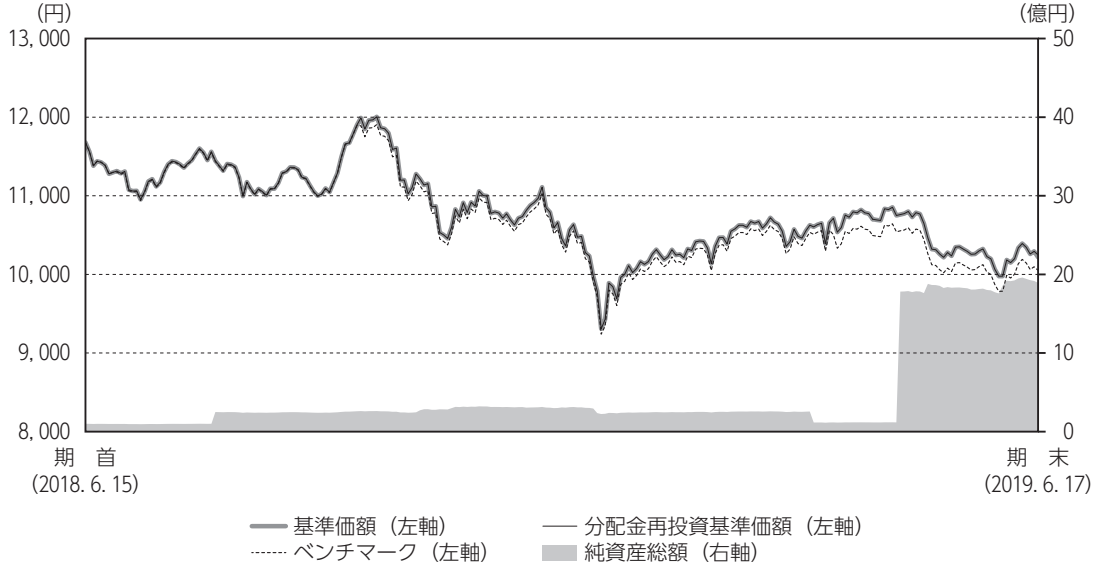
設定以来の運用実績

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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	10,274	30	3.0	1,588.09	2.2	99.1	1.2	4
2期末(2018年6月15日)	11,678	110	14.7	1,789.04	12.7	99.7	1.2	99
3期末(2019年6月17日)	10,218	30	△ 12.2	1,539.74	△ 13.9	98.8	1.5	1,892

(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：11,678円
期　末：10,218円（分配金30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		ＴＯＰＩＸ		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2018年６月15日	11,678	―	1,789.04	―	99.7	1.2
６月末	11,310	△ 3.2	1,730.89	△ 3.3	99.4	0.6
７月末	11,453	△ 1.9	1,753.29	△ 2.0	99.3	0.7
８月末	11,334	△ 2.9	1,735.35	△ 3.0	98.7	1.3
９月末	11,961	2.4	1,817.25	1.6	98.7	1.3
10月末	10,828	△ 7.3	1,646.12	△ 8.0	98.4	1.6
11月末	10,968	△ 6.1	1,667.45	△ 6.8	98.7	1.3
12月末	9,842	△ 15.7	1,494.09	△ 16.5	99.3	0.9
2019年１月末	10,324	△ 11.6	1,567.49	△ 12.4	99.1	0.8
２月末	10,589	△ 9.3	1,607.66	△ 10.1	99.5	0.7
３月末	10,596	△ 9.3	1,591.64	△ 11.0	97.9	2.1
４月末	10,769	△ 7.8	1,617.93	△ 9.6	98.7	1.3
５月末	10,065	△ 13.8	1,512.28	△ 15.5	98.4	1.6
（期末）2019年６月17日	10,248	△ 12.2	1,539.74	△ 13.9	98.8	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、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ＦＲＢ（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、ＦＲＢ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（ＴＯＰＩＸ）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的な手法）を用いて構築しています。

当作成期中、資金変動への対応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。

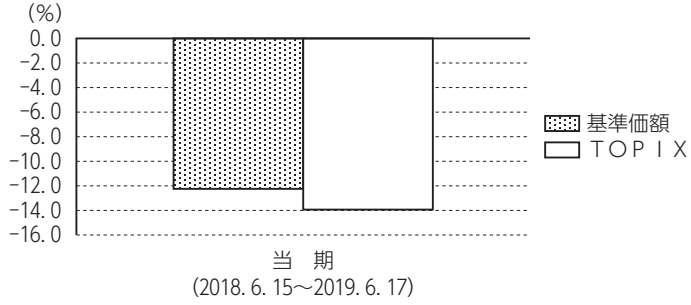
ベンチマークとの差異について

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

当作成期の１万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（１万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項目			当期 2018年６月16日 ～2019年６月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**30**
	対基準価額比率	（％）	0.29
	当期の収益	（円）	15
	当期の収益以外	（円）	15
翌期繰越分配対象額		（円）	377

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

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

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

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項目	当期	
（ａ）経費控除後の配当等収益	✓	19.71円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益		0.00
（ｃ）収益調整金	✓	387.36
（ｄ）分配準備積立金		0.35
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		407.44
（ｆ）分配金		30.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		377.44

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

今後の運用方針

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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	36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10, 793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. 002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(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	37	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	2,113,334	2,193,082	284,840	286,000

（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）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	18,540	1,028	5.5	8,326	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	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合0.3%
※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
	百万円	百万円	百万円
株式	27	19	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	
	百万円	
株式	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）	8千円
うち利害関係人への支払額（B）	1千円
（B）／（A）	23.6%

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

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

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	89,512	1,918,006	1,898,250

（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	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	1,898,250	98.6
コール・ローン等、その他	27,690	1.4
投資信託財産総額	1,925,941	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	**1,925,941,691円**
コール・ローン等	1,300,709
トピックス・インデックス・マザーファンド（評価額）	1,898,250,982
未収入金	26,390,000
（Ｂ）負債	**33,118,486**
未払収益分配金	5,557,228
未払解約金	26,307,286
未払信託報酬	1,234,064
その他未払費用	19,908
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**1,892,823,205**
元本	1,852,409,502
次期繰越損益金	40,413,703
（Ｄ）受益権総口数	**1,852,409,502口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**10,218円**

＊期首における元本額は85,356,999円、当作成期間中における追加設定元本額は2,042,744,740円、同解約元本額は275,692,237円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,218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	△	**48円**
支払利息	△	48
（Ｂ）有価証券売買損益	△	**86,766,575**
売買益		17,016,796
売買損	△	103,783,371
（Ｃ）信託報酬等	△	**1,645,670**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	△	**88,412,293**
（Ｅ）前期繰越損益金	△	**1,211,388**
（Ｆ）追加信託差損益金		**135,594,612**
（配当等相当額）	(	71,755,566)
（売買損益相当額）	(	63,839,046)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）		**45,970,931**
（Ｈ）収益分配金	△	**5,557,228**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）		**40,413,703**
追加信託差損益金		132,815,998
（配当等相当額）	(	68,976,952)
（売買損益相当額）	(	63,839,046)
分配準備積立金		940,978
繰越損益金	△	93,343,273

（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	3,652,907円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	0
（ｃ）収益調整金	71,755,566
（ｄ）分配準備積立金	66,685
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	75,475,158
（ｆ）分配金	5,557,228
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	69,917,930
（ｈ）受益権総口数	1,852,409,502口

ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１　万　口　当　り　分　配　金	30円

分配金の課税上の取扱いについて

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

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（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12～22ページに併せて掲載いたしました。

■トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

株　　式

（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
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	ＮＴＴ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（137,575,273千口）の内容です。

(1)国内株式

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
水産・農林業（0.1%）		
極洋	2.7	7,279
日本水産	82.5	55,027
マルハニチロ	11.9	37,663
カネコ種苗	2.4	3,064
サカタのタネ	10.1	32,976
ホクト	6.9	12,530
ホクリヨウ	1.1	658
鉱業（0.3%）		
住石ホールディングス	18.1	2,172
日鉄鉱業	1.9	8,569
三井松島 HLDGS	3.4	4,511
国際石油開発帝石	331.1	305,770
石油資源開発	11.9	27,524
K&O エナジーグループ	4	6,456
建設業（2.9%）		
ヒノキヤグループ	2.3	5,050

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ショーボンドＨＤ	5.9	45,843
ミライト・ホールディングス	23.2	38,720
タマホーム	4.4	4,769
サンヨーホームズ	1.4	919
日本アクア	2.6	1,300
ファーストコーポレーション	2.4	1,860
ベステラ	1.6	2,072
スペースバリューHD	10	4,980
ダイセキ環境ソリューション	1.5	925
第一カッター興業	1	1,777
安藤・間	52.9	39,992
東急建設	24.1	17,858
コムシスホールディングス	29.3	79,403
ミサワホーム	6.8	6,942
ビーアールホールディングス	8.8	2,904
高松コンストラクション GP	5.1	11,577
東建コーポレーション	2.5	16,600

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ソネック	0.8	625
ヤマウラ	3	2,544
大成建設	67.8	274,590
大林組	204.1	211,651
清水建設	208.2	190,503
飛島建設	5.8	7,679
長谷工コーポレーション	85.1	93,269
松井建設	7.4	4,676
錢高組	0.8	3,460
鹿島建設	159.6	240,517
不動テトラ	5	6,720
大末建設	2.4	2,215
鉄建建設	4.1	12,423
西松建設	14.6	31,127
三井住友建設	49.2	30,012
大豊建設	4.6	12,544
前田建設	48.5	42,292

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
佐田建設	4.6	1,697
ナカノフドー建設	5	2,160
奥村組	11.2	37,464
東鉄工業	8.2	24,764
イチケン	1.2	1,963
富士ピー・エス	2.7	1,225
淺沼組	2.4	8,364
戸田建設	78.8	47,043
熊谷組	9.7	29,730
青木あすなろ建設	3.6	2,919
北野建設	1.4	3,725
植木組	0.8	1,708
矢作建設	9.1	6,697
ピーエス三菱	7	4,347
日本ハウス HLDGS	12.9	5,276
大東建託	24.2	336,622
新日本建設	8.2	7,355

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ＮＩＰＰＯ	18	38,502
東亜道路	1.2	3,762
前田道路	21.3	46,199
日本道路	1.8	11,358
東亜建設	5.9	8,891
日本国土開発	11.1	5,638
若築建設	3.4	4,535
東洋建設	24.9	10,482
五洋建設	80.9	41,501
世紀東急	9.9	6,088
福田組	2.2	10,065
住友林業	48.3	60,568
日本基礎技術	6.8	2,414
巴コーポレーション	8.3	3,037
大和ハウス	188.5	631,852
ライト工業	13.1	18,785
積水ハウス	208.3	374,315
日特建設	5.7	3,397
北陸電気工事	3.3	2,900
ユアテック	11	8,283
四電工	1	2,685
中電工	8.8	20,037
関電工	31	27,714
きんでん	45.3	75,243
東京エネシス	6.9	6,327
トーエネック	1.9	5,738
住友電設	4.7	8,154
日本電設工業	11.6	25,705
協和エクシオ	26.7	71,422
新日本空調	5.7	9,769
九電工	13.4	42,813
三機工業	15.3	19,094
日揮	58.6	83,387
中外炉工業	1.9	3,097
ヤマト	6.1	3,483
太平電業	4.6	9,600
高砂熱学	16.5	28,825
三晃金属	0.8	1,944
朝日工業社	1.4	3,719
明星工業	12.3	8,154
大氣社	9.3	30,364
ダイダン	4.5	9,846
日比谷総合設備	6.1	11,370
東芝プラントシステム	14.7	30,032
ＯＳＪＢ ＨＤ	29.9	8,043
東洋エンジニア	8	3,744
千代田化工建	49	15,778
新興プランテック	12.2	16,323
食料品（4.2%）		
日本製粉	19.3	34,083
日清製粉Ｇ本社	69	173,949
日東富士製粉	0.4	2,244
昭和産業	5.6	17,248
鳥越製粉	5.3	4,441
中部飼料	7.4	8,843
フィード・ワン	40.9	7,321
東洋精糖	0.9	886
日本甜菜糖	3.4	6,514
三井製糖	4.8	11,179
塩水港精糖	6.5	1,345
日新製糖	2.9	5,307
森永製菓	15.3	80,019
中村屋	1.6	6,720
江崎グリコ	18.3	88,663
名糖産業	2.9	4,120
井村屋グループ	2.6	5,449
不二家	3.4	6,701
山崎製パン	49.9	76,596
第一屋製パン	1.1	1,111
モロゾフ	1	4,860
亀田製菓	3.8	18,221
寿スピリッツ	6.5	33,930
カルビー	27.8	82,593
森永乳業	12.2	53,436
六甲バター	4.4	8,544
ヤクルト	45.2	287,924
明治ホールディングス	43.2	331,776
雪印メグミルク	14.7	34,530
プリマハム	8.6	17,303
日本ハム	25.2	118,440
林兼産業	1.8	1,090
丸大食品	6.5	12,421
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	5.5	20,212
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	39.3	27,195
サッポロホールディングス	22.3	50,754
アサヒグループホールディン	127.7	627,900
キリンＨＤ	275.9	632,500
宝ホールディングス	45.7	51,869
オエノンホールディングス	17.1	6,190
養命酒	1.9	3,832
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	46.7	126,603
サントリー食品インター	40.8	186,660
ダイドーグループＨＤ	3.4	15,606
伊藤園	18.5	96,755
キーコーヒー	6	12,612
ユニカフェ	1.8	1,767
ジャパンフーズ	0.8	957
日清オイリオグループ	7.8	24,414
不二製油グループ	14.9	46,413
かどや製油	0.7	2,733
Ｊ－オイルミルズ	3.1	12,632
キッコーマン	40.3	186,992
味の素	134.7	254,919
キユーピー	34	81,464
ハウス食品Ｇ本社	22.8	95,760
カゴメ	24.4	60,097
焼津水産化工	2.9	3,178
アリアケジャパン	5.6	38,976
ピエトロ	0.7	1,127
エバラ食品工業	1.4	2,986
ニチレイ	31.7	87,301
東洋水産	31.4	136,747
イートアンド	2.1	3,469
大冷	0.7	1,276
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	1.6	1,504
日清食品ＨＤ	25.9	174,825
永谷園ホールディングス	3.3	7,042
一正蒲鉾	2.3	2,601
フジッコ	6.6	13,556
ロックフィールド	6.5	9,373
日本たばこ産業	352.2	880,147
ケンコーマヨネーズ	3.4	7,605
わらべや日洋ＨＤ	4	6,676
なとり	3.3	5,141
イフジ産業	1	656
ピックルスコーポレーション	1.4	2,690
北の達人コーポ	23.9	13,718
ユーグレナ	26	25,064
ミヨシ油脂	2.8	2,954
理研ビタミン	2.9	10,005
繊維製品（0.7%）		
片倉工業	7.2	9,288
グンゼ	4	19,220
東洋紡	25.1	30,647
ユニチカ	17.4	6,333
富士紡ホールディングス	3.1	7,105
倉敷紡績	5.6	10,931
シキボウ	3.2	3,065
日本毛織	19.7	17,020
ダイトウボウ	12.7	1,041
トーア紡コーポレーション	2.6	1,185
ダイドーリミテッド	6.9	2,090
帝国繊維	6.7	15,188
帝人	48.5	87,057
東レ	461.7	373,376
サカイ オーベックス	1.4	2,332
住江織物	1.7	4,958
日本フエルト	3.2	1,504
イチカワ	0.8	1,257
日東製網	0.6	889
アツギ	4.8	4,344
ダイニック	2.4	1,740
セーレン	14.6	21,462
ソトー	2.2	2,147
東海染工	0.8	912
小松マテーレ	9.7	7,643
ワコールホールディングス	17.3	48,024
ホギメディカル	7.4	24,827
レナウン	16.7	1,653
クラウディア ＨＬＤＧＳ	1.4	701
ＴＳＩホールディングス	21.8	14,257
マツオカコーポレーション	1.9	4,940
ワールド	7.8	16,473
三陽商会	3.6	5,583
ナイガイ	2	952
オンワードホールディングス	35.5	20,909
ルックホールディングス	2.1	2,746
ゴールドウイン	5.4	73,656
デサント	14.5	27,579
キング	3	1,830
ヤマトインターナショナル	3.7	1,528
パルプ・紙（0.3%）		
特種東海製紙	3.8	14,383
王子ホールディングス	267.9	161,007
日本製紙	28.5	53,181
三菱製紙	9.8	5,311
北越コーポレーション	39.4	21,867
中越パルプ	2.6	3,796
巴川製紙	1.9	1,782
大王製紙	29	35,641
阿波製紙	1.5	649
レンゴー	61.3	52,901
トーモク	3.7	6,190
ザ・パック	4.5	13,927
化学（7.4%）		
クラレ	100.3	127,681
旭化成	423.3	476,635
共和レザー	3.6	2,800
昭和電工	39.5	120,870
住友化学	468.3	224,784
住友精化	2.9	9,338
日産化学	36.3	173,332
ラサ工業	2.1	2,776
クレハ	5.5	40,975
多木化学	1.8	7,767
テイカ	4.8	11,736
石原産業	11.3	14,147
片倉コープアグリ	2.2	2,356
日東エフシー	3.8	4,563
日本曹達	9.3	24,384
東ソー	91.9	131,508
トクヤマ	17.1	42,459
セントラル硝子	13	30,615
東亞合成	37.2	43,970
大阪ソーダ	6.4	17,241
関東電化	14	10,276
デンカ	23.4	73,593
信越化学	104.9	966,863

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
日本カーバイド	2	2,624
堺化学	3.9	9,621
第一稀元素化学工	6.4	5,305
エア・ウォーター	48.6	87,625
大陽日酸	49	112,504
日本化学工業	2	3,666
東邦アセチレン	1	1,332
日本パーカライジング	32.5	39,162
高圧ガス	9.5	7,619
チタン工業	0.8	2,303
四国化成	9.9	10,791
戸田工業	1.3	2,753
ステラ ケミファ	3.5	10,493
保土谷化学	2	5,126
日本触媒	10	70,300
大日精化	4.9	13,822
カネカ	15.4	60,522
三菱瓦斯化学	60.8	82,931
三井化学	54	139,212
ＪＳＲ	59.7	97,967
東京応化工業	10.2	33,915
大阪有機化学	5.4	5,248
三菱ケミカル HLDGS	397.8	291,070
ＫＨネオケム	9	24,201
ダイセル	87.6	83,833
住友ベークライト	10.3	38,213
積水化学	129.4	206,910
日本ゼオン	53.7	62,023
アイカ工業	17.8	65,949
宇部興産	30	63,090
積水樹脂	9.8	20,501
タキロンシーアイ	12.9	8,565
旭有機材	4.1	5,514
日立化成	27.5	82,087
ニチバン	3.1	6,903
リケンテクノス	16.3	7,938
大倉工業	3	5,106
積水化成品	8.9	6,390
群栄化学	1.6	3,969
タイガース ポリマー	3.1	1,776
ミライアル	1.7	2,033
ダイキアクシス	2.1	1,873
ダイキョーニシカワ	12.5	10,362
竹本容器	2.1	2,526
森六ホールディングス	3.1	7,505
日本化薬	37.6	48,391
カーリットホールディングス	6.3	4,076
日本精化	4.9	6,002
扶桑化学工業	6	12,396
トリケミカル	1.3	5,798
ＡＤＥＫＡ	29.2	46,019
日油	22.4	91,280
新日本理化	11.3	2,395
ハリマ化成グループ	5	4,965
花王	147.5	1,250,062
第一工業製薬	2.2	7,656
石原ケミカル	1.6	2,531
日華化学	2.1	1,803
ニイタカ	0.9	1,300
三洋化成	4	22,760
有機合成薬品	6.7	1,467
大日本塗料	7	7,434
日本ペイント HOLD	49.1	208,920
関西ペイント	66.8	146,759
神東塗料	7.9	1,343
中国塗料	19.4	17,789
日本特殊塗料	4.4	5,478
藤倉化成	8.2	4,592
太陽ホールディングス	4.9	15,925
ＤＩＣ	26.9	74,862
サカタインクス	12.9	12,551
東洋インキ SC ホールディン	12.5	28,750
Ｔ＆Ｋ ＴＯＫＡ	4.7	4,516
富士フイルム HLDGS	126.2	679,460
資生堂	120.8	1,033,202
ライオン	84.6	172,245
高砂香料	4.1	11,939
マンダム	13.7	36,140
ミルボン	7.5	39,525
ファンケル	27.1	78,400
コーセー	10.3	184,885
コタ	3.2	3,782
シーボン	0.7	1,666
ポーラ・オルビス HD	25.9	78,606
ノエビアホールディングス	5.8	33,582
アジュバンコスメジャパン	1.3	1,212
エステー	4.3	7,327
アグロカネショウ	2.4	4,941
コニシ	10.7	16,606
長谷川香料	8	14,560
星光ＰＭＣ	4.3	3,272
小林製薬	17	133,110
荒川化学工業	5.4	7,063
メック	4.1	4,255
日本高純度化学	2	4,718
タカラバイオ	15.9	32,149
ＪＣＵ	7.8	15,233
新田ゼラチン	3.9	2,667
ＯＡＴアグリオ	0.8	1,073
デクセリアルズ	15.5	10,788
アース製薬	4.6	22,172
北興化学	6.5	3,081
大成ラミック	2	5,594
クミアイ化学	25	17,625
日本農薬	11.9	4,855
アキレス	4.4	8,659
有沢製作所	9.5	7,771
日東電工	41.9	211,301
レック	6.5	7,800
三光合成	6.9	2,214
きもと	10.1	1,595
藤森工業	5.4	15,022
前澤化成工業	4.2	4,599
未来工業	3.2	6,531
ウェーブロック HLDGS	1.6	1,059
ジェイ エス ピー	3.6	7,340
エフピコ	6.7	45,091
天馬	4.2	7,413
信越ポリマー	10.9	8,349
東リ	14.8	3,655
ニフコ	24.4	67,197
バルカー	4.9	10,598
ユニ・チャーム	128.9	437,099
ショーエイコーポ	0.4	300
医薬品（5.6%）		
協和発酵キリン	71.3	144,525
武田薬品	530.5	1,961,258
アステラス製薬	552.4	806,780
大日本住友製薬	45	92,700
塩野義製薬	77.7	474,747
田辺三菱製薬	63.5	79,375
わかもと製薬	7.1	1,860
あすか製薬	7.5	8,985
日本新薬	15.9	131,334
ビオフエルミン製薬	1	2,282
中外製薬	63.3	443,733
科研製薬	10.9	56,571
エーザイ	72.7	455,320
ロート製薬	31.2	93,756
小野薬品	143.5	279,968
久光製薬	17.9	77,328
持田製薬	9.2	43,608
参天製薬	113.1	189,555
扶桑薬品	2.1	4,132
日本ケミファ	0.8	2,337
ツムラ	18.8	56,118
日医工	15.9	18,968
キッセイ薬品工業	10.7	27,991
生化学工業	11.7	14,344
栄研化学	10.6	18,889
日水製薬	2.5	2,982
鳥居薬品	3.2	8,067
ＪＣＲファーマ	4.3	27,262
東和薬品	8.7	24,220
富士製薬工業	4.1	5,748
沢井製薬	12.5	73,500
ゼリア新薬工業	12	25,968
第一三共	173.9	1,059,572
キョーリン製薬ＨＤ	13.4	24,924
大幸薬品	2.7	5,794
ダイト	3.5	12,285
大塚ホールディングス	115.8	415,606
大正製薬ＨＤ	13.5	112,050
ペプチドリーム	30.4	169,328
石油・石炭製品（0.6%）		
日本コークス工業	51.2	4,710
ニチレキ	7.8	7,901
ユシロ化学	3.1	4,141
ビーピー・カストロール	2.2	3,216
富士石油	14.4	3,729
ＭＯＲＥＳＣＯ	2.4	3,583
出光興産	70.2	212,004
JXTG ホールディングス	1,022.1	522,190
コスモエネルギーHLDGS	17.6	38,438
ゴム製品（0.8%）		
横浜ゴム	35.2	68,921
TOYO TIRE	31.2	46,831
ブリヂストン	186.8	789,043
住友ゴム	54.6	67,212
藤倉コンポジット	5.3	2,104
オカモト	4.2	20,181
フコク	2.6	1,911
ニッタ	6.9	20,651
住友理工	11.9	9,520
三ツ星ベルト	8	15,056
バンドー化学	11.6	10,811
ガラス・土石製品（0.8%）		
日東紡績	9.1	19,483
ＡＧＣ	60.1	215,759
日本板硝子	29.2	20,761
石塚硝子	1	2,195
日本山村硝子	2.5	3,522
日本電気硝子	26.3	69,247
オハラ	2.4	3,408
住友大阪セメント	12.3	53,874
太平洋セメント	38.4	124,608
日本ヒユーム	6.1	4,428
日本コンクリート	12.9	3,728
三谷セキサン	2.8	8,094
アジアパイルＨＤ	8.6	5,099
東海カーボン	55.2	61,713
日本カーボン	2.9	12,180
東洋炭素	3.6	7,560
ノリタケ	3.6	16,236
ＴＯＴＯ	46.8	195,390
日本碍子	74.2	110,706
日本特殊陶業	51.3	99,368
ダントーホールディングス	5.6	621

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ＭＡＲＵＷＡ	2.1	10,290
品川リフラクトリーズ	1.6	4,737
黒崎播磨	1.2	7,152
ヨータイ	5.2	2,891
イソライト	3.1	1,391
東京窯業	7.7	2,263
ニッカトー	2.7	1,768
フジミインコーポレーテッド	5.4	11,566
クニミネ工業	2.6	2,067
エーアンドエーマテリアル	1.1	1,111
ニチアス	16.6	31,208
ニチハ	8.4	24,225
鉄鋼（0.9%）		
日本製鉄	279.4	510,882
神戸製鋼所	110	74,690
中山製鋼所	8.3	3,793
合同製鐵	2.9	5,753
ＪＦＥホールディングス	162.3	245,073
東京製鐵	32.1	26,739
共英製鋼	6.8	12,212
大和工業	12.8	39,040
東京鐵鋼	2.5	3,092
大阪製鐵	4	6,348
淀川製鋼所	8.1	16,548
丸一鋼管	21.3	60,811
モリ工業	1.8	3,414
大同特殊鋼	9.8	38,759
日本高周波	2.1	938
日本冶金工	49.7	10,486
山陽特殊製鋼	7.6	11,042
愛知製鋼	3.4	10,540
日立金属	64.8	79,185
日本金属	1.4	1,237
大平洋金属	4	8,404
新日本電工	35.4	6,938
栗本鉄工所	3.1	4,116
虹技	0.8	995
日本鋳鉄管	0.5	313
三菱製鋼	4.5	5,220
日亜鋼業	8.5	2,813
日本精線	0.8	2,070
エンビプロＨＤ	2.2	1,344
シンニッタン	9.2	2,953
新家工業	1.3	1,891
非鉄金属（0.7%）		
大紀アルミニウム	9.8	7,232
日本軽金属ＨＤ	163.8	38,329
三井金属	16.2	39,398
東邦亜鉛	3.3	7,847
三菱マテリアル	39.7	117,551
住友鉱山	82.3	238,670
DOWA ホールディングス	14	48,510

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
古河機金	9.9	13,731
エス・サイエンス	26.4	1,610
大阪チタニウム	6.9	11,957
東邦チタニウム	10.8	12,160
ＵＡＣＪ	9.1	15,342
ＣＫサンエツ	1.1	3,042
古河電工	17.3	52,332
住友電工	224.9	305,189
フジクラ	72.7	26,753
昭和電線 HLDGS	7	5,474
東京特殊電線	0.8	1,337
タツタ電線	11.9	5,569
カナレ電気	1	1,908
平河ヒューテック	2.5	2,867
リョービ	7.4	15,007
アーレステイ	7.2	3,780
アサヒＨＤ	11.2	24,684
金属製品（0.5%）		
稲葉製作所	3.3	4,811
宮地エンジニアリングＧ	1.8	3,213
トーカロ	15.5	11,671
アルファ CO	2.1	2,597
ＳＵＭＣＯ	66.4	79,746
川田テクノロジーズ	1.3	10,946
RS TECHNOLOGIES	1.2	3,040
信和	3.1	2,951
東洋製罐グループＨＤ	38.3	85,677
ホッカンホールディングス	3	5,163
コロナ	3.3	3,230
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	11.2	18,681
駒井ハルテック	1.1	1,794
高田機工	0.5	1,246
三和ホールディングス	62.1	68,744
文化シヤッター	17.6	14,256
三協立山	8.3	9,412
アルインコ	4.7	4,427
東洋シヤッター	1.4	897
ＬＩＸＩＬグループ	88.7	132,872
日本フイルコン	4.4	2,217
ノーリツ	13.4	18,049
長府製作所	6.1	13,218
リンナイ	10.7	73,509
ダイニチ工業	3.1	1,841
日東精工	8.3	4,714
三洋工業	0.8	1,417
岡部	12.2	11,748
ジーテクト	6.6	9,939
中国工業	0.9	461
東プレ	11.2	19,521
高周波熱錬	11.6	9,546
東京製綱	3.7	3,744
サンコール	3.3	1,673

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
モリテックスチル	4.6	1,807
パイオラックス	9.6	17,798
エイチワン	5.8	4,373
日本発条	59.9	48,998
中央発條	0.7	2,027
アドバネクス	0.8	1,284
立川ブラインド	2.6	3,299
三益半導体	5.3	8,225
機械（5.0%）		
日本ドライケミカル	1.5	1,651
日本製鋼所	18.2	32,778
三浦工業	26	85,410
タクマ	21.9	30,046
ツガミ	13.5	11,191
オークマ	7.7	40,579
東芝機械	6.8	16,408
アマダホールディングス	90.3	104,748
アイダエンジニア	16.2	12,328
滝澤鉄工所	1.8	2,511
ＦＵＪＩ	24	28,944
牧野フライス	7.1	28,258
オーエスジー	29.6	61,893
ダイジェット	0.7	863
旭ダイヤモンド	15.7	9,796
DMG 森精機	38.1	58,102
ソディツク	13.1	11,816
ディスコ	8.1	122,634
日東工器	3.3	7,088
日進工具	1.8	3,706
パンチ工業	4.1	1,935
冨士ダイス	2.6	1,466
豊和工業	3.3	2,742
ＯＫＫ	2.5	1,792
石川製作所	1.4	2,007
東洋機械金属	4.2	2,419
津田駒工業	1.3	1,994
エンシュウ	1.5	1,642
島精機製作所	8.3	24,941
オプトラン	5.9	12,567
NC ホールディングス	1.8	887
イワキポンプ	2.5	2,635
フリュー	4.7	5,273
ヤマシンフィルタ	10.4	6,354
日阪製作所	7.4	6,556
やまびこ	11.6	10,683
平田機工	2.8	14,588
ペガサスミシン製造	5.6	3,024
マルマエ	2.4	1,615
タツモ	2.5	1,872
ナブテスコ	33.1	95,493
三井海洋開発	6.4	17,875
レオン自動機	5.9	10,348

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ＳＭＣ	17.8	667,500
新川	4.5	1,597
ホソカワミクロン	2.1	9,345
ユニオンツール	2.6	7,077
オイレス工業	8.4	12,776
日精エーエスビー	2	4,908
サトーホールディングス	7.2	19,094
技研製作所	5.3	17,437
日本エアーテック	1.8	1,044
カワタ	1.6	1,606
日精樹脂工業	5	4,460
オカダアイヨン	2	2,418
ワイエイシイホールディングス	2.3	1,888
小松製作所	275.2	668,736
住友重機械	34.8	122,322
日立建機	24.4	68,759
日工	1.6	4,312
巴工業	2.5	6,067
井関農機	6.1	8,753
ＴＯＷＡ	5.1	3,830
丸山製作所	1.3	1,394
北川鉄工所	2.7	5,583
ローツェ	2.7	5,761
タカキタ	2	1,106
クボタ	325.6	572,242
荏原実業	1.7	3,396
三菱化工機	2	3,368
月島機械	12	14,688
帝国電機製作所	4.2	5,308
東京機械	2.4	998
新東工業	14.4	13,464
渋谷工業	5.3	14,898
アイチ コーポレーション	10.4	7,020
小森コーポレーション	15.3	17,625
鶴見製作所	4.7	9,089
住友精密	1	2,763
酒井重工業	1.1	2,750
荏原製作所	26.9	77,176
石井鉄工所	1.1	2,183
酉島製作所	6.2	6,510
北越工業	6.2	7,526
ダイキン工業	82.9	1,148,579
オルガノ	2.2	7,645
トーヨーカネツ	2.3	4,634
栗田工業	32.9	83,533
椿本チエイン	8	26,440
大同工業	3	2,481
木村化工機	4.9	1,651
アネスト岩田	9.5	8,949
ダイフク	33.4	192,384
サムコ	1.6	1,256
加藤製作所	3.1	6,032

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
油研工業	1	1,604
タダノ	29.3	30,940
フジテック	22.1	31,271
ＣＫＤ	16.9	16,849
キトー	4.6	7,728
平和	16.9	37,568
理想科学工業	5.4	9,034
ＳＡＮＫＹＯ	15.2	62,928
日本金銭機械	6.7	7,470
マースグループHLDGS	3.8	7,763
福島工業	3.8	13,148
オーイズミ	2.8	1,072
ダイコク電機	2.8	3,572
竹内製作所	10.2	18,788
アマノ	17.4	51,103
ＪＵＫＩ	8.4	7,728
サンデンホールディングス	7.3	3,664
蛇の目ミシン	5.6	2,447
マックス	9.2	14,066
グローリー	16.8	47,124
新晃工業	5.5	8,816
大和冷機工業	8.7	9,657
セガサミーホールディングス	60.3	78,088
日本ピストンリング	2.2	3,025
リケン	2.8	11,354
ＴＰＲ	8.1	14,166
ツバキ・ナカシマ	9.3	15,689
ホシザキ	17.7	137,706
大豊工業	4.9	3,831
日本精工	124.9	112,035
ＮＴＮ	131.1	39,461
ジェイテクト	58.4	71,072
不二越	5.7	23,854
日本トムソン	18	8,082
ＴＨＫ	37.9	92,097
ユーシン精機	4.7	4,526
前澤給装工業	2.4	4,658
イーグル工業	7.5	7,462
前澤工業	4.3	1,505
日本ピラー工業	6.1	6,405
キッツ	24.6	17,515
マキタ	74	250,860
日立造船	48.2	17,207
三菱重工業	101.8	472,962
ＩＨＩ	46.7	120,392
スター精密	10.3	13,977
電気機器（13.2%）		
日清紡ホールディングス	33.7	27,195
イビデン	37.2	66,253
コニカミノルタ	132.8	134,659
ブラザー工業	79.2	148,975
ミネベアミツミ	112.8	187,135

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
日立	273.5	1,084,974
三菱電機	607.5	828,022
富士電機	39.4	144,795
東洋電機製造	2.7	3,677
安川電機	70.5	230,887
シンフォニアテクノロジー	8.3	9,711
明電舎	11.8	18,537
オリジン	1.6	2,262
山洋電気	2.9	11,962
デンヨー	5.8	8,241
東芝テック	7.6	20,732
芝浦メカトロニクス	1.1	2,833
マブチモーター	16.8	61,236
日本電産	73.1	1,017,186
ユーエムシーエレクトロニクス	3.3	4,075
トレックス・セミコンダクター	2.7	3,148
東光高岳	3.4	4,001
ダブル・スコープ	8.9	14,284
宮越ホールディングス	2.4	2,181
ダイヘン	6.5	20,800
ヤーマン	8.8	7,717
ＪＶＣケンウッド	46.4	10,857
ミマキエンジニアリング	5.4	3,402
第一精工	2.5	3,242
日新電機	14.1	16,088
大崎電気	12.4	8,246
オムロン	64.6	343,026
日東工業	9.9	19,522
ＩＤＥＣ	8.2	15,981
正興電機製作所	0.9	696
不二電機工業	0.6	735
ジーエス・ユアサ コーポ	21.9	43,887
サクサホールディングス	1.5	2,860
メルコホールディングス	2.5	7,612
テクノメディカ	1.4	3,029
日本電気	78.6	317,544
富士通	58.6	442,723
沖電気	26.3	34,111
岩崎通信機	2.8	2,198
電気興業	3.2	10,176
サンケン電気	7.1	15,726
ナカヨ	1.1	1,712
アイホン	3.4	5,922
ルネサスエレクトロニクス	63.8	31,963
セイコーエプソン	75.4	124,334
ワコム	44	14,828
アルバック	12.1	37,268
アクセル	2.5	1,355
ＥＩＺＯ	5.6	21,224
ジャパンディスプレイ	141.7	7,510
日本信号	15.1	17,274
京三製作所	12.4	4,327

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
能美防災	7.9	17,553
ホーチキ	3.9	4,742
星和電機	3	1,488
エレコム	5.8	19,807
パナソニック	694	595,174
シャープ	60.3	64,279
アンリツ	39.1	72,061
富士通ゼネラル	18.6	29,964
ソニー	407.8	2,297,953
ＴＤＫ	31.8	240,726
帝国通信工業	2.6	2,961
タムラ製作所	23.4	12,846
アルプスアルパイン	63.3	113,686
池上通信機	1.9	2,033
日本電波工業	5.5	2,508
鈴木	3.2	1,964
日本トリム	1.1	5,676
ローランドディー．ジー．	3.1	7,371
フオスター電機	7	10,122
ＳＭＫ	1.7	4,488
ヨコオ	4.3	8,952
ティアック	4.2	781
ホシデン	17.9	19,815
ヒロセ電機	8.7	100,659
日本航空電子	13.9	20,794
ＴＯＡ	6.5	8,378
マクセルホールディングス	13	22,984
古野電気	7.8	7,324
ユニデンホールディングス	1.8	3,232
スミダコーポレーション	5.2	5,798
アイコム	3.3	7,880
リオン	2.8	5,950
本多通信工業	5.1	2,570
船井電機	6.1	4,794
横河電機	60.8	124,032
新電元工業	2.1	7,255
アズビル	38.8	98,513
東亜ディーケーケー	2.9	2,430
日本光電工業	26.8	84,018
チノー	2	2,288
共和電業	6.3	2,620
日本電子材料	2.4	1,190
堀場製作所	12	61,800
アドバンテスト	41.4	104,700
小野測器	2.6	1,443
エスペック	5.3	11,607
キーエンス	29.8	1,846,706
日置電機	3.2	11,088
シスメックス	47.4	366,970
日本マイクロニクス	10.6	9,699
メガチップス	4.8	6,139
OBARA GROUP	3.2	11,968

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
澤藤電機	0.7	1,130
原田工業	2.4	1,888
コーセル	8	8,392
イリソ電子工業	5.6	29,456
オプテックスグループ	10.6	13,228
千代田インテグレ	2.6	5,202
アイ・オー・データ	2.4	2,544
レーザーテック	12.4	45,508
スタンレー電気	42.9	107,121
岩崎電気	2.8	3,645
ウシオ電機	35.2	47,449
岡谷電機	4.3	1,599
ヘリオステクノＨ	5.5	3,245
エノモト	1.6	1,182
日本セラミック	6.1	16,884
遠藤照明	3.5	2,583
古河電池	5	3,215
双信電機	2.9	1,490
山一電機	4.4	3,929
図研	3.9	6,130
日本電子	12	29,112
カシオ	53.8	71,231
ファナック	57.7	1,112,456
日本シイエムケイ	15.4	9,594
エンプラス	2.7	8,343
大真空	2.2	2,358
ローム	29.1	197,007
浜松ホトニクス	43.6	173,310
三井ハイテック	6.7	6,988
新光電気工業	20.4	18,421
京セラ	92.6	638,754
太陽誘電	27	48,465
村田製作所	191.3	883,040
ユーシン	1.4	1,376
双葉電子工業	9.9	13,612
北陸電気工業	2.2	2,076
ニチコン	19.1	15,184
日本ケミコン	4.3	6,321
ＫＯＡ	9.1	11,648
市光工業	9.1	5,614
小糸製作所	36.4	198,016
ミツバ	11.1	6,471
SCREENホールディングス	10.5	41,055
キヤノン電子	5.6	10,253
キヤノン	327.2	1,030,352
リコー	182.7	195,489
象印マホービン	15.1	17,546
MUTOHホールディングス	0.8	1,380
東京エレクトロン	40.5	577,732
輸送用機器（7.9%）		
トヨタ紡織	21.2	29,446
芦森工業	1.2	1,950

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ユニプレス	11.8	20,567
豊田自動織機	49.2	284,376
モリタホールディングス	10.6	19,705
三桜工業	7.6	3,078
デンソー	133.8	596,748
東海理化電機	16	26,960
三井E&SHD	21.7	20,159
川崎重工業	47.3	117,540
名村造船所	18.1	5,665
サノヤスホールディングス	7.9	1,801
日本車輌	2.2	5,471
三菱ロジスネクスト	7.2	8,366
近畿車輌	0.9	1,594
日産自動車	716.8	543,262
いすゞ自動車	192.1	235,322
トヨタ自動車	677.2	4,555,524
日野自動車	75.9	67,019
三菱自動車工業	225	112,500
エフテック	4.2	3,049
レシップホールディングス	3.9	3,112
GMB	1.1	898
ファルテック	1	784
武蔵精密工業	14.8	19,965
日産車体	11.9	12,340
新明和工業	25.4	33,324
極東開発工業	12	15,408
日信工業	11.1	15,495
トピー工業	5	12,070
ティラド	2.2	3,986
タチエス	10.1	12,938
NOK	32.7	47,676
フタバ産業	16.9	9,278
KYB	6.3	18,232
大同メタル工業	9.9	6,326
プレス工業	30	14,010
ミクニ	7.6	2,850
太平洋工業	12.7	18,186
ケーヒン	13.9	20,655
河西工業	7.4	5,476
アイシン精機	50	180,500
マツダ	190.7	210,532
今仙電機製作所	5.6	5,112
本田技研	512.7	1,422,742
スズキ	111.2	575,682
SUBARU	188.6	484,419
安永	2.9	4,147
ヤマハ発動機	85.8	161,475
ショーワ	14.3	19,705
TBK	7	2,695
エクセディ	8.3	17,994
豊田合成	19.6	38,925
愛三工業	9.5	6,393
盟和産業	1	1,034
日本プラスト	4.6	3,072
ヨロズ	5.7	7,449
エフ・シー・シー	10.9	24,993
シマノ	24.5	404,985
テイ・エス テック	14.1	39,494
ジャムコ	3	6,468
精密機器（2.1%）		
テルモ	172	556,764
クリエートメディック	1.9	1,759
日機装	19.6	28,086
島津製作所	78.2	219,429
JMS	5.4	3,672
クボテック	1.2	427
長野計器	4.7	3,360
ブイ・テクノロジー	2.8	12,488
東京計器	3.9	3,541
愛知時計	0.8	3,304
インターアクション	3.2	4,396
オーバル	5.8	1,363
東京精密	11	27,412
マニー	8.1	54,675
ニコン	105.9	158,638
トプコン	32.6	41,728
オリンパス	362.1	446,469
理研計器	5.3	10,398
タムロン	5.4	11,674
HOYA	122.3	979,623
シード	2.6	2,748
ノーリツ鋼機	4.8	9,292
エー・アンド・デイ	5.5	4,273
朝日インテック	25.8	136,482
シチズン時計	66.6	34,965
リズム時計	2	2,540
大研医器	4.8	3,096
メニコン	8.3	30,710
シンシア	0.9	533
松風	2.9	3,813
セイコーHD	9.4	19,909
ニプロ	42	49,980
その他製品（2.1%）		
中本パックス	1.7	2,514
スノーピーク	2.3	3,132
パラマウントベッドHD	7	29,925
トランザクション	3.8	3,203
SHO-BI	1.7	629
ニホンフラッシュ	2.6	6,916
前田工繊	6.7	13,158
永大産業	7.7	2,564
アートネイチャー	6.4	3,968
バンダイナムコHLDGS	62.8	339,120
アイフィスジャパン	1.3	809
共立印刷	10.2	1,897
SHOEI	2.9	12,847
フランスベッドHLDGS	8.5	8,338
パイロットコーポレーション	10.6	44,202
萩原工業	3.3	4,372
トッパン・フォームズ	12.9	11,274
フジシールインターナショナル	13.6	44,744
タカラトミー	25.4	33,782
廣済堂	5.5	3,652
エステールホールディングス	1.5	904
アーク	23.5	2,420
タカノ	2.4	1,869
プロネクサス	5.2	5,974
ホクシン	3.7	481
ウッドワン	2	1,992
大建工業	4.6	9,995
凸版印刷	85.8	140,626
大日本印刷	85.6	205,953
図書印刷	5.7	7,449
共同印刷	1.9	5,263
NISSHA	12.5	13,400
光村印刷	0.5	1,039
宝印刷	3.1	4,916
アシックス	57.3	69,562
ツツミ	1.9	3,896
小松ウオール工業	1.8	3,186
ヤマハ	36.1	184,832
河合楽器	1.9	5,688
クリナップ	5.7	3,043
ピジョン	36.7	156,892
兼松サステック	0.4	651
キングジム	4.9	4,155
リンテック	14.5	32,088
イトーキ	11.1	4,728
任天堂	34.8	1,303,260
三菱鉛筆	10	17,890
タカラスタンダード	12.5	20,887
コクヨ	29.1	42,369
ナカバヤシ	5.9	2,979
グローブライド	2.9	9,816
オカムラ	21.2	21,708
美津濃	6	15,024
電気・ガス業（1.7%）		
東京電力HD	485.1	276,021
中部電力	185.9	284,705
関西電力	248	308,760
中国電力	84	114,828
北陸電力	59.5	47,421
東北電力	142.3	157,953
四国電力	54.7	54,098
九州電力	125.3	133,569
北海道電力	56.8	34,477
沖縄電力	11.2	18,961
電源開発	48.4	119,064
エフオン	3.6	2,718
イーレックス	10.5	12,148
レノバ	10	8,150
東京瓦斯	119.2	314,509
大阪瓦斯	117.9	224,127
東邦瓦斯	30.1	124,915
北海道瓦斯	3.1	4,640
広島ガス	12.4	4,116
西部瓦斯	6.8	14,830
静岡ガス	18.7	15,240
メタウォーター	2.9	9,512
陸運業（4.9%）		
SBSホールディングス	6.1	9,241
東武鉄道	64.1	201,594
相鉄ホールディングス	20.8	62,712
東京急行	165	322,080
京浜急行	83.2	156,083
小田急電鉄	97.3	261,542
京王電鉄	34	249,220
京成電鉄	45.6	183,996
富士急行	8.3	33,283
新京成電鉄	1.5	3,031
東日本旅客鉄道	108.1	1,109,646
西日本旅客鉄道	54.5	478,510
東海旅客鉄道	54.4	1,237,056
西武ホールディングス	75.2	136,638
鴻池運輸	9.7	16,480
西日本鉄道	16.8	39,513
ハマキョウレックス	4.7	17,883
サカイ引越センター	3.2	20,768
近鉄グループHLDGS	57.5	299,575
阪急阪神HLDGS	76.7	293,761
南海電鉄	25.6	69,913
京阪ホールディングス	25.6	122,624
神戸電鉄	1.4	5,537
名古屋鉄道	47.3	143,319
山陽電鉄	4.4	9,552
日本通運	22.2	122,100
ヤマトホールディングス	100.9	224,098
山九	16	88,480
丸運	3.2	886
丸全昭和運輸	4.7	16,027
センコーグループHLDGS	31.7	27,579
トナミホールディングス	1.4	7,602
ニッコンホールディングス	21.9	55,866
日石輸送	0.7	1,973
福山通運	7.4	29,193
セイノーホールディングス	43.1	61,934
エスライン	1.7	1,633
神奈川中央交通	1.4	5,355
日立物流	12.7	43,370
丸和運輸機関	3	14,850
C&Fロジホールディングス	5.8	7,621
九州旅客鉄道	48.3	169,774
SGホールディングス	54.4	171,088
海運業（0.2%）		
日本郵船	48.1	76,863
商船三井	34.1	80,646

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
川崎汽船	17.8	20,452
NSユナイテッド海運	3.2	7,027
明治海運	5.9	1,799
飯野海運	27	9,720
共栄タンカー	0.5	728
乾汽船	5.2	4,321
空運業（0.6%）		
日本航空	105.4	370,691
ANAホールディングス	105.2	383,033
パスコ	1.1	903
倉庫・運輸関連業（0.2%）		
トランコム	1.6	9,808
日新	5	8,890
三菱倉庫	19.9	61,889
三井倉庫HOLD	7	10,962
住友倉庫	21.1	29,265
渋沢倉庫	3.1	5,375
東陽倉庫	10.1	3,221
日本トランスシティ	12.6	5,619
ケイヒン	1	1,182
中央倉庫	3.5	3,633
川西倉庫	1.1	1,162
安田倉庫	4.6	4,006
ファイズ	1	691
東洋埠頭	1.7	2,317
宇徳	4.9	2,450
上組	35.5	89,282
サンリツ	1.4	887
キムラユニティー	1.5	1,602
キユーソー流通システム	1.4	2,912
近鉄エクスプレス	10.9	15,151
東海運	3.3	815
エーアイテイー	3.7	3,381
内外トランスライン	1.8	2,118
日本コンセプト	2.1	2,562
情報・通信業（9.0%）		
NECネッツエスアイ	6.6	18,678
クロスキャット	1.5	1,431
システナ	21.3	37,509
デジタルアーツ	3.2	29,376
日鉄ソリューションズ	8.9	30,393
キューブシステム	3.1	2,480
エイジア	1.2	1,437
コア	2.5	4,047
ソリトンシステムズ	3.3	3,366
ソフトクリエイトHD	2.6	4,126
ＴＩＳ	19.9	107,261
ネオス	2.4	2,083
電算システム	2.3	8,280
グリー	40.9	20,245
コーエーテクモHD	12.2	24,314
三菱総合研究所	2.6	8,476
ボルテージ	1.2	603
電算	0.7	1,389

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ＡＧＳ	3.3	2,227
ファインデックス	5	4,255
ブレインパッド	1.2	8,340
ＫＬａｂ	10.6	8,766
ポールトゥウィン・ピットクルー	7.9	10,072
イーブックイニシアティブ	0.9	2,113
ネクソン	152.1	240,318
アイスタイル	15.2	10,944
エムアップ	2	4,448
エイチーム	4	4,984
エニグモ	2.1	6,478
テクノスジャパン	4.9	2,812
ｅｎｉｓｈ	2.3	1,255
コロプラ	19.5	13,942
オルトプラス	3.9	900
ブロードリーフ	29.5	15,989
クロス・マーケティンググループ	2.1	745
デジタルハーツHLDGS	2.7	2,926
システム情報	3	2,475
メディアドゥHLDGS	1.8	6,156
じげん	8.4	6,736
ブイキューブ	3.1	1,763
エンカレッジ・テクノロジ	0.8	692
サイバーリンクス	0.9	1,033
ディー・エル・イー	3.9	924
フィックスターズ	6.3	12,537
CARTA HOLDINGS	3.1	4,278
オプティム	2.6	9,334
セレス	1.9	3,363
ティーガイア	5.9	11,593
セック	1	3,355
日本アジアグループ	6.4	2,214
豆蔵ホールディングス	4	5,244
テクマトリックス	4.2	8,723
プロシップ	1.7	1,951
ガンホー・オンライン・エンター	143.6	43,510
GMOペイメントゲートウェイ	9.8	67,620
ザッパラス	3	1,119
システムリサーチ	0.8	2,460
インターネットイニシアティブ	9.7	19,603
さくらインターネット	7	3,738
ヴィンクス	2	2,398
GMOクラウド	1.3	3,978
SRAホールディングス	3.1	7,440
MINORIソリューションズ	1.1	2,009
システムインテグレータ	1.6	1,144
朝日ネット	4.9	3,238
ｅＢＡＳＥ	3.5	4,021
アバント	2.1	4,693
アドソル日進	2.1	3,313
フリービット	4	5,200
コムチュア	3.3	13,414
サイバーコム	1	2,005
アステリア	3.9	3,958

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
マークラインズ	2.7	5,308
メディカル・データ・ビジョン	5.3	6,222
ｇｕｍｉ	7.6	4,035
ショーケース	1.2	633
モバイルファクトリー	1.6	2,262
テラスカイ	1.2	1,890
デジタル・インフォメーション	2.6	4,828
PCIホールディングス	1.2	2,425
パイプドHD	0.9	1,106
アイビーシー	1.1	1,384
ネオジャパン	1.1	1,003
ＰＲＴＩＭＥＳ	0.5	1,540
ランドコンピュータ	0.9	1,050
ダブルスタンダード	0.5	2,347
オープンドア	2.9	8,671
マイネット	1.9	1,364
アカツキ	2.1	11,571
ベネフィットジャパン	0.4	339
UBICOMホールディングス	1.1	1,914
LINE	18.1	53,214
カナミックネットワーク	1.2	2,776
ソムラシステムコーポレーション	0.6	446
チェンジ	1.2	3,283
シンクロ・フード	2.5	1,547
オークネット	3.1	4,002
エイトレッド	0.6	1,237
AOI TYO HOLDINGS	6.4	4,736
マクロミル	10.5	12,117
ビーグリー	1.4	1,129
オロ	1.6	4,113
テモナ	0.7	322
ソルクシーズ	2.5	2,172
フェイス	2.3	2,139
プロトコーポレーション	2.6	5,184
ハイマックス	0.7	1,293
野村総合研究所	37.9	197,080
サイバネットシステム	4.8	3,144
ＣＥホールディングス	1.7	1,654
日本システム技術	0.9	1,572
インテージホールディングス	7.6	7,600
東邦システムサイエンス	1.8	1,639
ソースネクスト	23.1	9,471
インフォコム	6.5	16,321
ＦＩＧ	5.2	1,638
アルテリア・ネットワークス	6.6	7,768
ヒト・コミュニケーションズHD	1.3	2,273
フォーカスシステムズ	4	3,524
クレスコ	1.8	6,075
フジ・メディア・HD	61.7	90,699
オービック	20.7	268,272
ジャストシステム	8.5	30,557
ＴＤＣソフト	5.1	4,197
ヤフー	388.4	118,850
トレンドマイクロ	31.8	157,251

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
IDホールディングス	2.2	2,391
日本オラクル	12.1	92,686
アルファシステムズ	1.9	5,696
フューチャー	8.1	16,807
CAC HOLDINGS	4.4	6,903
ソフトバンク・テクノ	2.5	6,152
トーセ	1.6	1,329
オービックビジネスC	6.1	31,415
伊藤忠テクノソリュー	27.2	73,766
アイティフォー	7.2	5,911
東計電算	0.9	2,772
エックスネット	1.1	1,002
大塚商会	32.3	140,182
サイボウズ	6.9	8,928
ソフトブレーン	4.6	2,240
電通国際情報Ｓ	3.7	12,709
デジタルガレージ	11.6	39,904
イーエムシステムズ	4.8	7,622
ウェザーニューズ	2	6,430
ＣＩＪ	4.6	4,489
東洋ビジネスエンジ	0.6	1,227
日本エンタープライズ	5.8	986
WOWOW	2.8	7,319
スカラ	4.7	4,690
インテリジェント ウェイブ	2.2	1,920
IMAGICA GROUP	5	2,780
ネットワンシステムズ	21.1	65,937
システムソフト	13.5	1,242
アルゴグラフィックス	5.1	11,724
マーベラス	9	7,470
エイベックス	10.2	14,484
日本ユニシス	18.6	67,797
兼松エレクトロニクス	3.2	9,545
東京放送HD	39.3	72,115
日本テレビHLDS	54.5	84,475
朝日放送グループHD	6.1	4,385
テレビ朝日HD	16.3	27,824
スカパーJSATHD	45.2	18,803
テレビ東京HD	4.9	11,715
日本ＢＳ放送	2	2,128
ビジョン	1.8	8,874
スマートバリュー	1.7	1,208
USEN―NEXT HLDGS	2.3	1,759
ワイヤレスゲート	2.5	1,147
コネクシオ	4.2	5,602
日本通信	51.4	9,354
クロップス	1	620
日本電信電話	407.9	2,055,816
ＫＤＤＩ	518.3	1,415,736
ソフトバンク	632.2	888,873
光通信	7	162,470
ＮＴＴドコモ	377.6	938,713
エムティーアイ	6.9	5,050
GMOインターネット	21.7	40,644

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ｱｲﾄﾞﾏﾏｰｹﾃｨﾝｸﾞｺﾐｭ	1.3	774
カドカワ	17.3	24,479
学研ホールディングス	2	10,320
ゼンリン	11.8	23,470
昭文社	2.7	945
ｲﾝﾌﾟﾚｽﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	4.9	681
アイネット	3.3	3,903
松竹	3.9	51,012
東宝	39.2	191,100
東映	2.5	37,450
ＮＴＴデータ	158.8	213,903
ピー・シー・エー	0.8	2,700
ビジネスＢ太田昭和	1	2,064
ＤＴＳ	6.6	29,832
ｽｸｳｪｱ･ｴﾆｯｸｽ･HD	27.7	95,426
シーイーシー	6.4	15,212
カプコン	25.6	55,603
アイ・エス・ビー	1.1	1,839
ジャステック	3.4	3,264
ＳＣＳＫ	15.7	83,838
日本システムウエア	2	5,526
アイネス	7.5	8,325
ＴＫＣ	5	23,525
富士ソフト	8.9	41,963
ＮＳＤ	9.8	31,311
コナミホールディングス	24.4	125,172
福井コンピュータHLDS	1.9	4,846
JBCCホールディングス	4.7	6,443
ミロク情報サービス	5.9	20,148
ソフトバンクグループ	247.8	2,525,082
卸売業（5.0%）		
ホウスイ	0.5	421
高千穂交易	2.2	2,266
伊藤忠食品	1.5	6,930
エレマテック	5.5	5,489
ＪＡＬＵＸ	1.7	4,828
あらた	4.4	16,632
トーメンデバイス	0.9	2,034
東京エレクトロンデバイス	2.1	3,966
フィールズ	5.2	2,657
双日	330.3	114,614
ｱﾙﾌﾚｯｻﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	66.5	180,481
横浜冷凍	16.8	16,144
神栄	0.7	535
ラサ商事	3.2	2,537
ﾗｸｰﾝﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	3.4	2,325
アルコニックス	6.3	8,385
神戸物産	9	48,780
あい ホールディングス	8.7	15,381
ディーブイエックス	2.3	1,853
ダイワボウＨＤ	5.4	26,892
ﾏｸﾆｶ･富士ｴﾚHLDGS	16.6	22,011
ラクト・ジャパン	2.6	10,049
バイタルＫＳＫHD	11.1	11,588

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
八洲電機	5.4	4,406
ﾒﾃﾞｨｱｽﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	3.3	2,372
ﾚｽﾀｰﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	6.6	9,556
ジューテックＨＤ	1.3	1,194
大光	2.5	1,595
OCHIホールディングス	1.8	2,147
TOKAIホールディングス	31.6	28,503
黒谷	1.3	582
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1	836
三洋貿易	3	7,155
ビューティガレージ	0.9	1,427
ウイン・パートナーズ	3.8	4,210
ミタチ産業	1.7	1,176
シップヘルスケアHD	12.5	59,187
明治電機工業	1.8	2,529
デリカフーズHLDGS	1	1,452
ｽﾀｰﾃｨｱﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	1.1	590
コメダホールディングス	13.8	29,449
富士興産	2.3	2,214
協栄産業	0.7	989
小野建	5.3	7,425
南陽	1.2	1,832
佐鳥電機	4.4	3,779
エコートレーディング	1.5	783
伯東	4.1	4,657
コンドーテック	4.6	4,356
中山福	3.4	1,893
ナガイレーベン	8.6	21,560
三菱食品	6.6	18,988
松田産業	4.5	6,673
第一興商	8.9	44,678
メディパルHD	64.6	153,231
ＳＰＫ	1.2	2,834
萩原電気HLDGS	2.2	5,777
アズワン	4.3	40,721
スズデン	2	2,606
尾家産業	1.9	2,426
シモジマ	3.6	4,039
ドウシシャ	5.6	10,080
小津産業	1.3	2,233
高速	3.5	3,972
たけびし	2.7	3,515
リックス	1.3	1,840
丸文	5.3	2,909
ハピネット	5	6,455
橋本総業HLDGS	1.2	1,802
日本ライフライン	18.7	32,968
タカショー	2.8	1,299
エクセル	2.2	3,467
マルカ	1.9	3,570
ＩＤＯＭ	20.1	5,467
日本エム・ディ・エム	3.5	5,292
進和	3.5	7,710
エスケイジャパン	1.4	736

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ダイトロン	2.7	3,196
シークス	7.6	9,188
田中商事	2	1,166
オーハシテクニカ	3.3	4,689
白銅	1.9	2,532
伊藤忠	418.6	846,618
丸紅	590.2	421,461
高島	0.9	1,521
長瀬産業	33.6	53,491
蝶理	3.8	6,338
豊田通商	66.8	216,432
三共生興	10.2	5,263
兼松	23.8	28,869
ﾂｶﾓﾄｺｰﾎﾟﾚｰｼｮﾝ	1	1,028
三井物産	493.1	862,925
日本紙パルプ	3.4	12,172
日立ハイテクノロジーズ	18.2	100,646
カメイ	7.8	8,845
東都水産	0.8	2,028
OUGホールディングス	0.9	2,361
スターゼン	2.2	8,668
山善	23.3	24,138
椿本興業	1.3	4,218
住友商事	353.9	566,770
内田洋行	2.7	9,126
三菱商事	420	1,208,340
第一実業	2.7	7,897
ｷﾔﾉﾝﾏｰｹﾃｨﾝｸﾞJPN	17.1	40,971
西華産業	3.4	4,321
佐藤商事	5.3	4,886
菱洋エレクトロ	6	10,152
東京産業	6.3	2,961
ユアサ商事	6.1	18,605
神鋼商事	1.3	3,019
小林産業	3.3	1,069
阪和興業	10.4	29,806
正栄食品	4.2	14,322
カナデン	5.7	7,410
菱電商事	4.6	7,295
フルサト工業	3.3	4,775
岩谷産業	13.3	49,409
すてきナイスグループ	2.5	1,467
昭光通商	2.3	1,426
ニチモウ	1.3	2,252
極東貿易	1.9	2,804
イワキ	7	3,521
三愛石油	16	16,256
稲畑産業	14.3	19,405
ＧＳＩクレオス	1.6	1,774
明和産業	6.2	2,225
クワザワ	2	962
ワキタ	12.7	13,081
東邦ホールディングス	17.7	44,674
サンゲツ	17.7	37,329

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ミツウロコグループ	8.3	6,357
シナネンホールディングス	2.5	4,470
伊藤忠エネクス	13.2	11,497
サンリオ	18.5	47,748
サンワ テクノス	3.6	2,980
リョーサン	6.6	17,041
新光商事	5.6	10,477
トーホー	2.7	5,462
三信電気	4.2	7,404
東陽テクニカ	6.8	6,092
モスフード サービス	7.8	18,548
加賀電子	5.9	9,068
ソーダニツカ	6.6	3,768
立花エレテック	4.4	7,348
フオーバル	2.6	2,464
ＰＡＬＴＡＣ	10.8	62,640
三谷産業	7.9	2,180
太平洋興発	2.3	1,718
西本WISMETTAC HD	1.3	4,875
ﾔﾏｼﾀﾍﾙｽｹｱHLDGS	0.4	486
国際紙パルプ商事	13.7	3,644
ヤマタネ	2.9	3,923
丸紅建材リース	0.5	841
日鉄物産	4.3	18,253
泉州電業	2	5,598
トラスコ中山	12.4	28,544
オートバックスセブン	23.8	43,339
モリト	4.2	3,372
加藤産業	9.4	31,819
北恵	1.1	916
イノテック	4	3,224
イエローハット	11.2	16,520
JKホールディングス	5.5	3,074
日伝	4.9	8,540
北沢産業	4.4	1,218
杉本商事	3.2	6,662
因幡電機産業	8.4	36,498
東テク	2	4,506
ミスミグループ本社	75	196,350
アルテック	4.4	928
タキヒヨー	1.7	3,172
蔵王産業	0.9	1,209
スズケン	27.3	178,815
ジェコス	4.1	3,907
ルネサスイーストン	5.5	2,497
小売業（4.6%）		
ローソン	15.1	77,463
サンエー	4.5	19,507
カワチ薬品	4.6	8,740
エービーシー・マート	9.3	65,565
ﾊｰﾄﾞｵﾌｺｰﾎﾟﾚｰｼｮﾝ	2.3	1,607
アスクル	6.3	16,039
ゲオホールディングス	9.1	12,785
アダストリア	8.3	20,940

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ジーフット	3.9	2,589
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	0.8	528
くら寿司	3.5	15,960
キャンドゥ	2.8	4,620
パルグループHLDGS	3	9,945
エディオン	25.3	25,401
サーラコーポレーション	12.1	7,018
ワッツ	2.5	1,712
ハローズ	2.2	5,053
フジオフードシステム	2.5	7,252
あみやき亭	1.3	4,498
ひらまつ	11.7	4,001
大黒天物産	1.4	4,858
ハニーズホールディングス	5.6	5,639
ファーマライズHD	1.4	736
アルペン	4.6	7,327
ハブ	1.9	2,268
クオールホールディングス	8.8	13,349
ジンズ	3.2	20,448
ビックカメラ	35.5	40,186
DCMホールディングス	32.2	34,679
ペッパーフードサービス	4.7	8,887
ＭｏｎｏｔａＲＯ	37.8	96,843
東京一番フーズ	1.4	844
DDホールディングス	1.3	2,705
きちりホールディングス	1.5	1,089
アークランドサービスHD	4.4	8,272
J.フロントリテイリング	76.5	87,439
ドトール・日レスHD	10.5	21,892
マツモトキヨシHLDGS	24.7	78,916
ブロンコビリー	3.1	6,903
ＺＯＺＯ	64.7	123,512
トレジャー・ファクトリー	1.7	1,531
物語コーポレーション	1.5	12,495
ココカラファイン	6.7	38,525
三越伊勢丹HD	112	99,792
Ｈａｍｅｅ	1.8	1,240
ウエルシアHD	15.8	68,098
クリエイトSDH	8.8	21,806
丸善CHI HD	6.6	2,488
ミサワ	1	445
ティーライフ	0.8	692
エー・ピーカンパニー	1	460
チムニー	1.8	4,410
シュッピン	4	3,064
ネクステージ	9.6	11,884
ジョイフル本田	17.5	21,035
鳥貴族	2	4,352
キリン堂ホールディングス	2.3	4,006
ホットランド	3.1	4,907
すかいらーくHD	55.8	109,312
SFPホールディングス	2.5	4,490
綿半ホールディングス	2.2	5,462
ヨシックス	1	2,360

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ユナイテッド・スーパーマーケ	17.4	16,112
ゴルフダイジェスト・オン	2.4	1,600
ＢＥＥＮＯＳ	2.1	3,912
あさひ	4.9	6,193
日本調剤	2.1	7,644
コスモス薬品	2.6	46,800
トーエル	2.8	1,988
オンリー	1	811
セブン＆アイ・HLDGS	250.9	929,082
薬王堂	2.6	6,024
クリエイト・レストランツ・ホール	16.1	22,845
ツルハホールディングス	13	117,780
サンマルクホールディングス	4.7	10,974
フェリシモ	1.3	1,264
トリドールホールディングス	7.4	14,629
TOKYO BASE	5.3	4,383
ウイルプラスHLDGS	0.9	762
ジャパンミート	3	5,070
サツドラホールディングス	1	1,908
デファクトスタンダード	0.4	136
アレンザホールディングス	3.2	2,688
バロックジャパン	4.8	4,233
クスリのアオキHLDGS	5.9	43,896
力の源HD	2.2	1,612
スシローグローバルHLDGS	6.6	51,282
ＬＩＸＩＬビバ	5	5,965
メディカルシステムネットワーク	6.3	3,124
はるやまHLDGS	2.7	2,230
ノジマ	10.6	18,730
カッパ・クリエイト	8.4	11,550
ライトオン	5	3,640
ジーンズメイト	1.8	586
良品計画	8.5	163,370
三城ホールディングス	7.5	2,490
アドヴァンス	9.1	9,964
アルビス	2.3	5,687
コナカ	7.7	3,164
ハウス ローゼ	0.7	1,170
G―7ホールディングス	1.7	5,202
イオン北海道	5.9	4,271
コジマ	10.2	4,967
ヒマラヤ	2	1,724
コーナン商事	7.8	17,604
エコス	2.2	3,062
ワタミ	7.8	11,973
マルシェ	1.4	1,093
パンパシフィックHD	35.8	247,378
西松屋チェーン	13.1	11,488
ゼンショーホールディングス	28.2	61,391
幸楽苑ホールディングス	3.8	10,849
ハークスレイ	1.2	1,230
サイゼリヤ	9.9	23,948
ＶＴホールディングス	27	11,961
魚力	1.6	2,372

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ポプラ	1.5	724
フジ・コーポレーション	1.5	3,172
ユナイテッドアローズ	6.8	24,786
ハイデイ日高	8.6	17,157
京都きもの友禅	4	1,440
コロワイド	19.9	41,511
ピーシーデポコーポ	7.9	3,444
壱番屋	4.2	19,026
トップカルチャー	2.2	805
ＰＬＡＮＴ	1.4	1,129
スギホールディングス	13.1	67,989
ヴィア・ホールディングス	7.2	4,312
スクロール	9.1	3,066
ヨンドシーホールディングス	6.6	16,612
ユニー・ファミリーマートHD	66.9	178,288
木曽路	7.3	18,469
SRSホールディングス	6.9	6,934
千趣会	11.1	3,085
タカキユー	4.8	825
ケーヨー	10.8	5,248
上新電機	7	14,861
日本瓦斯	9.7	25,986
ロイヤルホールディングス	10.4	28,839
東天紅	0.5	600
いなげや	6.6	9,028
島忠	12.6	29,610
チヨダ	6.3	10,199
ライフコーポレーション	4.5	9,486
リンガーハット	7.3	16,198
ＭｒＭａｘＨＤ	8.1	3,620
テンアライド	5.3	2,210
AOKIホールディングス	12	12,552
オークワ	8.5	9,860
コメリ	9.2	20,258
青山商事	10.6	21,963
しまむら	7	54,670
はせがわ	2.9	1,168
高島屋	47	52,076
松屋	12.1	10,720
エイチ・ツー・オーリテイリング	30.8	36,374
近鉄百貨店	2.3	7,613
パルコ	5.7	5,990
丸井グループ	50.6	117,746
アクシアル リテイリング	5	18,075
井筒屋	3.3	877
イオン	230.4	427,968
イズミ	12.2	54,900
平和堂	12.2	23,607
フジ	7.2	12,974
ヤオコー	6.8	33,660
ゼビオホールディングス	7.2	8,992
ケーズホールディングス	62.2	64,439
OLYMPICグループ	3.5	2,429
日産東京販売HD	8.5	2,303

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
GENKY DRUGSTORES	2.9	7,310
総合メディカルHD	5.2	8,689
ブックオフGHD	3	3,042
アインホールディングス	8	52,880
元気寿司	1.7	6,417
ヤマダ電機	182.3	89,327
アークランドサカモト	10.1	13,523
ニトリホールディングス	25.9	343,175
グルメ杵屋	4.1	4,669
愛眼	4.7	1,123
ケーユーホールディングス	3	2,571
吉野家ホールディングス	20.8	38,875
松屋フーズHLDGS	2.9	9,657
サガミホールディングス	7.9	10,546
関西スーパーマーケット	4.5	4,932
王将フードサービス	4.4	29,480
プレナス	6.7	12,515
ミニストップ	4.4	7,013
アークス	11.2	24,774
バローホールディングス	12.9	28,870
藤久	0.5	359
ベルク	3	16,050
大庄	3.1	4,888
ファーストリテイリング	8	535,440
サンドラッグ	22.5	62,752
サックスバーホールディング	5	4,835
ヤマザワ	1.2	1,950
やまや	1	2,050
ベルーナ	14.6	10,789
銀行業（5.8%）		
島根銀行	1.4	988
じもとホールディングス	40	3,880
めぶきフィナンシャルG	311.3	84,051
東京きらぼしFG	8.1	13,575
九州フィナンシャルG	98.3	42,269
ゆうちょ銀行	169.8	183,044
富山第一銀行	14.3	4,375
コンコルディア・フィナンシャル	376.1	148,559
西日本フィナンシャルHD	37.6	29,666
関西みらいFG	28.1	20,203
33FG	5.2	8,034
第四北越フィナンシャルG	10.4	29,192
新生銀行	44	72,820
あおぞら銀行	33.5	85,592
三菱UFJフィナンシャルG	4,126.1	2,078,316
りそなホールディングス	657.7	289,388
三井住友トラストHD	117.8	457,064
三井住友フィナンシャルG	422.4	1,590,758
千葉銀行	206.1	109,439
群馬銀行	119.9	46,641
武蔵野銀行	8.9	18,449
千葉興業銀行	16.3	4,547
筑波銀行	24.7	4,223
七十七銀行	18.8	30,343

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2019年6月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
青森銀行	4.6	12,691
秋田銀行	3.8	7,755
山形銀行	6.7	11,262
岩手銀行	4.2	12,558
東邦銀行	53.5	13,214
東北銀行	3	3,255
みちのく銀行	4	6,592
ふくおかフィナンシャルG	52.8	101,428
静岡銀行	150.1	120,380
十六銀行	8	18,704
スルガ銀行	60.5	25,047
八十二銀行	144.5	66,470
山梨中央銀行	7.3	8,803
大垣共立銀行	12.6	31,210
福井銀行	5.1	7,843
北國銀行	6.2	19,313
清水銀行	2.5	4,502
富山銀行	1.1	2,857
滋賀銀行	12	30,528
南都銀行	9.3	21,390
百五銀行	53.7	18,311
京都銀行	21.5	89,655
紀陽銀行	21.2	31,100
ほくほくフィナンシャルG	39.8	46,685
広島銀行	88.4	48,531
山陰合同銀行	35.5	24,495
中国銀行	51.6	52,064
鳥取銀行	2	2,814
伊予銀行	79.3	44,645
百十四銀行	6.3	14,729
四国銀行	8.4	7,879
阿波銀行	9.1	24,388
大分銀行	3.7	11,581
宮崎銀行	4	10,612
佐賀銀行	3.6	5,626
沖縄銀行	5.5	19,332
琉球銀行	13.8	15,331
セブン銀行	202.4	56,672
みずほフィナンシャルG	8,144.3	1,233,047
高知銀行	2.1	1,600
山口フィナンシャルG	74.8	55,726
長野銀行	2	3,378
名古屋銀行	4.8	16,272
北洋銀行	90.2	23,091
愛知銀行	2.2	8,305
中京銀行	2.4	5,246
大光銀行	2	3,204
愛媛銀行	8.3	9,146
トマト銀行	2.3	2,357
京葉銀行	26.4	16,790
栃木銀行	30.7	5,587
北日本銀行	1.8	3,106
東和銀行	10.4	7,363
福島銀行	5.1	1,315
大東銀行	2.9	1,638
トモニホールディングス	46.4	17,028
フィデアホール	57.9	6,716
池田泉州ＨＤ	63.2	13,588
証券、商品先物取引業（0.7%）		
ＦＰＧ	18.8	16,412
マーキュリアインベストメント	2.3	1,635
SBIホールディングス	71.4	185,782
日本アジア投資	5	895
ジャフコ	9.8	37,485
大和証券Ｇ本社	481.3	225,970
野村ホールディングス	1,054.8	367,808
岡三証券グループ	50.9	20,563
丸三証券	17.8	10,306
東洋証券	21.3	2,470
東海東京ＨＤ	71.3	23,529
光世証券	1.4	919
水戸証券	17.1	3,385
いちよし証券	12.5	9,287
松井証券	29.3	30,061
だいこう証券ビジ	2.4	1,084
マネックスＧ	55.4	19,390
極東証券	7.9	7,125
岩井コスモホールディング	6	6,816
藍澤證券	11	7,458
マネーパートナーズGP	6.8	1,958
スパークス・グループ	23.7	5,379
小林洋行	2	504
保険業（2.3%）		
かんぽ生命保険	22.5	45,360
SOMPOホールディングス	105.6	447,427
アニコム ホールディングス	4.9	18,644
ＭＳ＆ＡＤ	156.6	547,473
ＳＯＮＹ ＦＨ	49.1	127,954
第一生命HLDGS	338.9	550,034
東京海上ＨＤ	214.3	1,186,793
T&Dホールディングス	185.2	210,387
アドバンスクリエイト	1.3	2,275
その他金融業（1.1%）		
全国保証	16.9	71,487
ジェイリース	1.5	481
イントラスト	1.7	819
日本モーゲージサービス	1.1	1,238
Ｃａｓａ	2.7	2,872
アルヒ	5.4	9,628
プレミアグループ	3.4	6,592
クレディセゾン	42	52,164
芙蓉総合リース	6.8	38,760
興銀リース	11.3	29,820
東京センチュリー	12.1	54,813
日本証券金融	26.2	14,226
アイフル	91.2	19,334
リコーリース	4.7	15,651
イオンフィナンシャルサービス	38.3	65,033
アコム	120.4	45,511
ジャックス	6.5	13,130
オリコ	161.5	17,442
日立キャピタル	14.1	34,291
アプラスフィナンシャル	31.7	2,219
オリックス	399.8	623,688
三菱ＵＦＪリース	135.2	73,278
九州リースサービス	3	1,842
日本取引所グループ	161.9	279,439
イー・ギャランティ	5.6	7,666
アサックス	2.6	1,450
NECキャピタルソリューション	2.5	4,412
不動産業（2.5%）		
いちご	76.2	25,146
日本駐車場開発	71.3	12,263
ヒューリック	124.6	107,654
三栄建築設計	2.6	3,871
野村不動産HLDGS	39.7	93,215
三重交通グループHD	12.5	7,350
サムティ	8.3	12,715
エー・ディー・ワークス	96.1	3,747
日本商業開発	4.1	6,051
プレサンスコーポレーション	9.6	15,388
ユニゾホールディングス	8.9	16,696
日本管理センター	4.1	4,813
サンセイランディック	1.9	1,406
エストラスト	1.3	925
フージャースHD	13.4	8,241
オープンハウス	8.7	41,151
東急不動産ＨＤ	160.7	96,580
飯田ＧＨＤ	49.8	87,399
イーグランド	1.1	739
ビーロット	1.2	2,649
ファーストブラザーズ	1.6	1,601
ハウスドゥ	3.2	5,052
シーアールイー	2.3	2,359
プロパティエージェント	0.8	767
ケイアイスター不動産	1.8	2,763
アグレ都市デザイン	1	456
ジェイ・エス・ビー	0.2	811
テンポイノベーション	0.7	1,053
グローバルリンクマネジメント	0.5	298
パーク24	35	86,730
パラカ	1.5	2,979
三井不動産	317.7	841,905
三菱地所	419.5	858,297
平和不動産	11.2	25,648
東京建物	65.1	76,687
ダイビル	17.3	17,057
京阪神ビルディング	10.8	11,340
住友不動産	134.5	545,263
テーオーシー	13.3	7,980
東京楽天地	0.9	4,644
スターツコーポレーション	8	20,528
フジ住宅	8.1	5,913
空港施設	6.5	3,302
明和地所	4.2	2,284
ゴールドクレスト	4.5	8,838
日本エスリード	2.4	3,844
日神不動産	8.8	3,889
日本エスコン	10.9	7,401
タカラレーベン	27.1	10,298
サンヨーハウジ名古屋	4	3,580
イオンモール	29.8	49,438
毎日コムネット	1	721
ファースト住建	2.3	2,576
ランド	258.5	2,068
カチタス	6.7	27,336
トーセイ	8.4	7,635
穴吹興産	0.9	2,656
サンフロンティア不動産	8.4	8,618
インテリックス	2	1,328
ランドビジネス	3.7	2,897
グランディハウス	6.1	2,745
日本空港ビルデング	19.1	84,804
サービス業（5.3%）		
日本工営	3.9	9,262
ＬＩＦＵＬＬ	21.1	10,845
ジェイエイシーリクルートメント	4.7	11,764
日本M&Aセンター	43.3	112,623
メンバーズ	1.9	3,798
中広	0.5	291
アイティメディア	1	528
タケエイ	6	5,304
E・Jホールディングス	0.7	736
トラスト・テック	3.2	10,352
コシダカホールディングス	14.2	19,908
アルトナー	1.3	938
パソナグループ	7.1	11,764
ＣＤＳ	1.4	1,822
リンクアンドモチベーション	10.6	6,285
ＧＣＡ	5.8	4,187
エス・エム・エス	21.3	55,848
サニーサイドアップ	0.6	1,354
パーソルホールディングス	58.1	143,100
リニカル	3.2	3,344
クックパッド	18	5,904
エスクリ	1.6	1,248
アイ・ケイ・ケイ	2.8	1,934
学情	2.3	2,743
スタジオアリス	2.9	6,142
シミックホールディングス	3.2	6,476
ＮＪＳ	1.2	2,098
綜合警備保障	23.1	120,120
カカクコム	43.4	88,536
アイロムグループ	2.2	3,394
セントケア・ホールディング	4.2	1,953
サイネックス	0.9	570

銘柄	2019年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ルネサンス	3.2	5,849
ディップ	9.3	16,693
オプトホールディング	3.5	5,488
新日本科学	7.9	5,506
ツクイ	13.6	7,412
キャリアデザインセンター	1.4	2,269
ベネフィット・ワン	16.1	30,670
エムスリー	122.2	247,088
ツカダ・グローバルHOLD	3.8	2,306
ブラス	0.5	317
アウトソーシング	30.6	37,576
ウェルネット	5.7	5,711
ワールドホールディングス	1.6	2,716
ディー・エヌ・エー	31.2	68,359
博報堂DY HLDGS	80.7	147,438
ぐるなび	8.2	5,108
タカミヤ	6.1	4,739
ジャパンベストレスキューS	4.4	6,384
ファンコミュニケーションズ	15.9	8,904
ライク	2.3	3,105
ビジネス・ブレークスルー	2.3	821
WDBホールディングス	2.6	7,228
ティア	3.3	2,128
CDG	0.5	670
バリューコマース	3.9	9,968
インフォマート	31.8	59,243
JPホールディングス	16.4	4,772
エコナックホールディングス	10.4	1,310
EPSホールディングス	8.7	15,225
レッグス	1.5	2,430
プレステージ・インター	10.8	17,128
アミューズ	3.5	8,767
ドリームインキュベータ	1.7	2,781
クイック	3.6	5,738
TAC	3.1	598
ケネディクス	50.8	26,974
電通	70.7	266,892
テイクアンドギヴ・ニーズ	2.2	2,404
ぴあ	1.7	8,372
イオンファンタジー	1.9	4,242
シーティーエス	6.5	4,108
ネクシィーズグループ	2	4,322
みらかホールディングス	16.2	42,768
アルプス技研	5.1	9,312
サニックス	10	2,190
ダイオーズ	1.3	1,783
日本空調サービス	6.5	4,420
オリエンタルランド	68.6	919,926
ダスキン	14.9	43,239
明光ネットワークジャパン	7.2	6,940
ファルコホールディングス	3.2	5,696
秀英予備校	1.5	648
田谷	1.4	851
ラウンドワン	18	26,694
リゾートトラスト	24.5	40,278
ビー・エム・エル	7.5	24,225
ワタベウェディング	1	651
りらいあコミュニケーショ	10.4	12,937
リソー教育	29.4	13,347
早稲田アカデミー	1.6	1,225
ユー・エス・エス	70.9	154,562
東京個別指導学院	2	1,772
サイバーエージェント	33.4	137,274
楽天	270.6	345,285
クリーク・アンド・リバー社	3.4	4,311
テー・オー・ダブリュー	5.4	4,390
山田コンサルティングGP	2.8	5,790
セントラルスポーツ	2.1	6,699
フルキャストホールディングス	5.8	13,032
エン・ジャパン	8.4	33,642
リソルホールディングス	0.6	2,289
テクノプロ・ホールディング	11.6	67,744
アトラ	1.2	339
インターワークス	1.1	666
アイ・アールジャパンHD	2.3	6,683
ＫｅｅＰｅｒ技研	2.1	2,940
ファーストロジック	1.2	766
三機サービス	1.2	1,458
Ｇｕｎｏｓｙ	4	7,604
デザインワン・ジャパン	1.2	357
イー・ガーディアン	2.9	5,272
リブセンス	3.1	790
ジャパンマテリアル	15.9	21,862
ベクトル	7.1	7,490
ウチヤマホールディングス	3	1,653
チャームケアコーポレーション	1.8	3,063
ライクキッズネクスト	1.3	1,222
キャリアリンク	2.1	915
ＩＢＪ	3.9	3,471
アサンテ	2.3	5,115
Ｎ・フィールド	3.7	2,538
バリューＨＲ	1.2	4,272
M&Aキャピタルパートナー	2.1	13,797
ライドオンエクスプレスHD	2.4	2,896
ERIホールディングス	1.6	1,508
アビスト	0.9	2,363
シグマクシス	2.8	3,385
ウィルグループ	3.7	3,289
エスクローＡＪ	7.9	2,125
日本ビューホテル	1.8	2,381
リクルートホールディングス	416	1,450,176
エラン	4	7,976
土木管理総合試験	2.5	1,207
ネットマーケティング	1.9	961
日本郵政	475.7	566,558
ベルシステム24HLDGS	9.7	14,569
鎌倉新書	4.2	5,947
ソネット・メディア・ネットワー	0.7	561
一蔵	0.7	451
LITALICO	1.3	2,211
グローバルキッズCOMP	0.9	822
エボラブルアジア	2.5	6,615
アトラエ	1.5	4,236
ストライク	2.2	4,688
ソラスト	14.2	13,972
セラク	1.8	1,112
インソース	2.2	5,442
ベイカレントコンサルティング	4.1	16,441
ORCHESTRA HLDGS	1	1,418
アイモバイル	1.8	1,584
キャリアインデックス	2	1,614
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2.3	3,548
船場	0.9	855
グレイステクノロジー	2.1	6,153
ジャパンエレベーターSHD	4.6	11,955
フルテック	0.7	817
グリーンズ	2.2	3,269
ツナググループHLDGS	0.6	350
ソウルドアウト	0.6	1,381
MS&CONSULTING	0.9	1,051
日総工産	4.2	6,132
キュービーネットHLDGS	3.5	8,736
RPAホールディングス	1.2	6,276
スプリックス	1.9	3,693
アドバンテッジリスクマネ	2.2	1,520
リログループ	31.7	91,296
東祥	3.6	9,975
エイチ・アイ・エス	10.3	28,273
ラックランド	1.1	2,685
共立メンテナンス	8.9	46,814
イチネンホールディングス	6	6,546
建設技術研究所	4	6,020
スペース	3.7	4,551
長大	2.2	1,592
燦ホールディングス	1.2	2,834
スバル興業	0.4	2,408
東京テアトル	2.4	3,165
タナベ経営	1.1	1,309
ナガワ	1.6	9,024
よみうりランド	1.2	6,516
東京都競馬	3.8	13,395
常磐興産	2.2	3,660
カナモト	8.7	23,507
東京ドーム	21.7	23,414
西尾レントオール	5.9	17,410
アゴーラ・ホスピタリティーG	33.4	1,135
トランス・コスモス	6.4	15,123
乃村工藝社	27.1	36,720
藤田観光	2.3	6,419
KNT-CTホールディングス	3.1	4,367
日本管財	6.2	11,532
トーカイ	5.6	12,997
白洋舎	0.7	2,089
セコム	61.6	579,840
セントラル警備保障	2.8	15,148
丹青社	10.9	13,417
メイテツク	7.2	40,536
応用地質	6.2	6,621
船井総研ホールディン	12	31,872
進学会ホールディングス	2.8	1,696
オオバ	4.4	2,802
いであ	1.1	1,283
学究社	1.9	2,462
ベネッセホールディングス	21.3	53,015
イオンディライト	7.1	22,507
ナック	3.8	3,549
ニチイ学館	8.2	12,742
ダイセキ	9.7	26,578
ステップ	2.1	3,118
合計 株数、金額	千株 71,173.7	千円 134,161,291
合計 銘柄数<比率>	2,126銘柄	<98.5%>

（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
		百万円	百万円
国内	TOPIX	2,010	—

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2019年6月17日現在 貸付	借入
	株	株
株式	12,558,800	—
	(261,500)	(—)

（注1）（ ）内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
（注2）当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ261,500株を貸付けています。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書　第30期　（決算日　2018年９月19日）

（計算期間　2017年９月20日～2018年９月19日）

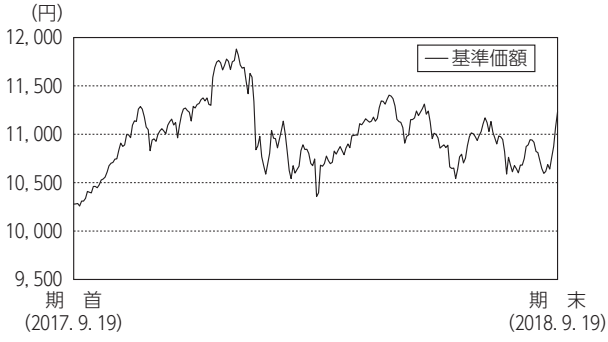
トピックス・インデックス・マザーファンドの第30期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
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		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2017年9月19日	10,279	—	1,667.88	—	99.2	0.7
9月末	10,401	1.2	1,674.75	0.4	98.7	1.2
10月末	10,965	6.7	1,765.96	5.9	98.3	1.7
11月末	11,130	8.3	1,792.08	7.4	98.7	1.3
12月末	11,300	9.9	1,817.56	9.0	98.8	1.1
2018年1月末	11,419	11.1	1,836.71	10.1	99.0	1.0
2月末	10,999	7.0	1,768.24	6.0	98.9	1.0
3月末	10,775	4.8	1,716.30	2.9	98.0	2.0
4月末	11,160	8.6	1,777.23	6.6	98.5	1.5
5月末	10,979	6.8	1,747.45	4.8	98.3	1.7
6月末	10,887	5.9	1,730.89	3.8	99.4	0.6
7月末	11,028	7.3	1,753.29	5.1	99.3	0.7
8月末	10,917	6.2	1,735.35	4.0	98.7	1.3
(期末)2018年9月19日	11,233	9.3	1,785.66	7.1	99.4	0.5

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。
(注3) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：10,279円　期末：11,233円　騰落率：9.3%
【基準価額の主な変動要因】
ベンチマーク（ＴＯＰＩＸ）が上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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

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

◆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。

■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
	千株	千円	千株	千円
国内	6,468.2 (△14,470.792)	12,332,268 (4,050)	4,564.308	8,568,987

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

(2)先物取引の種類別取引状況

（2017年９月20日から2018年９月19日まで）

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

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(3)新株予約権証券

（2017年９月20日から2018年９月19日まで）

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

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）（ ）内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
（注３）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株　　式

（2017年９月20日から2018年９月19日まで）

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

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
(1)国内株式

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	3.6	3.8	12,654
日本水産	82.7	75.4	48,331
マルハニチロ	12	12.7	51,625
カネコ種苗	4.4	6.9	10,929
サカタのタネ	9.7	10	39,100
ホクト	5.8	7.1	13,766
鉱業（0.3%）			
日鉄鉱業	1.9	2.1	11,172
三井松島	6.1	5.1	9,593
国際石油開発帝石	327.6	316.5	434,712
日本海洋掘削	3.3	—	—
石油資源開発	9.2	9.8	24,823
K&O エナジーグループ	4.1	3.5	6,111
建設業（2.8%）			
ショーボンドHD	5.9	6.1	53,314
ミライト・ホールディングス	18.9	20.2	37,127
タマホーム	10.5	7.5	7,710
ＴＡＴＥＲＵ	—	10.3	5,386
安藤・間	47.5	54	45,954
東急建設	23.1	26.5	28,593
コムシスホールディングス	23.8	24.9	80,800
ミサワホーム	9.3	6.7	5,795
高松コンストラクショングループ	4.4	4.2	12,747
東建コーポレーション	2.5	2.4	17,640
ヤマウラ	—	9.3	8,118
大成建設	319	65.4	327,654
大林組	188.9	194	211,072
清水建設	193.6	199	199,199
飛島建設	71.9	74.4	13,615
長谷工コーポレーション	73.1	75.6	112,946
松井建設	8.3	11.8	10,584
鹿島建設	277	286	229,658
不動テトラ	54.3	63.7	13,504
鉄建建設	40	4.4	12,799
西松建設	71	14.9	40,930
三井住友建設	240.9	47.8	35,850
大豊建設	25	27	17,577
前田建設	42	47.1	69,802
奥村組	48	10.8	37,260
東鉄工業	7.8	8	23,616
淺沼組	27	29	10,266
戸田建設	74	75.2	60,009
熊谷組	103	10.5	31,710
北野建設	20	21	8,442
三井ホーム	11	11	10,736
矢作建設	10	10.7	9,095
ピーエス三菱	14.7	13.1	7,113
日本ハウス HLDGS	17.9	17.5	10,167
大東建託	22.7	23.4	354,042
新日本建設	8.6	9.2	10,681
ＮＩＰＰＯ	13	14.3	30,301
東亜道路	17	2	7,380
前田道路	19	18.4	42,154
日本道路	20	1.9	11,609
東亜建設	5.8	5.8	14,534
若築建設	53	6.1	9,827
東洋建設	17.5	22.9	10,076
五洋建設	69.4	76.7	54,763
世紀東急	13.8	13.6	9,642
福田組	2.2	2.4	13,056
住友林業	42.1	40.5	77,071
日本基礎技術	14.2	22	8,536
日成ビルド工業	21	12.1	13,104
巴コーポレーション	—	14.9	7,122
大和ハウス	185.5	193	637,093
ライト工業	12.1	14.3	21,049
積水ハウス	189.8	211.6	366,702
日特建設	—	10.9	8,011
ユアテック	11	9.4	8,685
西部電気工業	3.3	—	—
中電工	6.3	7.5	20,055
関電工	26	24.4	27,669
きんでん	42.4	41.2	73,871
東京エネシス	6.7	8.2	9,118
トーエネック	9	1.9	6,184
住友電設	4.8	5.3	9,767
日本電設工業	9.5	9.8	22,001
協和エクシオ	24.1	25	81,500
九電工	12.6	12.9	58,050
三機工業	14.1	14	17,094
日揮	58.4	56.5	135,769
中外炉工業	32	3.3	9,840
太平電業	9	4.6	12,893
高砂熱学	17.3	17.5	36,050
明星工業	13.3	13.2	11,880
大氣社	7.5	8.2	29,397
ダイダン	10	4.7	13,460
日比谷総合設備	6.3	8	15,304
東芝プラントシステム	10.1	13.5	32,656
ＯＳＪＢＨＤ	27.8	38.1	11,315
東洋エンジニア	37	11.6	11,484
千代田化工建	44	43.4	36,846
新興プランテック	13.8	13.4	14,445
食料品（4.0%）			
日本製粉	17.4	19.2	37,401
日清製粉Ｇ本社	67.2	71.8	166,145
昭和産業	24	5.4	15,627
中部飼料	7.7	8	12,240
フィード・ワン	49.9	48.2	10,266
東洋精糖	—	9.9	12,147
日本甜菜糖	3.6	—	—
三井製糖	4.6	5	15,825
塩水港精糖	29.9	43.9	11,896
日新製糖	3.1	4.6	10,262
森永製菓	12.7	13.7	56,923
中村屋	1.9	—	—
江崎グリコ	15.9	16.4	89,216
不二家	4.4	3.8	9,671
山崎製パン	45.6	48.9	113,888
モロゾフ	1.4	1.9	11,267
亀田製菓	3.6	3.9	20,397
寿スピリッツ	6.4	6	29,190
カルビー	25.8	26.8	97,820
森永乳業	58	11.7	35,064
六甲バター	3.5	5	12,590
ヤクルト	34	34.3	304,584
明治ホールディングス	37.2	38.7	288,315
雪印メグミルク	13.8	14.4	41,472
プリマハム	44	42	22,512
日本ハム	45	24.6	99,630
丸大食品	29	35	15,925
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	3.9	4.8	22,344
伊藤ハム米久 HLDGS	36.2	36.8	27,636
サッポロホールディングス	20.3	20.8	48,609
アサヒグループホールディングス	117.7	123.1	606,390
キリンＨＤ	269.9	266.2	773,843
宝ホールディングス	45.5	45.4	69,098
オエノンホールディングス	32.6	24.6	9,815
コカ・コーラボトラーズ JHD	39.5	45	139,275
サントリー食品インター	43	39.2	182,672
ダイドーグループHD	2.7	3.2	18,080
伊藤園	18.6	19.8	94,149
キーコーヒー	5.6	7	15,162
日清オイリオグループ	36	7	22,785
不二製油グループ	17	16	56,320
Ｊ－オイルミルズ	2.6	3.1	11,640
キッコーマン	43.1	42.8	283,764
味の素	129.3	133.8	255,892
キユーピー	32	32.5	85,572
ハウス食品Ｇ本社	23	22.4	74,928
カゴメ	22.4	23.7	77,025
アリアケジャパン	5.3	5.5	59,180
ニチレイ	29.9	28.2	81,328
東洋水産	30.3	32.2	141,841
日清食品ＨＤ	24.5	22.9	175,414
永谷園ホールディングス	8	9	13,725
フジッコ	6	6.7	15,959
ロックフィールド	7	7.5	13,702
日本たばこ産業	347.1	338.2	1,011,218
ケンコーマヨネーズ	4	4.7	13,357
わらべや日洋 HD	4.1	4.3	9,675
北の達人コーポ	—	19.8	12,097
ユーグレナ	22.3	23.6	19,753
ミヨシ油脂	6.7	—	—
理研ビタミン	1.9	2.6	9,932
繊維製品（0.6%）			
片倉工業	7.5	8.1	10,983
グンゼ	46	4.8	27,792

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

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アステラス製薬	572.7	574.7	1,153,135
大日本住友製薬	40.3	44	106,788
塩野義製薬	74.3	82.2	593,155
田辺三菱製薬	68.5	70.6	132,022
あすか製薬	6.7	7.9	11,368
日本新薬	13.7	15.5	107,415
中外製薬	59	61.3	427,874
科研製薬	10.9	10.4	61,048
エーザイ	72.2	70.2	740,259
ロート製薬	28.9	32.4	123,606
小野薬品	133.4	138.2	425,656
久光製薬	16.4	17.3	149,472
持田製薬	3.6	3.8	33,630
参天製薬	105.8	110.4	195,960
扶桑薬品	2.7	4	11,688
日本ケミファ	1.6	2.2	10,395
ツムラ	20.1	20.8	83,824
日医工	13.6	14.3	23,637
キッセイ薬品工業	10.2	9.8	33,369
生化学工業	10.9	12.2	20,752
栄研化学	5.2	9.9	25,245
日水製薬	4.2	—	—
鳥居薬品	3.9	3.4	9,050
ＪＣＲファーマ	4.8	4.4	25,036
東和薬品	2.8	3	23,700
富士製薬工業	2.7	4.5	7,911
沢井製薬	9.6	11.6	69,136
ゼリア新薬工業	12.5	13	31,928
第一三共	171.8	167.7	768,066
キョーリン製薬ＨＤ	13.6	15.2	35,796
大幸薬品	4.5	4.4	8,544
ダイト	3.9	4.1	13,694
大塚ホールディングス	116.3	111.4	603,008
大正製薬ＨＤ	12.1	13.2	177,540
ペプチドリーム	22.5	27.2	114,784
石油・石炭製品（0.9%）			
日本コークス工業	65.3	58.3	6,646
昭和シエル石油	51.5	55.9	135,669
ニチレキ	9.2	8.6	10,689
ユシロ化学	4.7	4.8	7,444
ビーピー・カストロール	—	2.9	4,587
富士石油	18.9	18.2	8,208
ＭＯＲＥＳＣＯ	4.2	5.2	8,684
出光興産	36.5	49.3	302,209
JXTGホールディングス	889.3	932.5	778,637
コスモエネルギーHLDGS	17.7	17.3	76,293
ゴム製品（0.7%）			
横浜ゴム	32.5	32.3	77,003
東洋ゴム	33.8	29.8	59,480
ブリヂストン	197.7	179.3	761,128
住友ゴム	54.4	50.9	85,461
藤倉ゴム	10.7	12.1	6,957
オカモト	19	21	25,788
ニッタ	5	5.7	23,626
住友理工	9.4	9.8	10,897
三ツ星ベルト	14	16	22,480
バンドー化学	9.2	11.3	14,565
ガラス・土石製品（1.0%）			
日東紡績	48	9	24,291
ＡＧＣ	57.1	58.2	275,286
日本板硝子	25.9	30	36,390
日本山村硝子	41	59	11,033
日本電気硝子	24.3	25.2	87,318
住友大阪セメント	109	110	53,570
太平洋セメント	356	36.7	126,248
日本ヒューム	10.3	10.3	10,547
日本コンクリート	17.5	25	8,975
アジアパイルＨＤ	10.8	10.8	8,683
東海カーボン	53	54.7	112,900
日本カーボン	3.3	3.1	22,382
東洋炭素	4	4	12,960
ノリタケ	3.6	3.5	24,605
ＴＯＴＯ	42.9	45.3	221,743
日本碍子	73.1	68.7	124,072
日本特殊陶業	50.2	49.4	162,773
ＭＡＲＵＷＡ	2.4	2.2	16,742
品川リフラクトリーズ	16	2.3	10,465
黒崎播磨	16	1.4	12,208
ニッカトー	—	4.6	5,819
フジミインコーポレーテッド	5.4	5.7	16,929
ニチアス	32	33	49,632
ニチハ	8.4	9	27,675
鉄鋼（1.1%）			
新日鐵住金	263.1	256.5	592,643
神戸製鋼所	101.1	104	99,424
中山製鋼所	6.4	9	6,417
合同製鐵	3.9	3.9	9,161
ＪＦＥホールディングス	159.8	155.5	388,283
日新製鋼	18.2	16.2	26,114
東京製鐵	31.7	31.6	27,049
共英製鋼	6.6	6.8	14,470
大和工業	11.3	12.2	40,199
東京鐵鋼	18	5	8,315
大阪製鐵	3.6	3.9	8,821
淀川製鋼所	7.6	7.1	19,283
東洋鋼鈑	16	—	—
丸一鋼管	18.7	20.5	71,442
大同特殊鋼	99	9.8	52,626
日本高周波	64	8	6,176
日本冶金工	56.8	54.3	17,864
山陽特殊製鋼	36	6.9	17,857
愛知製鋼	3	2.7	11,286
日立金属	59.8	61.4	83,565
日本金属	—	2.8	4,564
大平洋金属	43	4	15,020
新日本電工	37.5	39.6	11,206
栗本鉄工所	3.1	4.3	7,963
日本鋳鉄管	25	—	—
三菱製鋼	46	5.2	11,128
日本精線	—	1.7	7,012
シンニッタン	8.8	17.3	8,753
非鉄金属（0.8%）			
大紀アルミニウム	15	12.7	9,588
日本軽金属ＨＤ	146.2	166.6	41,150
三井金属	163	15.5	47,740
東邦亜鉛	37	3.5	14,175
三菱マテリアル	36.4	37.2	120,714
住友鉱山	152	73.9	279,785
DOWAホールディングス	64	14.2	49,416
古河機金	92	9.9	16,186
大阪チタニウム	7.4	7.1	12,602
東邦チタニウム	11.5	12.1	15,088
ＵＡＣＪ	83	8.7	23,542
古河電工	19.9	19.1	71,434
住友電工	219.6	213.7	384,446
フジクラ	78	67.3	40,649
昭和電線 HLDGS	96	11.2	8,680
タツタ電線	15	13.8	8,376
リョービ	34	7.5	32,137
アーレステイ	8	9.6	8,131
アサヒＨＤ	8.7	10.5	22,018
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	4.3	—	—
宮地エンジニアリングＧ	24	2.8	8,089
トーカロ	4.3	17.1	20,417
アルファ CO	—	3.4	4,875
ＳＵＭＣＯ	52	64.1	107,303
川田テクノロジーズ	1.4	1.4	8,666
東洋製罐グループHD	39.3	36.6	84,875
ホッカンホールディングス	18	20	8,960
横河ブリッジ HLDGS	10.5	11.3	27,538
駒井ハルテック	2.5	4.3	10,148
三和ホールディングス	57.5	55.7	78,258
文化シヤッター	15.9	18.6	15,624
三協立山	8.4	8.4	12,129
アルインコ	6.4	8.7	9,274
ＬＩＸＩＬグループ	82	84.8	192,241
日本フイルコン	—	13.5	7,843
ノーリツ	11.9	12.2	21,411
長府製作所	5.7	5.9	15,133
リンナイ	10	10.2	85,170
岡部	11.6	13.4	14,579
ジーテクト	6.1	7	12,873
東プレ	10.9	10.5	29,830
高周波熱錬	11.2	12.3	13,542
東京製綱	4.8	5.4	7,927
パイオラックス	9.5	8.9	20,923
エイチワン	—	6.6	8,976
日本発条	52.9	56.4	67,116
立川ブラインド	—	4.8	5,697
三益半導体	5.8	5.3	9,216
機械（5.2%）			
日本製鋼所	19	19.4	54,145
三浦工業	23.9	25.3	86,273
タクマ	19.7	19.8	28,195

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

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エレコム	5.2	5.8	16,622
日本無線	3.5	—	—
パナソニック	642.1	665.8	897,165
シャープ	—	58	140,128
アンリツ	42.1	43.3	79,628
富士通ゼネラル	19.5	18.2	34,798
日立国際電気	14.7	—	—
ソニー	395.2	391.7	2,617,339
ＴＤＫ	31.1	30.7	374,233
帝国通信工業	30	6.9	8,907
タムラ製作所	25	24.7	18,302
アルプス電気	51.8	50.3	156,684
池上通信機	—	48	6,672
パイオニア	83.3	118.6	12,690
日本電波工業	7.4	12.8	6,464
日本トリム	1.4	1.7	9,979
ローランド ディー．ジー．	3.5	3.6	9,558
フオスター電機	6.9	7.7	10,980
クラリオン	31	35	11,375
ＳＭＫ	17	20	6,460
ヨコオ	6.3	5.2	7,420
ホシデン	17.2	15.1	16,610
ヒロセ電機	9	9.4	119,850
日本航空電子	16	15	29,820
ＴＯＡ	7	8.5	11,203
マクセルホールディングス	8.5	11.5	20,987
古野電気	8.8	8.3	11,927
ユニデンホールディングス	30	23	6,578
アルパイン	14.1	13.9	32,178
スミダコーポレーション	6.4	6	8,352
アイコム	3.5	3.8	9,659
リオン	3.4	3.7	8,635
本多通信工業	—	7.3	6,146
船井電機	6.3	10	6,780
横河電機	60.3	58.2	136,711
新電元工業	25	2.2	11,286
アズビル	16.6	17.3	83,213
日本光電工業	23	24.4	84,424
共和電業	16.8	20.1	8,562
堀場製作所	10.8	11.7	75,582
アドバンテスト	38.6	33.1	79,638
エスペック	5.6	6.1	13,291
キーエンス	25.4	28.7	1,818,719
日置電機	3.2	3.5	12,407
シスメックス	43.5	45.6	452,808
日本マイクロニクス	10.7	11.2	8,971
メガチップス	5.6	5.2	11,611
OBARA GROUP	3.5	3.3	17,985
コーセル	8.6	8.8	11,184
イリソ電子工業	4.8	4.9	29,547
オプテックスグループ	4.8	10.9	23,958
千代田インテグレ	2.9	3.2	7,532
レーザーテック	13.4	12.6	47,880
スタンレー電気	39.7	44.3	169,004
岩崎電気	33	4.7	7,322
ウシオ電機	32.7	32.3	49,515
ヘリオステクノＨ	—	8.3	7,868
日本セラミック	6.2	6.1	18,068
遠藤照明	4.2	—	—
古河電池	8	7.5	6,495
山一電機	6.3	5.2	8,216
図研	5.6	4.8	8,856
日本電子	21	23	27,968
カシオ	44.5	46.9	87,234
ファナック	56.7	55.5	1,230,435
日本シイエムケイ	13.5	11.7	9,792
エンプラス	2.6	2.9	9,091
大真空	—	4.1	5,592
ローム	27.2	26.2	211,696
浜松ホトニクス	39.8	41.7	176,808
三井ハイテック	8.6	8.5	12,826
新光電気工業	22.4	22.1	20,928
京セラ	91.3	95.7	633,438
太陽誘電	27	28.8	80,956
村田製作所	58.7	61.3	1,099,722
ユーシン	13.5	15.5	11,888
双葉電子工業	8.4	9.2	18,694
北陸電気工業	45	5.4	6,755
ニチコン	18.6	18.9	20,997
日本ケミコン	51	5	15,725
ＫＯＡ	8.9	8.5	16,966
市光工業	15	10.4	9,412
小糸製作所	33.6	35.2	254,848
ミツバ	10.6	11.4	11,058
SCREENホールディングス	11.5	11.2	81,872
キヤノン電子	6.1	4.6	10,842
キヤノン	299.5	312.6	1,110,667
リコー	166.8	175.8	209,377
象印マホービン	—	11.5	18,526
東京エレクトロン	37.5	39.1	640,067
輸送用機器（8.5%）			
トヨタ紡織	19.2	16.6	33,847
ユニプレス	10.5	10.9	23,980
豊田自動織機	51	46.6	302,434
モリタホールディングス	10.4	9.7	22,843
三桜工業	10.3	11.7	8,377
デンソー	137.6	129.6	739,627
東海理化電機	13.7	14.8	35,653
三井Ｅ&ＳＨＤ	197	21.1	42,727
川崎重工業	429	44.2	139,893
名村造船所	18.4	19.2	10,464
日本車輌	26	27	8,100
三菱ロジスネクスト	—	7.9	10,530
日産自動車	658.9	688.4	747,946
いすゞ自動車	161.7	169.6	297,139
トヨタ自動車	679.3	710.4	4,986,297
日野自動車	80.6	82.4	101,846
三菱自動車工業	206	215.7	169,540
エフテック	5	6	7,476
武蔵精密工業	6.9	6.6	24,816
日産車体	23.9	22.2	23,998
新明和工業	22.7	25.6	35,916
極東開発工業	11.8	11.5	19,849
日信工業	12	11.6	21,599
トピー工業	4.7	4.9	15,680
ティラド	25	2.6	7,813
曙ブレーキ	29.2	34.9	8,794
タチエス	9.8	10.4	18,824
ＮＯＫ	26.7	28.7	57,199
フタバ産業	18.9	18.7	13,912
ＫＹＢ	64	6	27,360
大同メタル工業	7.4	9.4	8,883
プレス工業	30.1	33.1	19,363
太平洋工業	13.4	12.9	24,316
ケーヒン	11.6	13.3	30,869
河西工業	8.5	8.1	9,784
アイシン精機	51.4	48.2	257,388
マツダ	175.6	179.4	237,256
今仙電機製作所	8.1	8.3	9,669
本田技研	502	524.5	1,774,383
スズキ	111.3	116.2	825,136
SUBARU	173.8	181	591,689
安永	—	3.5	6,968
ヤマハ発動機	79.2	82	240,014
ショーワ	15.9	15.9	26,664
ＴＢＫ	20	20.8	10,400
エクセディ	7.6	6.7	24,924
豊田合成	17.1	20.8	57,907
愛三工業	10	11.1	10,567
ヨロズ	5.2	6.9	11,874
エフ・シー・シー	9.2	9.8	32,830
シマノ	22.6	23.6	438,488
テイ・エス テック	12.5	13.5	52,852
ジャムコ	3.5	3.2	9,856
精密機器（1.8%）			
テルモ	85.3	89.9	587,047
日機装	20	19.3	25,456
島津製作所	71.9	70.2	233,766
ＪＭＳ	22	—	—
長野計器	—	7.5	8,565
ブイ・テクノロジー	1.2	1.4	24,010
東京計器	29	5.2	6,011
東京精密	10.7	10.2	29,804
マニー	7	7.4	38,258
ニコン	96.1	101.1	216,556
トプコン	28.4	30.8	58,212
オリンパス	89	86.7	387,982
理研計器	5.9	6.1	15,109
タムロン	4.2	5.9	13,770
ＨＯＹＡ	115	117.7	777,761
ノーリツ鋼機	6.7	6.7	18,451
エー・アンド・デイ	13.1	8.2	7,412
シチズン時計	58	66.7	49,558
リズム時計	39	5	10,185
大研医器	7.1	—	—

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
メニコン	3.9	8.6	22,557
松風	4.4	—	—
セイコーＨＤ	38	9.4	29,422
ニプロ	38.6	40.4	62,498
その他製品（2.1%）			
パラマウントベッドHD	5.2	6	31,020
ＳＨＯ－ＢＩ	—	14	5,586
ニホンフラッシュ	4.5	3.6	8,244
前田工繊	7.7	8.1	17,188
永大産業	15	—	—
アートネイチャー	8	10.7	7,607
ダンロップスポーツ	4.1	—	—
バンダイナムコHLDGS	61.9	60.5	274,670
共立印刷	27.1	—	—
ＳＨＯＥＩ	3.2	3.2	15,856
フランスベッドHLDGS	4.3	—	—
パイロットコーポレーション	9.7	10.1	63,529
萩原工業	2.6	5.4	9,487
トッパン・フォームズ	8.9	12.4	13,702
フジシールインターナショナル	12.8	13	51,155
タカラトミー	22.5	25.6	29,312
大建工業	4.6	5.4	12,366
凸版印刷	153	157	143,027
大日本印刷	154	75.3	199,921
共同印刷	19	3.3	9,438
ＮＩＳＳＨＡ	10.1	12.4	26,746
光村印刷	29	—	—
宝印刷	5.7	7.2	13,485
アシックス	55.1	57.6	94,752
ツツミ	2	—	—
ヤマハ	37.8	38.6	225,038
河合楽器	3.4	2.6	12,168
クリナップ	7.1	9.7	7,789
ピジョン	34	35.5	215,485
キングジム	8.2	9.5	9,338
リンテック	11.9	13.2	38,200
イトーキ	13.5	15.4	9,517
任天堂	34.5	36.1	1,444,000
三菱鉛筆	9.6	9.3	18,590
タカラスタンダード	10.6	12	23,784
コクヨ	26.5	27.9	55,716
ナカバヤシ	21	12.6	8,416
グローブライド	3.6	3.5	10,832
オカムラ	19.2	20.9	31,663
美津濃	30	6.1	17,641
電気・ガス業（1.7%）			
東京電力ＨＤ	472.5	467.3	250,005
中部電力	184.3	179.5	306,675
関西電力	229.4	239.2	390,494
中国電力	74.4	78.9	114,720
北陸電力	51.8	56.7	67,019
東北電力	139.9	136.4	206,236
四国電力	50.5	52.6	81,004
九州電力	123.1	129	169,377
北海道電力	51.5	58.4	42,690
沖縄電力	9.8	12.4	29,338
電源開発	44.2	46	138,000
イーレックス	8.2	10.8	10,929
東京瓦斯	602	123.2	341,387
大阪瓦斯	544	112	244,272
東邦瓦斯	137	29.1	118,582
北海道瓦斯	26	34	10,540
広島ガス	20.6	—	—
西部瓦斯	58	7.2	18,957
静岡ガス	13.9	20.2	19,149
メタウォーター	3.3	3.4	10,472
陸運業（4.3%）			
SBSホールディングス	6.8	—	—
東武鉄道	294	61.5	209,407
相鉄ホールディングス	85	18.3	67,801
東京急行	149.6	158.9	326,539
京浜急行	155	79.8	162,472
小田急電鉄	88.6	87.5	236,775
京王電鉄	152	32.9	205,625
京成電鉄	41.5	41.2	161,916
富士急行	16	8.6	30,358
新京成電鉄	14	—	—
東日本旅客鉄道	108.3	104.2	1,111,814
西日本旅客鉄道	53.9	52.4	409,401
東海旅客鉄道	46.4	52.5	1,221,675
西武ホールディングス	77.4	74.4	154,082
鴻池運輸	8.7	8.6	16,365
西日本鉄道	61	16	49,840
ハマキョウレックス	4.1	4.6	18,791
サカイ引越センター	2.9	3.4	21,862
近鉄グループHLDGS	547	54.2	244,171
阪急阪神HLDGS	70	73.2	298,656
南海電鉄	116	26.2	77,080
京阪ホールディングス	123	24.6	105,534
神戸電鉄	22	—	—
名古屋鉄道	199	44.1	120,348
山陽電鉄	22	5.1	13,010
日本通運	205	21.5	159,745
ヤマトホールディングス	100.2	97.7	329,542
山九	74	14.2	86,052
丸全昭和運輸	21	22	12,364
センコーグループHLDGS	26.5	34.3	31,384
トナミホールディングス	15	1.7	11,730
ニッコンホールディングス	17.8	19.7	58,607
福山通運	30	8.6	42,957
セイノーホールディングス	38.8	41.8	71,687
神奈川中央交通	8	—	—
日立物流	11.3	12.3	39,052
丸和運輸機関	1.7	3.4	13,821
九州旅客鉄道	56.1	46.1	159,045
SGホールディングス	—	52.9	149,971
海運業（0.2%）			
日本郵船	469	45.2	95,598
商船三井	292	34.2	108,072
川崎汽船	208	24.9	55,950
NSユナイテッド海運	29	2.9	7,189
飯野海運	29	30.1	17,999
空運業（0.6%）			
日本航空	97.9	101.3	413,405
ANAホールディングス	1,039	107.4	423,693
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	1.8	1.8	13,860
日新	28	5.2	13,072
三菱倉庫	34	18.9	53,052
三井倉庫HOLD	38	38	15,048
住友倉庫	35	37	29,230
渋沢倉庫	30	5.7	9,712
東陽倉庫	26.2	33.2	11,620
日本トランスシティ	20	18.4	9,439
東洋埠頭	50	8	13,584
上組	66	32.9	80,177
キユーソー流通システム	2.1	2.6	7,573
郵船ロジスティクス	4.7	—	—
近鉄エクスプレス	10.2	10.3	22,690
東海運	11.5	—	—
内外トランスライン	6.2	6.3	10,810
情報・通信業（8.0%）			
NECネッツエスアイ	5.8	6.1	15,878
システナ	5.3	19.9	30,685
デジタルアーツ	2.9	3.2	16,480
新日鉄住金ＳＯＬ	9.2	9.5	34,200
キューブシステム	—	9.2	8,675
コア	—	4.8	6,614
ソフトクリエイトHD	5.3	5.7	9,900
ＴＩＳ	18.5	19.5	114,075
電算システム	3.3	6.3	14,187
グリー	38.1	33.4	18,503
コーエーテクモＨＤ	13.1	9.6	21,763
三菱総合研究所	2.6	2.8	11,788
ファインデックス	5.6	—	—
ＫＬａｂ	11.1	10.9	11,401
ポールトゥウィン・ピットクルー	5.8	5	14,925
ネクソン	61.3	146.2	203,656
アイスタイル	14.5	16.3	21,516
エイチーム	5	5.2	10,103
テクノスジャパン	6.1	10	10,200
コロプラ	17.9	16.5	11,962
ブロードリーフ	15.3	31.2	20,966
デジタルハーツHLDGS	4.2	5.1	8,103
メディアドゥHLDGS	—	3	7,485
ティーガイア	5.7	6.1	18,544
豆蔵ホールディングス	7.2	7.9	7,378
テクマトリックス	4.6	—	—
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	150.5	138	31,602
GMOペイメントゲートウェイ	4.2	5	69,500
インターネットイニシアティブ	9.1	10.6	23,913
さくらインターネット	6	13.9	9,730
SRAホールディングス	3.5	3.7	12,691
システムインテグレータ	—	5.8	10,962
朝日ネット	17.6	23	12,029

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コムチュア	1.7	3.9	15,814
ｇｕｍｉ	7	9.5	5,956
アカツキ	—	1.8	6,282
LINE	15.8	18.2	89,726
AOI TYO HOLDINGS	—	7.9	11,486
マクロミル	—	8.2	19,967
野村総合研究所	41.5	37	213,860
インテージホールディングス	3.9	9.6	9,561
クレスコ	—	2.1	6,741
フジ・メディア・HD	56.4	59.3	117,117
オービック	19.2	18.5	194,435
ジャストシステム	10.1	10	24,250
ＴＤＣソフト	5.4	—	—
ヤフー	405.4	423.2	172,665
トレンドマイクロ	27	30.9	220,008
日本オラクル	8.9	9.7	89,240
フューチャー	10.3	9.7	18,187
CAC HOLDINGS	6	8.8	9,706
ソフトバンク・テクノ	4	—	—
オービックビジネスＣ	2.9	3.2	30,368
伊藤忠テクノソリュー	12.9	26.8	66,785
アイティフォー	14.2	10.3	9,764
大塚商会	16.8	31.6	129,402
サイボウズ	14.2	15.4	9,979
ソフトブレーン	8	—	—
電通国際情報Ｓ	4.2	4.1	16,523
デジタルガレージ	11.3	10.7	38,787
イーエムシステムズ	—	6.5	7,761
ウェザーニューズ	2.6	3.3	11,253
ＣＩＪ	16.4	13.2	9,886
WOWOW	3.4	3.2	11,536
ネットワンシステムズ	25.8	24.4	63,806
アルゴグラフィックス	3.8	3.3	16,021
マーベラス	10.8	10	8,990
エイベックス	10.5	11	17,050
日本ユニシス	15.7	17	46,954
兼松エレクトロニクス	3.9	3.9	14,332
東京放送ＨＤ	36.6	31.3	73,304
日本テレビHLDS	49.5	52	98,852
テレビ朝日ＨＤ	14.9	15.3	32,787
スカパー JSATHD	33.2	44.2	24,398
テレビ東京ＨＤ	5.3	5.4	14,995
日本ＢＳ放送	—	5.9	7,864
ワイヤレスゲート	4.7	6.6	4,303
コネクシオ	5.5	4.7	9,874
日本通信	56.9	65.2	11,540
日本電信電話	442.9	411	2,118,294
ＫＤＤＩ	537.9	505.4	1,561,686
光通信	6.7	7	150,990
ＮＴＴドコモ	405.7	411.6	1,254,968
エムティーアイ	10.3	12.4	7,898
GMOインターネット	21.9	22.1	41,702
カドカワ	16.3	17.4	21,001
学研ホールディングス	3.2	—	—
ゼンリン	8	11	37,565
松竹	3.6	3.8	53,656
東宝	36.1	37.8	134,001
東映	20	2.2	28,292
ＮＴＴデータ	170.3	181.1	282,334
ＤＴＳ	6.3	6.3	27,909
スクウェア・エニックス・HD	21.4	27	123,930
シーイーシー	4.4	8	20,864
カプコン	12.9	25.4	69,900
ジャステック	5.8	8.1	9,655
ＳＣＳＫ	15.5	13.7	73,295
アイネス	8.8	11.1	14,352
ＴＫＣ	5.2	5.3	23,876
富士ソフト	7.5	9.3	52,731
ＮＳＤ	11.7	9.9	23,166
コナミホールディングス	25.3	23.1	98,868
福井コンピュータHLDS	2.1	—	—
JBCCホールディングス	11.5	9.6	13,065
ミロク情報サービス	6.4	5.7	14,004
ソフトバンクグループ	248.8	259.9	2,836,808
卸売業（4.8%）			
エレマテック	2.3	2.9	7,531
ＪＡＬＵＸ	—	2.5	7,040
あらた	3	3.1	16,988
東京エレクトロンデバイス	—	3.6	7,077
フィールズ	4.4	5.7	5,266
双日	309.3	340.9	137,382
アルフレッサホールディングス	64.3	63.4	185,381
横浜冷凍	12.8	16.4	15,153
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
ペ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HLDGS	10.3	11	21,967
バイタル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
シップヘルスケアHD	10.2	11.6	47,502
コメダホールディングス	10.4	11.8	26,432
小野建	5.5	6	10,674
佐鳥電機	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
ハピネット	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
キヤ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
すてきナイスグループ	45	8.1	10,481
極東貿易	—	19	7,885
イワキ	—	13.3	6,889
三愛石油	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

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
新光商事	6.9	7.3	12,278
トーホー	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
ＰＡＬＴＡＣ	9.3	8.3	49,966
ヤマシタヘルスケア HLDGS	—	8.1	11,372
ヤマタネ	5.8	5.9	11,894
丸紅建材リース	34	—	—
日鉄住金物産	4.7	4.3	24,252
トラスコ中山	11.7	12.5	38,062
オートバックスセブン	18.9	20.7	39,847
加藤産業	8	9	33,030
イノテック	9.9	6.5	8,599
イエローハット	5.2	5.4	16,470
日伝	2.7	4.5	9,180
北沢産業	—	17.1	4,001
因幡電機産業	6.5	7.1	34,222
バイテックホールディングス	—	3.4	8,884
ミスミグループ本社	64.2	67.1	199,622
スズケン	25	26	134,160
ジェコス	5.5	6	7,062
小売業（4.9%）			
ローソン	17.2	14.3	97,812
サンエー	4.2	4.4	23,232
カワチ薬品	4.6	4.8	10,704
エービーシー・マート	9.9	10.4	64,688
ハードオフコーポレーション	5.3	8.3	8,175
アスクル	6.1	5.1	17,034
ゲオホールディングス	8.8	10.9	17,450
アダストリア	8.8	9.3	14,070
くらコーポレーション	3.3	3.6	26,676
キャンドゥ	4.5	—	—
パルグループ HLDGS	3.1	3.4	8,908
エディオン	21	22.6	28,340
サーラコーポレーション	11.3	13.7	9,233
ワッツ	5.2	7.2	6,760
ハローズ	2.1	3.6	9,633
あみやき亭	1.8	2.2	9,680
ひらまつ	14.7	16.2	7,338
ゲンキー	2.5	—	—
大黒天物産	1.6	1.9	8,521
ハニーズホールディングス	6.9	10	10,400
アルペン	3.8	4.4	8,866
クオール	6.9	6.9	16,435
ジンズ	4	4.1	22,919
ビックカメラ	31.7	31.7	48,374
DCM ホールディングス	32.8	27.6	28,455
ＭｏｎｏｔａＲＯ	20.1	18.7	117,623
アークランドサービス HD	5.6	4.8	9,859
J. フロント リテイリング	69.8	67.4	111,479
ドトール・日レスＨＤ	9.4	9.4	20,003
マツモトキヨシ HLDGS	10.5	24	106,800
ブロンコビリー	3.5	3.8	13,452
スタートトゥデイ	49.4	57.1	190,428
物語コーポレーション	2	1.9	20,045
ココカラファイン	5.8	6.1	44,408
三越伊勢丹ＨＤ	110.4	107.5	145,232
ウエルシアＨＤ	15.3	15.7	89,804
クリエイトＳＤＨ	8.1	8.7	24,142
丸善 CHI HD	16.7	—	—
チムニー	1.3	—	—
ジョイフル本田	9.2	16.5	28,908
鳥貴族	3	2.9	6,556
ホットランド	—	5.8	7,609
すかいらーく HD	34	53	87,768
綿半ホールディングス	3.6	3.1	9,207
ユナイテッド・スーパーマーケ	18.9	20.2	27,896
ブックオフコーポレーション	11.7	—	—
あさひ	4.9	6.4	9,625
日本調剤	2.1	2.3	8,142
コスモス薬品	2.8	3	75,660
一六堂	17.1	—	—
セブン＆アイ・HLDGS	231	241.3	1,230,630
薬王堂	3.6	2.8	10,626
クリエイト・レストランツ・ホール	17	16.5	22,308
ツルハホールディングス	11.2	12.6	164,808
サンマルクホールディングス	3.6	4.1	11,037
トリドールホールディングス	7.2	7.6	19,045
TOKYO BASE	—	7.2	4,312
ダイユー・リック HLDGS	9.4	6.2	7,260
クスリのアオキ HLDGS	4.6	4.7	39,151
スシローグローバル HLDGS	—	6.7	46,632
ＬＩＸＩＬビバ	—	7.7	13,598
総合メディカル	3	5.5	13,645
ノジマ	9.2	10.6	26,044
カッパ・クリエイト	7.5	—	—
ライトオン	5.7	7.8	7,924
良品計画	7.4	7.7	257,950
アドヴァン	6.9	7.4	7,518
アルビス	2.2	2.5	7,662
コナカ	12	—	—
コジマ	—	13.1	6,694
コーナン商事	7.6	8.8	23,883
ワタミ	7.2	8.2	10,979
ドンキホーテホールディング	36	37.6	207,928
西松屋チェーン	9.7	12.9	15,376
ゼンショーホールディングス	29.2	30.5	72,224
幸楽苑ホールディングス	6.9	5.9	9,693
サイゼリヤ	8.6	9.4	20,896
ＶＴホールディングス	19.5	21.2	10,642
ポプラ	10.5	10.4	7,030
ユナイテッドアローズ	7.6	7.4	32,264
ハイデイ日高	6.5	8	18,640
京都きもの友禅	11.3	—	—
コロワイド	17.6	19.8	62,667
ピーシーデポコーポ	—	11.2	5,812
壱番屋	3.9	4.3	19,565
スギホールディングス	12.1	12.5	69,125
ヴィア・ホールディングス	—	13.4	9,875
スクロール	12.7	16.6	11,321
ヨンドシーホールディングス	5.7	6	13,974
ユニー・ファミリーマート HD	24.4	18.7	206,822
木曽路	6.7	7.4	20,283
SRS ホールディングス	10.1	—	—
千趣会	13.6	14.4	6,292
タカキユー	—	35.6	7,298
ケーヨー	14.5	12.9	7,030
上新電機	14	7	21,805
日本瓦斯	10.5	11.1	65,601
ロイヤルホールディングス	9.6	10.4	29,588
いなげや	6.9	6.7	11,678
島忠	13.5	13	47,190
チヨダ	6.3	6.9	15,055
ライフコーポレーション	4.2	4	11,200
リンガーハット	6.7	7.9	19,220
ＭｒＭａｘＨＤ	—	10.7	6,484
AOKI ホールディングス	9.4	11.1	17,271
オークワ	9	10	11,220
コメリ	8.1	8.2	22,049
青山商事	11.2	10.2	35,394
しまむら	6.4	6.8	71,740
高島屋	91	43.9	81,654
松屋	13.6	12.8	15,552
エイチ・ツー・オーリテイリング	28.1	25.9	47,008
近鉄百貨店	1.5	—	—
丸井グループ	58.8	53.7	144,453
アクシアル リテイリング	4.4	5	20,075
イオン	226	223.1	594,226
イズミ	10.3	10.5	78,855
平和堂	10.6	11.7	35,568
フジ	5.9	7.2	16,250
ヤオコー	6	6.7	46,029
ゼビオホールディングス	7	7	11,564
ケーズホールディングス	22.8	51.2	70,707
GENKY DRUGSTORES	—	2.5	10,875
アインホールディングス	7.4	7.8	66,300
元気寿司	3.2	2.4	15,576
ヤマダ電機	186.5	193.6	108,803
アークランドサカモト	9.7	10	15,150
ニトリホールディングス	24	23	387,665
吉野家ホールディングス	20.3	20.2	39,046
松屋フーズ	3.1	3	10,815
サガミチェーン	8.5	10.6	15,020
関西スーパーマーケット	6.1	5.8	7,029
王将フードサービス	3.4	4.5	35,100
プレナス	6.5	6.3	11,888
ミニストップ	4.3	4.3	9,270
アークス	9.5	10.6	30,803
パローホールディングス	11.2	13.2	33,528
ベルク	2.8	2.8	17,192
大庄	4.3	—	—
ファーストリテイリング	9.3	7.7	432,971
サンドラッグ	21.1	21.4	84,744

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サックスバーホールディング	6.9	7.1	6,326
ベルーナ	14.1	14.5	17,429
銀行業（6.8%）			
じもとホールディングス	59.2	67.9	12,154
めぶきフィナンシャルG	266.8	294	116,130
東京きらぼしFG	8.1	7.8	18,899
九州フィナンシャルG	88.9	90.1	49,284
ゆうちょ銀行	155.4	161.8	216,326
富山第一銀行	14.4	21.3	9,989
コンコルディア・フィナンシャル	357.4	344.9	188,660
西日本フィナンシャルHD	35.8	35.1	44,190
関西みらいFG	—	26.5	25,731
33FG	—	5	11,985
新生銀行	523	46.3	81,812
あおぞら銀行	346	34.1	136,741
三菱UFJフィナンシャルG	4,183	4,012.9	2,819,864
りそなホールディングス	647.2	634.4	396,055
三井住友トラストHD	114.9	113	517,201
三井住友フィナンシャルG	442.4	431.8	1,959,508
第四銀行	63	6.5	30,517
北越銀行	6.4	5.9	13,971
千葉銀行	213	202.6	150,126
群馬銀行	119.2	107.2	61,318
武蔵野銀行	8	8.1	25,717
千葉興業銀行	17.6	23.7	11,399
筑波銀行	30.7	39.2	10,701
七十七銀行	84	16.8	44,587
青森銀行	40	4.6	15,870
秋田銀行	32	4	11,664
山形銀行	27	6.5	16,393
岩手銀行	2.8	4	19,960
東邦銀行	43	49.8	21,065
東北銀行	73	10.4	14,123
みちのく銀行	41	—	—
ふくおかフィナンシャルG	220	236	148,680
静岡銀行	143	140.3	135,810
十六銀行	62	6.8	19,373
スルガ銀行	56.4	59.6	31,826
八十二銀行	103.5	94.3	47,527
山梨中央銀行	33	37	14,911
大垣共立銀行	84	8.1	23,481
福井銀行	51	5.4	13,014
北國銀行	55	6.4	27,936
清水銀行	3	4.1	8,901
滋賀銀行	43	46	26,680
南都銀行	6.5	6	17,154
百五銀行	44	50.7	23,829
京都銀行	99	21.6	123,984
紀陽銀行	19.5	20.6	35,967
三重銀行	3.8	—	—
ほくほくフィナンシャルG	35.1	34.9	54,793
広島銀行	160	77.8	59,361
山陰合同銀行	30.6	32.9	31,748
中国銀行	37.5	35.2	40,620
鳥取銀行	6	—	—
伊予銀行	78.1	75.8	54,424
百十四銀行	52	57	19,380
四国銀行	45	9.3	12,759
阿波銀行	45	43	31,046
大分銀行	29	3.3	13,365
宮崎銀行	38	4.1	13,099
佐賀銀行	32	4.2	9,903
十八銀行	39	42	15,288
沖縄銀行	5.2	5.4	22,167
琉球銀行	11.5	13.4	18,277
セブン銀行	208.5	214	74,044
みずほフィナンシャルG	7,486.6	7,834.1	1,553,502
高知銀行	85	11.9	13,566
山口フィナンシャルG	49	68.7	85,531
長野銀行	4.6	—	—
名古屋銀行	4	4.3	16,297
北洋銀行	84.8	82.7	31,508
愛知銀行	2	2	9,870
第三銀行	3.5	—	—
中京銀行	2.2	3.2	7,532
大光銀行	30	5	10,935
愛媛銀行	7.1	9.2	11,858
トマト銀行	6.2	9.4	14,081
みなと銀行	5.4	—	—
京葉銀行	33	40	19,200
関西アーバン銀行	8.8	—	—
栃木銀行	31.5	32.2	12,397
北日本銀行	3.1	4.3	11,317
東和銀行	119	12.1	12,584
福島銀行	108	18	12,546
大東銀行	45	10.8	13,500
トモニホールディングス	44	46.4	22,364
フィデアホール	68.8	71.5	12,012
池田泉州HD	55.2	57.2	22,193
証券、商品先物取引業（0.9%）			
FPG	20.7	20.9	24,662
SBIホールディングス	62.5	66.1	218,130
ジャフコ	9.5	8.3	34,611
大和証券G本社	497	489	338,388
野村ホールディングス	1,128.3	983.7	532,870
岡三証券グループ	44	46	25,254
丸三証券	17.4	20.5	19,844
東洋証券	32	38	9,652
東海東京HD	57.5	62.5	41,687
光世証券	39	—	—
水戸証券	28.5	25.6	9,779
いちよし証券	12.5	13.7	15,481
松井証券	27.2	29.2	34,923
マネックスG	56.3	63.4	34,299
カブドットコム証券	37.9	39.4	15,050
極東証券	8	8.2	11,939
岩井コスモホールディング	8	8	12,504
藍澤證券	14.8	14	10,752
マネーパートナーズGP	10	—	—
保険業（2.4%）			
かんぽ生命保険	20.1	21.5	56,437
SOMPOホールディングス	115.2	113	536,298
アニコム ホールディングス	4.2	4.4	16,060
MS&AD	154.2	149.6	547,386
SONY FH	53.1	47.7	114,384
第一生命HLDGS	333.2	325.6	749,368
東京海上HD	221.9	216.9	1,181,454
T&Dホールディングス	200.8	176.7	315,762
アドバンスクリエイト	3.5	4.6	11,716
その他金融業（1.2%）			
全国保証	16	16.4	73,964
アルヒ	—	7.3	17,863
クレディセゾン	41.2	42.6	76,722
芙蓉総合リース	6.5	6.6	45,474
興銀リース	9.9	10.8	32,043
東京センチュリー	11	12.1	79,860
日本証券金融	23.8	24.5	16,023
アイフル	99.1	101.7	33,255
リコーリース	4.8	4.2	15,981
イオンフィナンシャルサービス	35.5	39.8	92,734
アコム	116.7	118.6	54,081
ジャックス	32	6.9	15,973
オリコ	118	114.4	18,418
日立キャピタル	12.9	15.7	49,769
アプラスフィナンシャル	—	56.3	6,080
オリックス	390.2	384.8	699,181
三菱UFJリース	140	144.9	95,054
日本取引所グループ	173.4	165.5	332,986
イー・ギャランティ	2.7	9.8	11,377
NECキャピタルソリューション	3.5	4	7,524
不動産業（2.3%）			
いちご	53.6	85.1	36,848
日本駐車場開発	80.7	84.6	15,143
ヒューリック	115.6	119.7	130,473
三栄建築設計	—	3.6	6,026
野村不動産HLDGS	39.3	38	89,756
三重交通グループHD	9.9	15.7	8,729
サムティ	6.2	6.5	11,719
日本商業開発	4.7	5.1	9,501
プレサンスコーポレーション	9.7	9.2	13,800
ユニゾホールディングス	5.5	8	17,520
日本管理センター	4.6	6.7	8,696
フージャースHD	10.9	17.4	12,284
オープンハウス	9.4	10	55,800
東急不動産HD	129.3	138	108,744
飯田GHD	45.4	47.3	94,931
パーク24	30.9	34	114,410
パラカ	3.5	2.9	6,887
三井不動産	293.2	288.2	759,839
三菱地所	411.4	429.3	828,549
平和不動産	11.3	10.6	21,486
東京建物	59	61.3	83,429
ダイビル	14.4	14.7	17,934
京阪神ビルディング	12.7	12.3	10,762

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友不動産	133	139	554,749
大京	105	9	20,367
テーオーシー	19.5	20.6	17,345
東京楽天地	1.4	—	—
レオパレス21	68.7	69.3	41,926
スターツコーポレーション	7.8	7.8	18,868
フジ住宅	10.5	11.7	10,576
空港施設	7.6	12.2	7,771
ゴールドクレスト	5.4	4.7	8,807
日本エスリード	—	4.1	6,318
日神不動産	11.1	11.8	6,619
日本エスコン	—	13.3	10,852
タカラレーベン	25.2	29.8	10,310
サンヨーハウジ 名古屋	8.2	10.1	11,322
イオンモール	36	36.3	71,111
ファースト住建	4	—	—
カチタス	—	8.3	28,510
トーセイ	10.1	10.2	11,291
エヌ・ティ・ティ都市開発	34	35.6	44,179
サンフロンティア不動産	7.1	8.7	11,536
エフ・ジェー・ネクスト	8.9	7	6,335
グランディハウス	16	19	9,063
日本空港ビルデング	17.7	17	85,850
サービス業（4.7%）			
日本工営	4.5	4.2	12,343
ＬＩＦＵＬＬ	16.4	21.8	13,494
ジェイエイシーリクルートメント	4.9	5.3	13,191
日本M&Aセンター	17.2	39.8	129,549
タケエイ	6.7	9.1	7,507
トラスト・テック	3.8	3.2	14,624
コシダカホールディングス	—	16.2	19,602
パソナグループ	5.8	6.2	10,509
ＣＤＳ	6.3	7	10,241
リンクアンドモチベーション	13	12.2	15,286
ＧＣＡ	7.5	9.6	8,496
エス・エム・エス	8.8	22.9	48,799
パーソルホールディングス	46.1	52.5	133,612
リニカル	4.1	4.8	8,395
クックパッド	17.9	21.9	9,789
スタジオアリス	2.9	3.9	9,083
シミックホールディングス	3.4	4.3	9,804
綜合警備保障	21.6	22.6	114,356
カカクコム	42.3	43.3	93,181
ルネサンス	5.2	—	—
ディップ	8.4	8.5	22,380
オプトホールディング	6.7	4.4	12,865
新日本科学	8.6	—	—
ツクイ	16.3	15.6	16,005
エムスリー	51.6	59.8	308,568
アウトソーシング	3.4	25.3	40,201
ウェルネット	5.7	9.7	9,903
ワールドホールディングス	—	2	6,470
ディー・エヌ・エー	27	30.5	58,529
博報堂ＤＹ HLDGS	81.5	78	153,036
ぐるなび	8.7	11	10,252

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エスアールジータカミヤ	10.4	—	—
ジャパンベストレスキューＳ	16.5	—	—
ファンコミュニケーションズ	16.3	19	12,901
WDBホールディングス	—	3.1	12,136
ティア	10.1	7.8	7,402
バリューコマース	—	4.6	10,635
インフォマート	29.3	32.2	45,080
JPホールディングス	23.7	25.8	8,101
EPSホールディングス	8.3	9.2	21,804
プレステージ・インター	13.2	13.3	17,396
アミューズ	3.9	4.2	13,125
ドリームインキュベータ	2.7	3.1	6,559
クイック	5.1	5	9,965
ＴＡＣ	—	17.1	4,565
ケネディクス	76.4	55.9	37,117
電通	65.1	68.3	354,477
ぴあ	—	2	11,420
イオンファンタジー	2.1	2.2	8,118
シーティーエス	9.8	—	—
ネクシィーズグループ	—	3.6	7,182
みらかホールディングス	14.6	16.5	54,532
アルプス技研	3.1	6	15,132
オリエンタルランド	63.3	66.3	776,041
ダスキン	14.4	14.9	41,749
明光ネットワークジャパン	7.9	9.7	10,078
ファルコホールディングス	6.6	8.2	15,219
ラウンドワン	19.5	18.4	25,962
リゾートトラスト	22.7	23.4	43,734
ビー・エム・エル	7.5	7.9	26,504
りらいあコミュニケーショ	10.7	9.9	14,394
リソー教育	12.9	11.7	10,471
ユー・エス・エス	70.8	67.8	143,803
サイバーエージェント	36	35	221,200
楽天	276.3	262.4	220,573
テー・オー・ダブリュー	8.9	13.1	10,427
セントラルスポーツ	3.2	2.5	10,850
フルキャストホールディングス	6	6.6	16,995
テクノプロ・ホールディング	10	10.8	72,576
イー・ガーディアン	—	3.8	10,111
ジャパンマテリアル	4.5	17.1	24,367
ベクトル	6.2	7.6	19,471
アサンテ	4.2	4.7	11,186
Ｎ・フィールド	4.5	4.8	8,740
M&Aキャピタルパートナー	—	1.7	10,676
エスクローＡＪ	—	12.7	5,435
日本ビューホテル	—	8.2	11,045
リクルートホールディングス	385.7	432.5	1,585,112
日本郵政	149.8	315.7	423,985
ベルシステム24HLDGS	10.1	10.6	18,899
ソラスト	—	12.1	15,790
リログループ	30.4	31.1	99,053
東祥	2.1	4.2	18,858
エイチ・アイ・エス	8.7	10	38,000
共立メンテナンス	9.5	10.3	48,152
イチネンホールディングス	7.1	8.6	12,667

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
建設技術研究所	7.2	7.6	12,950
スバル興業	—	1.2	6,756
東京テアトル	60	7	9,688
タナベ経営	4.3	—	—
ナガワ	1.1	—	—
よみうりランド	15	1.9	8,654
東京都競馬	4.3	4	16,600
常磐興産	5.8	6.4	11,923
カナモト	8.4	8	31,720
東京ドーム	22.6	22.9	23,060
西尾レントオール	4.9	5.8	20,851
トランス・コスモス	6.8	6.7	18,927
乃村工藝社	13.5	13.6	30,695
藤田観光	2.2	3	10,305
KNT−CTホールディングス	40	4.5	5,562
日本管財	5.2	6.9	14,876
トーカイ	2.7	5.8	14,865
セコム	60.3	59.7	554,792
セントラル警備保障	3.5	3.2	14,384
丹青社	12.1	12.8	15,270
メイテツク	6.9	6.7	36,247
アサツー ディ・ケイ	10	—	—
応用地質	7	7.3	10,811
船井総研ホールディン	8.3	12.2	29,548
オオバ	—	16.3	10,220
学究社	5.1	7	12,523
ベネッセホールディングス	19.8	19.8	66,825
イオンディライト	6.5	7.8	32,292
ニチイ学館	11.6	11.9	11,328
ダイセキ	10.2	9.6	27,504
	千株	千株	千円
合計 株数、金額	83,168.1	70,601.2	148,894,152
合計 銘柄数<比率>	1,488銘柄	1,498銘柄	<99.4%>

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

(2)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

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

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項目	当期末	
	貸付	借入
	株	株
株式	4,046,400 (837,100)	— (—)

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

＊期首における元本額は132,992,880,740円、当期中における追加設定元本額は17,323,849,993円、同解約元本額は16,994,005,833円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド4,246,087,218円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ9,335,647,683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ＶＡ2　50,961,008円、ダイワ国内重視バランスファンド30ＶＡ（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50ＶＡ（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30ＶＡ（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50ＶＡ（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　ＴＯＰＩＸ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　ＴＯＰＩＸ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15ＶＡ337,828円、ダイワ世界分散バランスファンド20ＶＡ347,186円、ダイワ世界分散バランスファンド20ＶＡ（国内株式型）686,510円、ダイワ世界分散バランスファンド25ＶＡ4,016,770円、ダイワ世界分散バランスファンド30ＶＡ8,380,481円、ダイワ世界分散バランスファンド30ＶＡ（国内株式型）9,446,810円、ダイワ世界バランスファンド40ＶＡ212,247,455円、ダイワ世界バランスファンド60ＶＡ168,882,290円、ダイワ・バランスファンド35ＶＡ9,877,017,535円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50ＶＡ21,077,804円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75ＶＡ25,269,263円、ダイワ・バランスファンド25ＶＡ（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25ＶＡ（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30ＶＡ（適格機関投資家専用）223,180,217円、ダイワ・ノーロード　ＴＯＰＩＸファンド123,940,950円、ダイワファンドラップ　ＴＯＰＩＸインデックス8,293,640,110円、ダイワＴＯＰＩＸ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　ＴＯＰＩＸインデックス1,843,135,534円、ダイワ・インデックスセレクト　ＴＯＰＩＸ1,389,161,216円、ダイワライフスタイル25　179,686,588円、ダイワライフスタイル50　634,139,972円、ダイワライフスタイル75　542,537,590円、ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）13,546,528,305円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は11,233円です。

■損益の状況

当期　自 2017年9月20日　至 2018年9月19日

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

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

ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

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おります。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

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/

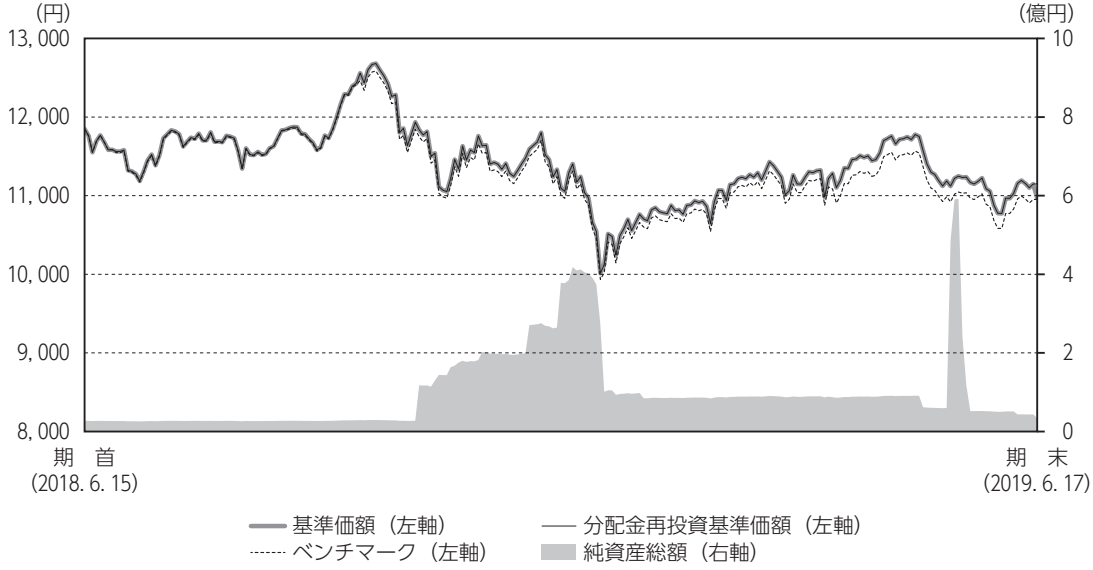
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	10,201	70	2.7	19,831.82	2.0	98.7	1.8	1
2期末(2018年6月15日)	11,850	90	17.0	22,851.75	15.2	99.0	1.7	27
3期末(2019年6月17日)	10,971	180	△ 5.9	21,124.00	△ 7.6	99.3	2.3	33

(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。
＊ベンチマークは日経平均株価です。

■基準価額・騰落率

期　首：11,850円
期　末：10,971円（分配金180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	11,850	—	22,851.75	—	99.0	1.7
6月末	11,580	△ 2.3	22,304.51	△ 2.4	98.6	1.4
7月末	11,706	△ 1.2	22,553.72	△ 1.3	98.5	1.5
8月末	11,871	0.2	22,865.15	0.1	98.8	1.2
9月末	12,603	6.4	24,120.04	5.6	98.1	1.8
10月末	11,460	△ 3.3	21,920.46	△ 4.1	98.0	2.0
11月末	11,684	△ 1.4	22,351.06	△ 2.2	98.0	2.0
12月末	10,481	△ 11.6	20,014.77	△ 12.4	98.3	1.7
2019年1月末	10,875	△ 8.2	20,773.49	△ 9.1	98.8	1.2
2月末	11,201	△ 5.5	21,385.16	△ 6.4	99.0	1.0
3月末	11,194	△ 5.5	21,205.81	△ 7.2	97.2	2.7
4月末	11,752	△ 0.8	22,258.73	△ 2.6	97.7	2.3
5月末	10,876	△ 8.2	20,601.19	△ 9.8	97.9	2.1
(期末)2019年6月17日	11,151	△ 5.9	21,124.00	△ 7.6	99.3	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、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ＦＲＢ（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、ＦＲＢ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。なお、当作成期末の実質株式組入比率（日経平均先物を含む。以下同じ。）は101. 6％となっておりますが、翌営業日計上のマザー解約金額を考慮した実質組入比率は100％程度となっております。

■ストックインデックス２２５・マザーファンド

株式の組み入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、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。

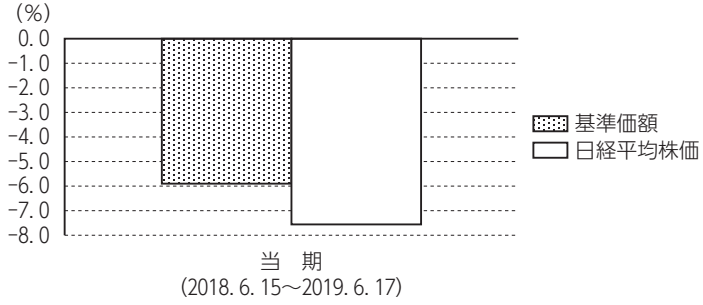
ベンチマークとの差異について

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、プラスのかい離要因となりました。

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

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目			当期 2018年6月16日 ～2019年6月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**180**
	対基準価額比率	（%）	1.61
	当期の収益	（円）	80
	当期の収益以外	（円）	100
翌期繰越分配対象額		（円）	972

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

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

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

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項目		当期
（a）経費控除後の配当等収益	✓	84.19円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益		0.00
（c）収益調整金	✓	1,067.91
（d）分配準備積立金		0.06
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）		1,152.16
（f）分配金		180.00
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）		972.16

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

今後の運用方針

■当ファンド

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

■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	38円	0. 336%	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, 404円です。**
（投 信 会 社）	(24)	(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. 007	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. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	39	0. 345	

（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。

ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（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
ストックインデックス225・マザーファンド	345,545	924,318	342,293	881,592

（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
	ストックインデックス225・マザーファンド
（a）期中の株式売買金額	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					
区分	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	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0.1%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 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		
	ストックインデックス225・マザーファンド		
	買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	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	
	ストックインデックス225・マザーファンド	
	買付額	
		百万円
株式		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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券グループ本社です。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。
（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	9,823	13,075	34,492

（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	%
ストックインデックス225・マザーファンド	34,492	79.1
コール・ローン等、その他	9,111	20.9
投資信託財産総額	43,604	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	**43,604,255円**
コール・ローン等	194,288
ストックインデックス225・マザーファンド（評価額）	34,492,267
未収入金	8,917,700
(B)負債	**9,663,025**
未払収益分配金	556,889
未払解約金	8,917,600
未払信託報酬	185,510
その他未払費用	3,026
(C)純資産総額（A－B）	**33,941,230**
元本	30,938,291
次期繰越損益金	3,002,939
(D)受益権総口数	**30,938,291口**
1万口当り基準価額（C／D）	**10,971円**

＊期首における元本額は22,987,038円、当作成期間中における追加設定元本額は816,750,378円、同解約元本額は808,799,125円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,971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)有価証券売買損益		**152,987円**
売買益		31,949,047
売買損	△	31,796,060
(B)信託報酬等	△	**341,855**
(C)当期損益金（A＋B）	△	**188,868**
(D)前期繰越損益金	△	**4,585**
(E)追加信託差損益金		**3,753,281**
（配当等相当額）	(	900,495)
（売買損益相当額）	(	2,852,786)
(F)合計（C＋D＋E）		**3,559,828**
(G)収益分配金	△	**556,889**
次期繰越損益金（F＋G）		**3,002,939**
追加信託差損益金		3,443,899
（配当等相当額）	(	591,113)
（売買損益相当額）	(	2,852,786)
分配準備積立金		13,162
繰越損益金	△	454,122

（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	260,470円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,303,943
(d) 分配準備積立金	199
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	3,564,612
(f) 分配金	556,889
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	3,007,723
(h) 受益権総口数	30,938,291口

ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
1　万　口　当　り　分　配　金	180円

分配金の課税上の取扱いについて

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

【注記】

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

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用））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48～50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２２５・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２２５・マザーファンド（65,172,307千口）の内容です。

(1)国内株式

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
水産・農林業（0.2%）		
日本水産	292	194,764
マルハニチロ	29.2	92,418
鉱業（0.1%）		
国際石油開発帝石	116.8	107,864
建設業（2.3%）		
コムシスホールディングス	292	791,320
大成建設	58.4	236,520
大林組	292	302,804
清水建設	292	267,180
長谷工コーポレーションヨン	58.4	64,006
鹿島建設	146	220,022
大和ハウス	292	978,784

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
積水ハウス	292	524,724
日揮	292	415,516
千代田化工建	292	94,024
食料品（4.5%）		
日清製粉Ｇ本社	292	736,132
明治ホールディングス	58.4	448,512
日本ハム	146	686,200
サッポロホールディングス	58.4	132,918
アサヒグループホールディン	292	1,435,764
キリンＨＤ	292	669,410
宝ホールディングス	292	331,420
キッコーマン	292	1,354,880
味の素	292	552,610

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ニチレイ	146	402,084
日本たばこ産業	292	729,708
繊維製品（0.2%）		
東洋紡	29.2	35,653
ユニチカ	29.2	10,628
帝人	58.4	104,828
東レ	292	236,140
パルプ・紙（0.1%）		
王子ホールディングス	292	175,492
日本製紙	29.2	54,487
化学（8.5%）		
クラレ	292	371,716
旭化成	292	328,792

ストックインデックス２２５・マザーファンド

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
昭和電工	29.2	89,352
住友化学	292	140,160
日産化学	292	1,394,300
東ソー	146	208,926
トクヤマ	58.4	145,007
デンカ	58.4	183,668
信越化学	292	2,691,364
三井化学	58.4	150,555
三菱ケミカル HLDGS	146	106,828
宇部興産	29.2	61,407
日本化薬	292	375,804
花王	292	2,474,700
ＤＩＣ	29.2	81,263
富士フイルム HLDGS	292	1,572,128
資生堂	292	2,497,476
日東電工	292	1,472,556
医薬品（7.7%）		
協和発酵キリン	292	591,884
武田薬品	292	1,079,524
アステラス製薬	1,460	2,132,330
大日本住友製薬	292	601,520
塩野義製薬	292	1,784,120
中外製薬	292	2,046,920
エーザイ	292	1,828,796
第一三共	292	1,779,156
大塚ホールディングス	292	1,047,988
石油・石炭製品（0.3%）		
出光興産	116.8	352,736
JXTG ホールディングス	292	149,182
ゴム製品（0.9%）		
横浜ゴム	146	285,868
ブリヂストン	292	1,233,408
ガラス・土石製品（1.2%）		
ＡＧＣ	58.4	209,656
日本板硝子	29.2	20,761
日本電気硝子	87.6	230,650
住友大阪セメント	29.2	127,896
太平洋セメント	29.2	94,754
東海カーボン	292	326,456
ＴＯＴＯ	146	609,550
日本碍子	292	435,664

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
鉄鋼（0.1%）		
日本製鉄	29.2	53,392
神戸製鋼所	29.2	19,826
ＪＦＥホールディングス	29.2	44,092
大平洋金属	29.2	61,349
非鉄金属（0.9%）		
日本軽金属ＨＤ	292	68,328
三井金属	29.2	71,014
東邦亜鉛	29.2	69,437
三菱マテリアル	29.2	86,461
住友鉱山	146	423,400
DOWA ホールディングス	58.4	202,356
古河電工	29.2	88,330
住友電工	292	396,244
フジクラ	292	107,456
金属製品（0.4%）		
ＳＵＭＣＯ	29.2	35,069
東洋製罐グループ HD	292	653,204
機械（4.9%）		
日本製鋼所	58.4	105,178
オークマ	58.4	307,768
アマダホールディングス	292	338,720
小松製作所	292	709,560
住友重機械	58.4	205,276
日立建機	292	822,856
クボタ	292	513,190
荏原製作所	58.4	167,549
ダイキン工業	292	4,045,660
日本精工	292	261,924
ＮＴＮ	292	87,892
ジェイテクト	292	355,364
日立造船	58.4	20,848
三菱重工業	29.2	135,663
ＩＨＩ	29.2	75,277
電気機器（17.4%）		
日清紡ホールディングス	292	235,644
コニカミノルタ	292	296,088
ミネベアミツミ	292	484,428
日立	58.4	231,672
三菱電機	292	397,996
富士電機	58.4	214,620

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
安川電機	292	956,300
オムロン	292	1,550,520
ジーエス・ユアサ コーポ	58.4	117,033
日本電気	29.2	117,968
富士通	29.2	220,606
沖電気	29.2	37,872
セイコーエプソン	584	963,016
パナソニック	292	250,419
ソニー	292	1,645,420
ＴＤＫ	292	2,210,440
アルプスアルパイン	292	524,432
横河電機	292	595,680
アドバンテスト	584	1,476,936
カシオ	292	386,608
ファナック	292	5,629,760
京セラ	584	4,028,432
太陽誘電	292	524,140
SCREEN ホールディングス	58.4	228,344
キヤノン	438	1,379,262
リコー	292	312,440
東京エレクトロン	292	4,165,380
輸送用機器（5.1%）		
デンソー	292	1,302,320
三井 E&SHD	29.2	27,126
川崎重工業	29.2	72,562
日産自動車	292	221,306
いすゞ自動車	146	178,850
トヨタ自動車	292	1,964,284
日野自動車	292	257,836
三菱自動車工業	29.2	14,600
マツダ	58.4	64,473
本田技研	584	1,620,600
スズキ	292	1,511,684
SUBARU	292	750,002
ヤマハ発動機	292	549,544
精密機器（3.5%）		
テルモ	1,168	3,780,816
ニコン	292	437,416
オリンパス	1,168	1,440,144
シチズン時計	292	153,300
その他製品（1.2%）		
凸版印刷	146	239,294

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
大日本印刷	146	351,276
ヤマハ	292	1,495,040
電気・ガス業（0.2%）		
東京電力ＨＤ	29.2	16,614
中部電力	29.2	44,719
関西電力	29.2	36,354
東京瓦斯	58.4	154,088
大阪瓦斯	58.4	111,018
陸運業（2.3%）		
東武鉄道	58.4	183,668
東京急行	146	284,992
小田急電鉄	146	392,448
京王電鉄	58.4	428,072
京成電鉄	146	589,110
東日本旅客鉄道	29.2	299,738
西日本旅客鉄道	29.2	256,376
東海旅客鉄道	29.2	664,008
日本通運	29.2	160,600
ヤマトホールディングス	292	648,532
海運業（0.1%）		
日本郵船	29.2	46,661
商船三井	29.2	69,058
川崎汽船	29.2	33,550
空運業（0.1%）		
ANAホールディングス	29.2	106,317
倉庫・運輸関連業（0.3%）		
三菱倉庫	146	454,060
情報・通信業（11.4%）		
ヤフー	116.8	35,740
トレンドマイクロ	292	1,443,940
スカパーJSATHD	29.2	12,147
日本電信電話	58.4	294,336
ＫＤＤＩ	1,752	4,785,588
ＮＴＴドコモ	29.2	72,591
東宝	29.2	142,350
ＮＴＴデータ	1,460	1,966,620
コナミホールディングス	292	1,497,960
ソフトバンクグループ	876	8,926,440
卸売業（2.1%）		
双日	29.2	10,132
伊藤忠	292	590,570

銘柄	2019年６月17日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
丸紅	292	208,517
豊田通商	292	946,080
三井物産	292	511,000
住友商事	292	467,638
三菱商事	292	840,084
小売業（15.2%）		
J.フロント リテイリング	146	166,878
三越伊勢丹ＨＤ	292	260,172
セブン＆アイ・HLDGS	292	1,081,276
ユニー・ファミリーマートHD	1,168	3,112,720
高島屋	146	161,768
丸井グループ	292	679,484
イオン	292	542,390
ファーストリテイリング	292	19,543,560
銀行業（0.7%）		
コンコルディア・フィナンシャル	292	115,340
新生銀行	29.2	48,326
あおぞら銀行	29.2	74,606
三菱UFJフィナンシャルＧ	292	147,080
りそなホールディングス	29.2	12,848
三井住友トラストHD	29.2	113,296
三井住友フィナンシャルＧ	29.2	109,967
千葉銀行	292	155,052
ふくおかフィナンシャルＧ	58.4	112,186
静岡銀行	292	234,184
みずほフィナンシャルG	292	44,208
証券、商品先物取引業（0.3%）		
大和証券Ｇ本社	292	137,094
野村ホールディングス	292	101,820
松井証券	292	299,592
保険業（1.0%）		
SOMPOホールディングス	73	309,301
ＭＳ＆ＡＤ	87.6	306,249
ＳＯＮＹ ＦＨ	58.4	152,190
第一生命HLDGS	29.2	47,391
東京海上ＨＤ	146	808,548
T&Dホールディングス	58.4	66,342
その他金融業（0.2%）		
クレディセゾン	292	362,664
不動産業（1.7%）		
東急不動産ＨＤ	292	175,492

銘柄		2019年６月17日現在	
		株数	評価額
		千株	千円
三井不動産		292	773,800
三菱地所		292	597,432
東京建物		146	171,988
住友不動産		292	1,183,768
サービス業（4.9%）			
ディー・エヌ・エー		87.6	191,931
電通		292	1,102,300
サイバーエージェント		58.4	240,024
楽天		292	372,592
リクルートホールディングス		876	3,053,736
日本郵政		292	347,772
東京ドーム		146	157,534
セコム		292	2,748,596
		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%＞

（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
		百万円	百万円
国内	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）

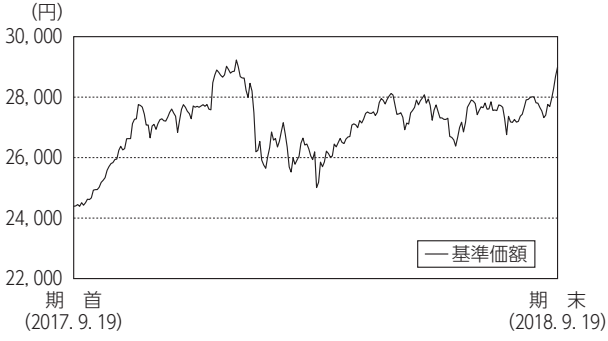
ストックインデックス２２５・マザーファンドの第17期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★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



年月日	基準価額		日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%	円	%	%	%
(期首)2017年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。

《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。

■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	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
	千株	千円	千株	千円
国内	9,299.6 (△ 7,336.8)	30,367,771 (—)	8,566.9	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
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	42,950	44,114	—	—

(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)

当期 買付 銘柄	株数	金額	平均単価	当期 売付 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	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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.2%）			
日本水産	250	252	161,532
マルハニチロ	25	25.2	102,438
鉱業（0.1%）			
国際石油開発帝石	100	100.8	138,448
建設業（2.5%）			
コムシスホールディングス	250	252	817,740
大成建設	250	50.4	252,504
大林組	250	252	274,176
清水建設	250	252	252,252
長谷工コーポレーション	50	50.4	75,297
鹿島建設	250	252	202,356
大和ハウス	250	252	831,852
積水ハウス	250	252	436,716
日揮	250	252	605,556
千代田化工建	250	252	213,948
食料品（4.5%）			
日清製粉Ｇ本社	250	252	583,128
明治ホールディングス	50	50.4	375,480
日本ハム	250	126	510,300
サッポロホールディングス	50	50.4	117,784
アサヒグループホールディン	250	252	1,241,352
キリンＨＤ	250	252	732,564
宝ホールディングス	250	252	383,544
キッコーマン	250	252	1,670,760
味の素	250	252	481,950
ニチレイ	125	126	363,384
日本たばこ産業	250	252	753,480
繊維製品（0.2%）			
東洋紡	250	25.2	47,527
ユニチカ	250	25.2	17,791
帝人	50	50.4	111,535
東レ	250	252	218,383
パルプ・紙（0.2%）			
王子ホールディングス	250	252	205,632
日本製紙	25	25.2	51,206
北越コーポレーション	250	—	—
化学（8.8%）			
クラレ	250	252	413,784
旭化成	250	252	425,880
昭和電工	25	25.2	136,080
住友化学	250	252	162,540
日産化学	250	252	1,512,000
東ソー	250	126	216,972
トクヤマ	250	50.4	154,980
デンカ	250	50.4	192,024
信越化学	250	252	2,477,916
三井化学	250	50.4	143,035
三菱ケミカル HLDGS	125	126	127,323
宇部興産	250	25.2	71,895
日本化薬	250	252	331,884
花王	250	252	2,281,860
富士フイルム HLDGS	250	252	1,287,468
資生堂	250	252	1,997,856
日東電工	250	252	2,146,032
医薬品（8.5%）			
協和発酵キリン	250	252	528,444
武田薬品	250	252	1,180,872
アステラス製薬	1,250	1,260	2,528,190
大日本住友製薬	250	252	611,604
塩野義製薬	250	252	1,818,432
中外製薬	250	252	1,758,960
エーザイ	250	252	2,657,340
第一三共	250	252	1,154,160
大塚ホールディングス	250	252	1,364,076
石油・石炭製品（0.5%）			
昭和シエル石油	250	252	611,604
JXTG ホールディングス	250	252	210,420
ゴム製品（0.9%）			
横浜ゴム	125	126	300,384
ブリヂストン	250	252	1,069,740
ガラス・土石製品（1.5%）			
ＡＧＣ	50	50.4	238,392
日本板硝子	25	25.2	30,567
日本電気硝子	75	75.6	261,954
住友大阪セメント	250	252	122,724
太平洋セメント	250	25.2	86,688
東海カーボン	250	252	520,128
ＴＯＴＯ	125	126	616,770
日本碍子	250	252	455,112
鉄鋼（0.2%）			
新日鐵住金	25	25.2	58,224
神戸製鋼所	25	25.2	24,091
ＪＦＥホールディングス	25	25.2	62,924
日新製鋼	25	25.2	40,622
大平洋金属	250	25.2	94,626
非鉄金属（1.1%）			
日本軽金属ＨＤ	250	252	62,244
三井金属	250	25.2	77,616
東邦亜鉛	250	25.2	102,060
三菱マテリアル	25	25.2	81,774
住友鉱山	250	126	477,036
DOWA ホールディングス	250	50.4	175,392
古河機金	250	25.2	41,202
古河電工	25	25.2	94,248
住友電工	250	252	453,348
フジクラ	250	252	152,208
金属製品（0.4%）			
ＳＵＭＣＯ	25	25.2	42,184
東洋製罐グループ HD	250	252	584,388
機械（5.2%）			
日本製鋼所	50	50.4	140,666
オークマ	250	50.4	312,480
アマダホールディングス	250	252	294,084
小松製作所	250	252	827,064
住友重機械	250	50.4	196,560
日立建機	250	252	888,300
クボタ	250	252	465,696
荏原製作所	50	50.4	196,560
ダイキン工業	250	252	3,932,460
日本精工	250	252	319,536
ＮＴＮ	250	252	115,920
ジェイテクト	250	252	411,012
日立造船	50	50.4	23,234
三菱重工業	250	25.2	104,907
ＩＨＩ	250	25.2	111,762
電気機器（17.6%）			
日清紡ホールディングス	250	252	332,136
コニカミノルタ	250	252	298,368
ミネベアミツミ	250	252	540,036
日立	250	252	188,294
三菱電機	250	252	384,678
富士電機	250	252	233,352
安川電機	250	252	882,000
明電舎	250	—	—
ジーエス・ユアサ コーポ	250	252	140,364
日本電気	250	25.2	77,112
富士通	250	252	205,279
沖電気	25	25.2	36,288
セイコーエプソン	500	504	984,816
パナソニック	250	252	339,570
ソニー	250	252	1,683,864
ＴＤＫ	250	252	3,071,880
アルプス電気	250	252	784,980
パイオニア	250	252	26,964
横河電機	250	252	591,948
アドバンテスト	500	504	1,212,624
カシオ	250	252	468,720
ファナック	250	252	5,586,840
京セラ	500	504	3,335,976
太陽誘電	250	252	708,372
SCREEN ホールディングス	50	50.4	368,424
キヤノン	375	378	1,343,034
リコー	250	252	300,132

ストックインデックス225・マザーファンド

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京エレクトロン	250	252	4,125,240
輸送用機器（5.8%）			
デンソー	250	252	1,438,164
三井E&SHD	250	25.2	51,030
川崎重工業	250	25.2	79,758
日産自動車	250	252	273,798
いすゞ自動車	125	126	220,752
トヨタ自動車	250	252	1,768,788
日野自動車	250	252	311,472
三菱自動車工業	25	25.2	19,807
マツダ	50	50.4	66,654
本田技研	500	504	1,705,032
スズキ	250	252	1,789,452
SUBARU	250	252	823,788
ヤマハ発動機	250	252	737,604
精密機器（3.2%）			
テルモ	500	504	3,291,120
ニコン	250	252	539,784
オリンパス	250	252	1,127,700
シチズン時計	250	252	187,236
その他製品（1.3%）			
凸版印刷	250	252	229,572
大日本印刷	250	126	334,530
ヤマハ	250	252	1,469,160
電気・ガス業（0.2%）			
東京電力ＨＤ	25	25.2	13,482
中部電力	25	25.2	43,054
関西電力	25	25.2	41,139
東京瓦斯	250	50.4	139,658
大阪瓦斯	250	50.4	109,922
陸運業（2.3%）			
東武鉄道	250	50.4	171,612
東京急行	125	126	258,930
小田急電鉄	125	126	340,956
京王電鉄	250	50.4	315,000
京成電鉄	125	126	495,180
東日本旅客鉄道	25	25.2	268,884
西日本旅客鉄道	25	25.2	196,887
東海旅客鉄道	25	25.2	586,404
日本通運	250	25.2	187,236
ヤマトホールディングス	250	252	849,996
海運業（0.1%）			
日本郵船	250	25.2	53,298
商船三井	250	25.2	79,632
川崎汽船	250	25.2	56,624
空運業（0.1%）			
ANAホールディングス	250	25.2	99,414
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
三菱倉庫	250	126	353,682
情報・通信業（11.3%）			
ヤフー	100	100.8	41,126
トレンドマイクロ	250	252	1,794,240
スカパーJSATHD	25	25.2	13,910
日本電信電話	50	50.4	259,761
ＫＤＤＩ	1,500	1,512	4,672,080
ＮＴＴドコモ	25	25.2	76,834
東宝	25	25.2	89,334
ＮＴＴデータ	1,250	1,260	1,964,340
コナミホールディングス	250	252	1,078,560
ソフトバンクグループ	750	756	8,251,740
卸売業（2.3%）			
双日	25	25.2	10,155
伊藤忠	250	252	527,310
丸紅	250	252	251,344
豊田通商	250	252	1,030,680
三井物産	250	252	495,306
住友商事	250	252	472,878
三菱商事	250	252	875,196
小売業（12.7%）			
J. フロント リテイリング	125	126	208,404
三越伊勢丹ＨＤ	250	252	340,452
セブン＆アイ・HLDGS	250	252	1,285,200
ユニー・ファミリーマートHD	250	252	2,787,120
高島屋	250	126	234,360
丸井グループ	250	252	677,880
イオン	250	252	671,202
ファーストリテイリング	250	252	14,169,960
銀行業（0.8%）			
コンコルディア・フィナンシャル	250	252	137,844
新生銀行	250	25.2	44,528
あおぞら銀行	250	25.2	101,052
三菱UFJフィナンシャルG	250	252	177,080
りそなホールディングス	25	25.2	15,732
三井住友トラストHD	25	25.2	115,340
三井住友フィナンシャルG	25	25.2	114,357
千葉銀行	250	252	186,732
ふくおかフィナンシャルG	250	252	158,760
静岡銀行	250	252	243,936
みずほフィナンシャルG	250	252	49,971
証券、商品先物取引業（0.4%）			
大和証券G本社	250	252	174,384
野村ホールディングス	250	252	136,508
松井証券	250	252	301,392
保険業（1.0%）			
SOMPOホールディングス	62.5	63	298,998
ＭＳ＆ＡＤ	75	75.6	276,620
ＳＯＮＹ ＦＨ	50	50.4	120,859
第一生命HLDGS	25	25.2	57,997
東京海上ＨＤ	125	126	686,322
T&Dホールディングス	50	50.4	90,064
その他金融業（0.3%）			
クレディセゾン	250	252	453,852
不動産業（1.6%）			
東急不動産ＨＤ	250	252	198,576
三井不動産	250	252	664,398
三菱地所	250	252	486,360
東京建物	125	126	171,486
住友不動産	250	252	1,005,732
サービス業（4.5%）			
ディー・エヌ・エー	75	75.6	145,076
電通	250	252	1,307,880
楽天	250	252	211,831
リクルートホールディングス	—	756	2,770,740
日本郵政	—	252	338,436
東京ドーム	125	126	126,882
セコム	250	252	2,341,836
	千株	千株	千円
合計 株数、金額	50,187.5	43,583.4	160,769,568
合計 銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<97.9%>

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

(2)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	日経平均	1,881	—

（注）単位未満は切捨て。

■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	160,769,568	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
(A)資産	**167,241,390,410円**
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)負債	**2,956,147,788**
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
(C)純資産総額（A－B）	**164,285,242,622**
元本	56,651,695,845
次期繰越損益金	107,633,546,777
(D)受益権総口数	**56,651,695,845口**
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225VA729,679,107円、大和 ストック インデックス225 ファンド9,955,023,672円、D－I'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
(A)配当等収益		**2,657,009,415円**
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)有価証券売買損益		**22,714,236,311**
売買益		28,423,577,616
売買損	△	5,709,341,305
(C)先物取引等損益		**547,105,405**
取引益		902,243,165
取引損	△	355,137,760
(D)その他費用	△	**817,994**
(E)当期損益金（A＋B＋C＋D）		**25,917,533,137**
(F)前期繰越損益金		**81,864,245,513**
(G)解約差損益金	△	**23,893,274,665**
(H)追加信託差損益金		**23,745,042,792**
(I)合計（E＋F＋G＋H）		**107,633,546,777**
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。

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版）

第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。

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

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/

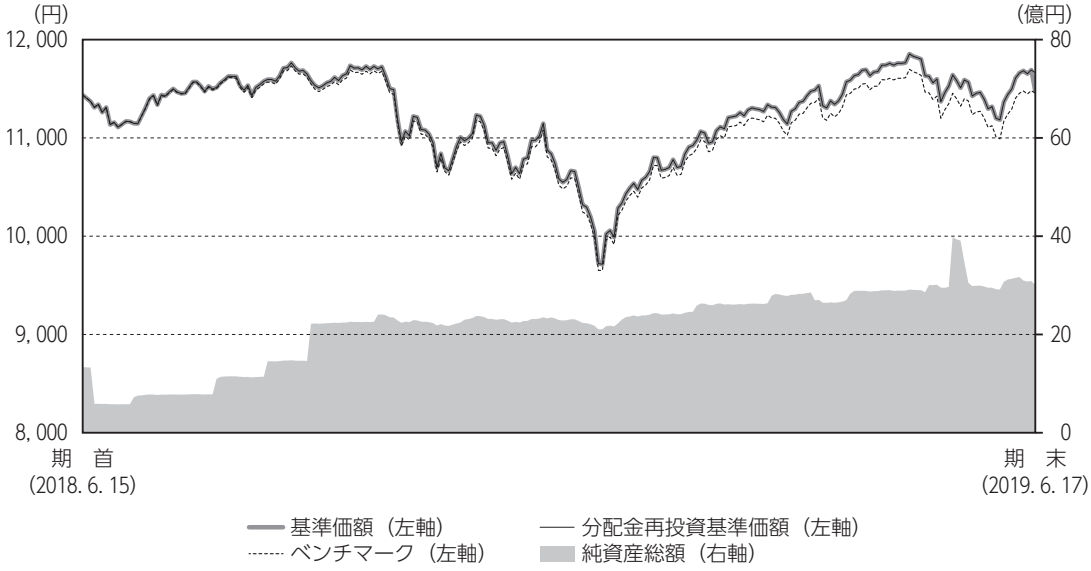
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
1期末（2017年６月15日）	10,413	60	4.7	10,395	4.0	94.0	3.8	0.0	2.5	3
2期末（2018年６月15日）	11,436	100	10.8	11,319	8.9	96.6	3.4	—	2.3	1,333
3期末（2019年６月17日）	11,475	190	2.0	11,338	0.2	93.1	6.1	—	2.8	3,003

（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、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
＊ベンチマークはＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

■基準価額・騰落率

期　首：11,436円
期　末：11,475円（分配金190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		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
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2018年６月15日	11,436	—	11,319	—	96.6	3.4	—	2.3
６月末	11,140	△ 2.6	11,024	△ 2.6	97.0	2.0	—	2.5
７月末	11,474	0.3	11,348	0.3	95.5	2.5	—	2.4
８月末	11,712	2.4	11,560	2.1	93.3	3.6	—	2.3
９月末	11,728	2.6	11,560	2.1	95.5	5.0	—	2.3
10月末	10,783	△ 5.7	10,631	△ 6.1	93.0	3.6	—	2.5
11月末	10,975	△ 4.0	10,796	△ 4.6	91.5	6.8	—	2.5
12月末	10,058	△ 12.0	9,889	△ 12.6	91.6	2.6	—	2.5
2019年１月末	10,838	△ 5.2	10,649	△ 5.9	90.5	6.9	—	2.5
２月末	11,288	△ 1.3	11,070	△ 2.2	91.6	7.5	—	2.6
３月末	11,376	△ 0.5	11,131	△ 1.7	94.4	2.2	—	2.8
４月末	11,817	3.3	11,539	1.9	96.0	2.1	—	2.7
５月末	11,319	△ 1.0	11,010	△ 2.7	92.2	3.0	—	2.8
(期末)2019年６月17日	11,665	2.0	11,338	0.2	93.1	6.1	—	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。なお、当作成期末のマザーファンド組入比率は101. 6%となっておりますが、翌営業日計上のマザー解約金額を考慮したマザーファンド実質組入比率は100%程度となっております。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

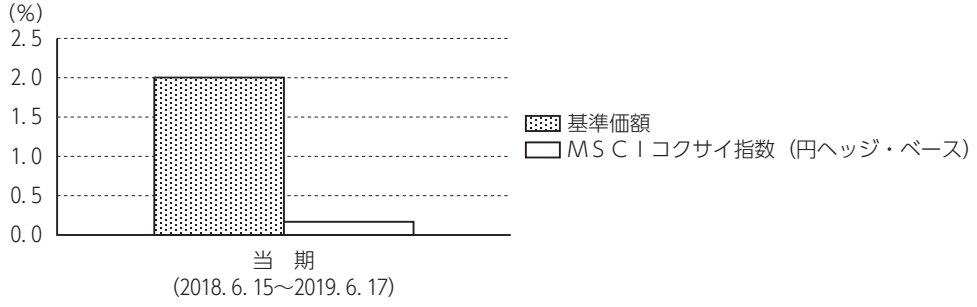
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（リート、株式先物を含む。）のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

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

当作成期の１万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（１万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項目			当期 2018年６月16日 ～2019年６月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**190**
	対基準価額比率	（%）	1.63
	当期の収益	（円）	140
	当期の収益以外	（円）	50
翌期繰越分配対象額		（円）	1,474

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

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

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

■収益分配金の計算過程（１万口当り）

項目		当期
（ａ）経費控除後の配当等収益	✓	168.47円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益		50.33
（ｃ）収益調整金	✓	1,404.33
（ｄ）分配準備積立金		41.83
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		1,664.98
（ｆ）分配金		190.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		1,474.98

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

今後の運用方針

■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率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	49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11, 240円です。**
（投 信 会 社）	(35)	(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）	(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	1	0. 006	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. 008	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. 008)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	5	0. 042	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. 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. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(1)	(0. 004)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	56	0. 496	

（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	2,008,138	3,816,156	1,144,772	2,178,189

（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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	710,331	1,573,697	3,053,130

（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	3,053,130	99.0
コール・ローン等、その他	32,290	1.0
投資信託財産総額	3,085,421	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・シュケル＝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	**3,085,421,348円**
コール・ローン等	6,260,794
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）	3,053,130,554
未収入金	26,030,000
（B）負債	**81,703,448**
未払収益分配金	49,734,807
未払解約金	25,958,431
未払信託報酬	5,936,325
その他未払費用	73,885
（C）純資産総額（A－B）	**3,003,717,900**
元本	2,617,621,424
次期繰越損益金	386,096,476
（D）受益権総口数	**2,617,621,424口**
１万口当り基準価額（C／D）	**11,475円**

＊期首における元本額は1,166,051,379円、当作成期間中における追加設定元本額は3,354,512,466円、同解約元本額は1,902,942,421円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は11,475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	△ **1,172円**
受取利息	461
支払利息	△ 1,633
(B)有価証券売買損益	**67,095,833**
売買益	86,446,847
売買損	△ 19,351,014
(C)信託報酬等	△ **9,817,674**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	**57,276,987**
(E)前期繰越損益金	**10,951,327**
(F)追加信託差損益金	**367,602,969**
（配当等相当額）	(164,672,133)
（売買損益相当額）	(202,930,836)
(G)合計（D＋E＋F）	**435,831,283**
(H)収益分配金	△ **49,734,807**
次期繰越損益金（G＋H）	**386,096,476**
追加信託差損益金	354,514,862
（配当等相当額）	(151,584,026)
（売買損益相当額）	(202,930,836)
分配準備積立金	31,581,614

（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	44,100,538円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	13,176,449
(c) 収益調整金	367,602,969
(d) 分配準備積立金	10,951,327
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	435,831,283
(f) 分配金	49,734,807
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	386,096,476
(h) 受益権総口数	2,617,621,424口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１　万　口　当　り　分　配　金	**190円**

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

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（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67～96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（ジャージィー）	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, 237千口）の内容です。

(1)外国株式

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	
(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

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	
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
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

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	
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

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	
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
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

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	
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
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
FREEPORT-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

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	
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

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	
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
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

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	
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
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

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	
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
SYNOPSYS 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

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	
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
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

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	
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 SOFTWRE	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
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

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	
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
KOHLS 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

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	
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
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、金額	29,636.4	241,569	26,248,965	
	銘柄数<比率>	615銘柄		<62.6%>	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
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

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	
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 LIFECO 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
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

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千カナダ・ドル	千円	
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	3,902.88	17,897	1,449,690	
	銘柄数<比率>	86銘柄		<3.5%>	
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)					
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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
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
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	6,895.23	12,306	919,638	
	銘柄数<比率>	55銘柄		<2.2%>	
		百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
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
WHEELOCK & CO LTD		60	316	4,385	不動産

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千香港・ドル	千円	
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	9,127.04	36,841	510,992	
	銘柄数<比率>	37銘柄		<1.2%>	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
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
YANGZIJIANG 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
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	3,670	2,201	174,461	
	銘柄数<比率>	21銘柄		<0.4%>	

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	696.05	495	35,008	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<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

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	千イギリス・ポンド	千円	
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
SCHRODERS 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
ASHTEAD GROUP PLC	39	76	10,394	資本財・サービス
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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
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	29,194.81	17,563	2,401,771	
	銘柄数<比率>	94銘柄		<5.7%>	
		百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)					
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 HAPOALIM 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・シュケル通貨計	株数、金額	440.26	1,554	46,819	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<0.1%>	
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
DUFRY 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
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

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スイス・フラン	千円	
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	1,719.75	12,413	1,350,216	
	銘柄数<比率>	39銘柄		<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	432.41	16,552	270,128	
	銘柄数<比率>	17銘柄		<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	595.95	8,344	104,217	
	銘柄数<比率>	10銘柄		<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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
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	2,547.11	35,223	403,308	
	銘柄数<比率>	32銘柄		<1.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（アイルランド）					
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	334.42	674	82,238	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<0.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オランダ）					
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

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
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	1,852.38	5,197	633,406	
	銘柄数<比率>	24銘柄		<1.5%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）					
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	194.5	1,168	142,398	
	銘柄数<比率>	10銘柄		<0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ルクセンブルグ）					
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
ARCELORMITTAL		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	256.56	355	43,284	
	銘柄数<比率>	6銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）					
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

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	
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
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

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
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	2,557.46	11,875	1,447,223	
	銘柄数<比率>	69銘柄		<3.4%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）					
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
BRENNTAG 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
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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
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 &		22.71	151	18,460	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		87.92	416	50,809	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		130.44	187	22,875	情報技術
HANNOVER RUECK SE		6.44	90	11,003	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		89.74	245	29,944	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		18.97	238	29,060	金融
LANXESS AG		6	27	3,341	素材
MTU AERO ENGINES AG		4.44	88	10,751	資本財・サービス
AXEL SPRINGER SE		4.7	29	3,562	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		32.85	121	14,812	不動産
SYMRISE AG		14.36	126	15,449	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		62.4	15	1,882	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		9	47	5,835	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD		8.11	44	5,406	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		46.37	213	26,023	不動産
国小計	株数、金額	2,353.54	10,166	1,239,014	
	銘柄数<比率>	61銘柄		<3.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）					
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	340.85	184	22,435	
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）					
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	5,074.78	3,582	436,600	
	銘柄数<比率>	22銘柄		<1.0%>	

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）					
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
SNAM SPA		243	114	13,972	エネルギー
TERNA SPA		199	114	13,983	公益事業
FINECOBANK SPA		59.72	54	6,583	金融
国小計	株数、金額	5,097.61	2,244	273,479	
	銘柄数＜比率＞	19銘柄		＜0.7%＞	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）					
UPM-KYMMENE OYJ		44.93	104	12,714	素材
NOKIA OYJ		544.37	238	29,097	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		41.16	52	6,448	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		41.93	39	4,812	素材
METSO OYJ		11.08	35	4,308	資本財・サービス
ELISA OYJ		13	54	6,669	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		38.32	155	18,955	金融
FORTUM OYJ		44	84	10,266	公益事業
KONE OYJ-B		38.6	193	23,567	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		17.7	47	5,731	一般消費財・サービス
NESTE OYJ		48.49	149	18,242	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		17.63	55	6,752	ヘルスケア
国小計	株数、金額	901.21	1,210	147,568	
	銘柄数＜比率＞	12銘柄		＜0.4%＞	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）					
VERBUND AG		2.4	11	1,341	公益事業
OMV AG		12.09	50	6,201	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		27.5	88	10,748	金融
VOESTALPINE AG		18	43	5,299	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		11	23	2,875	金融
ANDRITZ AG		5.5	17	2,099	資本財・サービス
国小計	株数、金額	76.49	234	28,565	
	銘柄数＜比率＞	6銘柄		＜0.1%＞	
ユーロ通貨計	株数、金額	19,039.8	36,893	4,496,214	
	銘柄数＜比率＞	239銘柄		＜10.7%＞	
ファンド合計	株数、金額	107,897.69	—	38,411,435	
	銘柄数＜比率＞	1,259銘柄		＜91.6%＞	

（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）＜　＞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
(アメリカ)				
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
WP CAREY INC		1.6	136	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	124.04	8,244	895,898
	銘柄数<比率>	40銘柄		<2.1%>
		千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
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	3.4	83	6,725
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>

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		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
LENDLEASE 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	口数、金額	210.449	1,557	116,358
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.3%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
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	口数、金額	110	3,132	43,445
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
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	口数、金額	93.5	221	17,525
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)				
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	口数、金額	38.161	260	35,662
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ(フランス)				
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	口数、金額	4.736	351	42,820
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.1%>
合計	口数、金額	584.286	—	1,158,437
	銘柄数<比率>	68銘柄		<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
		百万円	百万円
外国	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	—
	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）

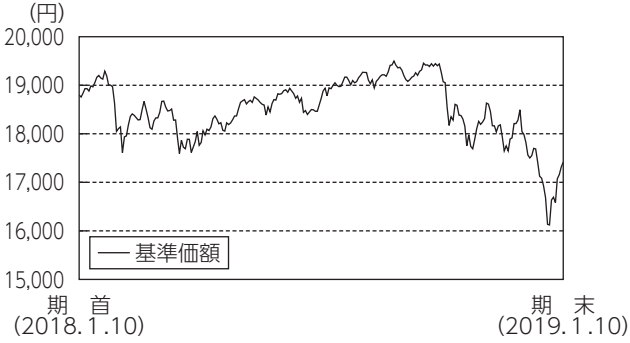
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★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。以下同じ。）
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



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース、指数化)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%
(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。

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。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。

■１万口当りの費用の明細

項　目	当　期
売買委託手数料	2円
(株式)	(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	3
(株式)	(3)
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	9
(保管費用)	(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		売	
		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 (2)	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・シュケル 356 (△ 131)	百株 －	千イスラエル・シュケル －
	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
外国	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で、上段の数字には含まれておりません。
(注３) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券

(2018年１月11日から2019年１月10日まで)

		買		売	
		口　数	金　額	口　数	金　額
外国	アメリカ	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) 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で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(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)

当期								
買付				売付				
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC（アメリカ）	10.792	210,868	19,539	SHIRE PLC（ジャージィー）	8.223	52,258	6,355
MICROSOFT CORP（アメリカ）	18.682	202,062	10,815	APPLE INC（アメリカ）	1.1	25,253	22,958
AMAZON.COM INC（アメリカ）	1.113	197,298	177,267	KEURIG DR PEPPER INC（アメリカ）	1.476	20,138	13,644
FACEBOOK INC-CLASS A（アメリカ）	6.646	123,757	18,621	RELX PLC（イギリス）	8.2	19,315	2,355
JOHNSON & JOHNSON（アメリカ）	6.895	100,938	14,639	LINDE PLC（アイルランド）	0.75	13,050	17,400
JPMORGAN CHASE & CO（アメリカ）	8.128	100,261	12,335	OLD MUTUAL PLC（イギリス）	41.479	12,644	304
ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	0.799	98,886	123,762	MICROSOFT CORP（アメリカ）	1	10,945	10,945
EXXON MOBIL CORP（アメリカ）	11.288	96,881	8,582	GKN PLC（イギリス）	15.154	10,601	699
ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	0.751	91,530	121,877	THOMSON REUTERS CORP（カナダ）	1.8	9,751	5,417
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B（アメリカ）	3.652	82,957	22,715	RANDGOLD RESOURCES LTD（ジャージィー）	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

■組入資産明細表
(1) 外国株式

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7.5	11	108	11,724	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	6	8	154	16,714	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	−	16.59	111	12,038	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	5.5	72	7,813	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	51	62	161	17,433	金融
ABBOTT LABORATORIES	117.2	168.44	1,169	126,544	ヘルスケア
ARCONIC INC	24	39.5	77	8,341	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	11.35	15.96	177	19,251	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	29	34	193	20,937	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	19.5	31.88	256	27,758	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	23.5	33.53	344	37,255	情報技術
QORVO INC	7	11.79	71	7,710	情報技術
AFLAC INC	30	70.68	319	34,563	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	8	12.48	130	14,159	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	10	10	52	5,705	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	33	46.22	1,088	117,727	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17.5	17.5	78	8,525	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	5.5	10.08	137	14,831	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	19	44.09	66	7,193	金融
GARMIN LTD	7.5	7.5	49	5,329	一般消費財・サービス
AETNA INC	21.94	−	−	−	その他
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14	19.42	304	32,942	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	51	70.31	954	103,240	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11.5	17.1	143	15,577	情報技術
WR BERKLEY CORP	6	6	43	4,686	金融
AUTOZONE INC	1.9	2.4	196	21,301	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	15.99	19.11	185	20,090	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56	96.83	173	18,814	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	9	9	76	8,243	公益事業
CELANESE CORP	9	12.97	121	13,195	素材
DR HORTON INC	23.5	33.06	130	14,156	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4.5	12.49	58	6,378	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	15.5	24.5	97	10,509	ヘルスケア
AUTODESK INC	12.5	19.13	261	28,306	情報技術
MOODY'S CORP	12.5	14.9	218	23,598	金融
DEVON ENERGY CORP	34	48.68	125	13,603	エネルギー
ALBEMARLE CORP	8	8	61	6,650	素材
ATMOS ENERGY CORP	6	10.5	95	10,303	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	13	22	91	9,922	公益事業
CITIGROUP INC	189.8	233.28	1,315	142,295	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	30.5	40.52	532	57,612	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	32.5	44.53	326	35,347	公益事業
ALLEGHANY CORP	0.8	1.38	85	9,242	金融
DOMINO'S PIZZA INC	3	3	73	8,003	一般消費財・サービス
HESS CORP	19.5	28.96	145	15,716	エネルギー
DAVITA INC	10	10	53	5,833	ヘルスケア
DANAHER CORP	41.3	61.31	639	69,223	ヘルスケア
FORTIVE CORP	19	30.44	210	22,799	資本財・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AVNET INC	11	−	−	−	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	41.25	53.14	384	41,647	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12	12	23	2,495	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	17.01	29	3,242	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	37.5	60.74	261	28,303	生活必需品
BUNGE LTD	9.5	9.5	54	5,863	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	24	32.46	250	27,065	情報技術
APPLE INC	355.5	452.42	6,936	750,411	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27	33.59	208	22,578	金融
BOEING CO/THE	39.3	50.77	1,745	188,859	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9.5	14.5	110	11,960	金融
BECTON DICKINSON AND CO	19.11	24.93	567	61,347	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	15	30	3,318	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	8.5	14	76	8,265	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	11	54	5,873	情報技術
NISOURCE INC	20	40.26	105	11,385	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10.5	10.5	88	9,624	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	72.5	95.84	457	49,522	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	283.44	390.73	2,229	241,167	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	86.2	122.72	2,409	260,721	金融
ANSYS INC	4.5	7.2	108	11,734	情報技術
H&R BLOCK INC	16	16	41	4,445	一般消費財・サービス
BB&T CORP	54	69.55	320	34,726	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	110	151.31	713	77,234	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	240	316.28	3,175	343,552	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	15.5	22.75	210	22,804	金融
CIGNA HOLDING CO	16.5	−	−	−	その他
LKQ CORP	20.5	33	85	9,204	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2	5.47	71	7,683	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14.5	26.52	123	13,327	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	17	26.5	116	12,571	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9.5	16.14	182	19,749	金融
DOLLAR GENERAL CORP	18.5	26.72	308	33,389	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	11.5	16.81	320	34,640	情報技術
CATERPILLAR INC	41	55.96	728	78,869	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	17	25	122	13,215	公益事業
MOSAIC CO/THE	30	30	94	10,175	素材
DELTA AIR LINES INC	10	16.5	79	8,652	資本財・サービス
CORNING INC	59	70.47	209	22,628	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	348.5	445.58	1,930	208,834	情報技術
MORGAN STANLEY	92.5	125.59	524	56,714	金融
WABCO HOLDINGS INC	3.2	3.2	35	3,798	資本財・サービス
MSCI INC	7.3	7.3	110	11,989	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	2.2	4.5	101	10,939	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	4	4	43	4,744	資本財・サービス
COTY INC-CL A	24.17	47.57	35	3,787	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10	17.34	82	8,877	情報技術
BROADCOM INC	27.24	41.33	1,017	110,123	情報技術

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3	3	34	3,684	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC	3.5	3.5	40	4,435	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7	7	59	6,420	ヘルスケア
ARAMARK	17	17	51	5,567	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14	14	34	3,783	素材
DTE ENERGY COMPANY	13.5	19.33	212	23,019	公益事業
CENTENE CORP	12	19.54	231	24,994	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6	9	83	9,036	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	30.5	40.5	131	14,209	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12	17.97	131	14,246	金融
GARTNER INC	5	8	101	10,987	情報技術
SPLUNK INC	11	17.12	198	21,468	情報技術
AGCO CORP	5	－	－	－	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	44.5	76.39	551	59,687	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	27.5	44.36	236	25,594	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	8	14	65	7,065	資本財・サービス
DEERE & CO	18.5	26.86	414	44,848	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	12	16.1	175	19,029	情報技術
TIME WARNER INC	51.66	－	－	－	その他
VMWARE INC-CLASS A	5	8.33	125	13,548	情報技術
CHEMOURS CO/THE	14	14	46	4,980	素材
BURLINGTON STORES INC	－	7	115	12,521	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	8.5	8.5	67	7,354	金融
VAIL RESORTS INC	2.4	3.9	84	9,091	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	8.5	14.61	69	7,471	金融
TARGA RESOURCES CORP	11	20.29	88	9,612	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4.5	4.5	64	6,962	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4.5	8.74	80	8,711	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	－	4.05	30	3,302	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	22.5	29.94	225	24,391	公益事業
COGNEX CORP	14	14	57	6,252	情報技術
WYNDHAM DESTINATIONS INC	7.5	－	－	－	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC	3	4.85	125	13,622	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5	8.06	78	8,455	資本財・サービス
WELLCARE HEALTH PLANS INC	－	5	122	13,207	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6.5	12.25	118	12,790	ヘルスケア
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	7	－	－	－	資本財・サービス
IDEX CORP	4.5	7	94	10,264	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	57.5	76.33	467	50,622	生活必需品
ROLLINS INC	7	10.5	39	4,317	資本財・サービス
AMETEK INC	14.75	19.82	137	14,881	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	14	21.55	141	15,345	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	10	29	3,200	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	－	10.6	65	7,114	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	24.5	28.2	248	26,881	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	30	40.83	857	92,721	生活必需品
SCANA CORP	7	－	－	－	その他
GRUBHUB INC	－	10	80	8,697	一般消費財・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4	8.78	90	9,831	金融
WR GRACE & CO	5.5	－	－	－	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1.4	2.4	119	12,943	一般消費財・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	28	28	51	5,607	金融
UGI CORP	10	20.85	112	12,185	公益事業
CUMMINS INC	11	13	178	19,334	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	48.5	65.65	333	36,102	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	16	16	35	3,868	情報技術
CDW CORP/DE	13	13	105	11,438	情報技術
SIGNATURE BANK	3.5	7.69	85	9,229	金融
COSTAR GROUP INC	2.5	3.82	134	14,603	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	3	6.88	144	15,687	金融
AMERCO	0.7	0.7	24	2,616	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4.4	4.4	56	6,100	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	2.8	3.83	130	14,086	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	29	29	40	4,336	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4.5	8.37	105	11,440	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15.33	23.13	164	17,777	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	10.5	22.45	41	4,461	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	2.5	2.5	31	3,415	情報技術
DEXCOM INC	－	9	124	13,510	ヘルスケア
COPART INC	－	17.78	89	9,675	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	6	15.91	169	18,381	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	10	10	69	7,506	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	5	8.62	172	18,681	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	3.5	5	173	18,743	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	25	25	64	6,943	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	146.96	171.69	296	32,060	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	22	26.89	344	37,325	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	29.5	46.08	109	11,890	エネルギー
T-MOBILE US INC	19.5	34.49	233	25,269	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	7	7	22	2,461	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	283	383.83	1,787	193,389	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16	16	74	8,061	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	12.5	19.46	133	14,457	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	6	12.5	45	4,965	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	22	22	66	7,216	金融
CSX CORP	64.5	80.73	516	55,881	資本財・サービス
FLUOR CORP	7	12.9	46	4,996	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7.5	10.5	136	14,732	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	8	11.5	131	14,260	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	5.5	8	61	6,672	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	28.2	38.83	6,443	697,125	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16	16	30	3,321	エネルギー
FLOWSERVE CORP	9	9	36	3,975	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13	19.45	300	32,479	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	294.26	399.14	2,890	312,730	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	8	16.13	71	7,727	情報技術
AES CORP	40	84.42	126	13,718	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	6.5	6.5	111	12,020	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	3.5	3.5	74	8,027	金融
EOG RESOURCES INC	39.5	57.49	570	61,694	エネルギー

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	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	
EQT CORP	19	–	–	–	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	12.5	12.5	79	8,555	情報技術
ABIOMED INC	–	3.55	119	12,920	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	10	13.6	103	11,229	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25	34.58	239	25,907	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	247.5	321.29	280	30,311	一般消費財・サービス
TESARO INC	2	–	–	–	ヘルスケア
MACY'S INC	22	22	69	7,549	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	11	11	30	3,246	コミュニケーション・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12.16	24.16	50	5,465	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	12.5	21.49	54	5,886	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	8.5	18.24	80	8,704	資本財・サービス
FORTINET INC	10.5	10.5	76	8,301	情報技術
MARKEL CORP	1.1	1.1	114	12,369	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	8	8	19	2,082	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	33.3	43.99	760	82,235	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	94.5	114.5	131	14,258	素材
US BANCORP	112	142.81	677	73,251	金融
UNITED RENTALS INC	6	11.15	132	14,291	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	5.5	5.5	91	9,880	情報技術
FASTENAL CO	20.5	29.07	156	16,948	資本財・サービス
FISERV INC	15	35	256	27,763	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	607.5	856.82	728	78,794	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	–	14.01	57	6,241	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	12.5	21.49	98	10,634	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	22.5	22.5	48	5,245	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	89	122.63	431	46,674	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	7	7	40	4,380	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	17.5	23.16	372	40,316	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26.1	33.29	587	63,558	金融
ALPHABET INC-CL A	20.7	28.21	3,051	330,123	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	21.71	29.7	3,191	345,314	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	8	8	37	4,007	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	37.5	55.56	224	24,296	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	30.17	44.88	170	18,426	公益事業
GENUINE PARTS CO	12	12	115	12,490	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	26.05	33.55	166	18,007	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	45.5	58.5	146	15,854	金融
HARRIS CORP	7.5	9.82	130	14,168	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	9.5	31	3,434	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	59.5	78.26	234	25,400	エネルギー
HOME DEPOT INC	82	106.05	1,906	206,214	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	2.5	2.86	26	2,830	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	76.5	107.45	135	14,705	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3.5	3.5	67	7,281	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	9.5	13.58	143	15,528	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	14	14	51	5,525	一般消費財・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HUMANA INC	9.5	12.88	355	38,495	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	20.5	34.19	273	29,569	情報技術
HELMERICH & PAYNE	6	13.36	71	7,734	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	11	18.69	142	15,446	ヘルスケア
HP INC	107.5	141.5	300	32,470	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102.5	132.5	186	20,155	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	11	41	4,531	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	11	17.83	94	10,214	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13.5	13.5	43	4,684	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	8.5	8.5	32	3,479	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8	36	96	10,426	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	40	59.73	269	29,163	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	60	84.62	1,021	110,492	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	30.5	40.47	172	18,700	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	9	15	63	6,841	資本財・サービス
ZOETIS INC	36.5	46.63	402	43,502	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	16.65	25.48	240	26,023	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	17.5	17.5	113	12,319	エネルギー
ALLEGION PLC	5.5	11.1	91	9,889	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	6.5	15.72	59	6,445	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	35.86	51.08	103	11,240	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	20	26.65	202	21,956	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	28.5	28.5	80	8,679	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	9	9	89	9,705	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	183.14	252.09	3,250	351,638	ヘルスケア
ABBVIE INC	111.66	140.59	1,234	133,562	ヘルスケア
HOLOGIC INC	18	30.42	128	13,849	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	23	31.41	358	38,743	生活必需品
KROGER CO	56	71.6	200	21,728	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	11	15.2	142	15,372	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	17.9	25.15	680	73,613	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7.3	7.3	138	14,971	情報技術
L BRANDS INC	19.5	19.5	55	5,955	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	58	76.06	738	79,845	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	71	92.84	1,088	117,729	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	10.5	14.77	212	23,010	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	10	–	–	–	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	3	3	39	4,287	不動産
LOEWS CORP	18	25.5	117	12,704	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	13	18	98	10,611	金融
MCDONALD'S CORP	57	72.43	1,305	141,278	一般消費財・サービス
3M CO	42	55.13	1,060	114,697	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	164.5	226.96	3,273	354,153	コミュニケーション・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	12.17	–	–	–	情報技術
MANPOWERGROUP INC	3.5	6.5	46	4,990	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	16.9	23.87	414	44,847	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3.5	5.4	96	10,476	素材
CONCHO RESOURCES INC	9.5	18	221	23,941	エネルギー

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	
ENVISION HEALTHCARE CORP	5.33	–	–	–	その他
FIRST DATA CORP- CLASS A	38.5	58.32	103	11,199	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8	19	47	5,176	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	29.97	38.47	353	38,286	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	29	45.61	104	11,309	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28	56.59	156	16,904	一般消費財・サービス
MATTEL INC	14	36	41	4,529	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	20.38	24.29	143	15,554	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7	10.29	144	15,618	生活必需品
MYLAN NV	36.5	48.88	141	15,304	ヘルスケア
METLIFE INC	59	75.19	327	35,386	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22	61.24	104	11,323	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	2.5	4.23	91	9,928	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	5	13.49	56	6,121	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10.85	14.35	166	18,034	情報技術
MONSANTO CO	30.5	–	–	–	その他
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1.5	2.1	119	12,915	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	23.31	37.84	87	9,485	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	9	11	169	18,360	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	5.36	19.64	65	7,097	金融
MERCK & CO. INC.	190.37	248.03	1,870	202,357	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	163.3	215.58	1,199	129,725	素材
MASCO CORP	22	35.43	115	12,549	資本財・サービス
M & T BANK CORP	10.32	13.23	201	21,806	金融
MARSH & MCLENNAN COS	35	45.04	364	39,416	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	21.95	27.83	303	32,879	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	8	12	199	21,574	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	–	6	58	6,382	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	19	27.91	184	19,908	情報技術
TRANSUNION	12	20.29	113	12,251	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	–	25	58	6,304	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	11	11	46	4,982	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	13.6	28.76	230	24,960	情報技術
BEIGENE LTD-ADR	–	3.5	49	5,405	ヘルスケア
NETAPP INC	16	23	138	14,977	情報技術
NIKE INC -CL B	89	124.89	956	103,487	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	19	25.53	405	43,920	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	16.5	20.5	155	16,822	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10.5	10.5	80	8,714	金融
ALLY FINANCIAL INC	33	33	79	8,650	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	12	14.4	363	39,283	資本財・サービス
APTIV PLC	21	26.8	186	20,163	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	31.5	41.5	142	15,431	素材
MCKESSON CORP	15	17.69	209	22,633	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18	23.87	122	13,214	情報技術
XYLEM INC	13	19.72	133	14,433	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	109	146.09	992	107,334	生活必需品
NUCOR CORP	21.5	27	150	16,334	素材
WESTERN UNION CO	36	36	62	6,745	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	–	13	82	8,931	情報技術
NEWELL BRANDS INC	27.58	40.58	80	8,662	一般消費財・サービス
EVERGY INC	–	24	134	14,556	公益事業

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	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	50.5	67.97	447	48,372	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	8	8	61	6,628	コミュニケーション・サービス
SPECTRUM BRANDS LEGACY INC	2	–	–	–	生活必需品
LINDE PLC	–	47.33	749	81,141	素材
WIX.COM LTD	–	5	49	5,302	情報技術
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	–	34.52	61	6,659	金融
PAYCHEX INC	21.5	26.75	177	19,190	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5.5	7	240	26,017	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	135	174.46	866	93,732	生活必需品
P G & E CORP	33	44.79	79	8,640	公益事業
PFIZER INC	413.58	555.06	2,405	260,265	ヘルスケア
ALKERMES PLC	10.5	10.5	33	3,659	ヘルスケア
CIGNA CORP	–	37.26	709	76,733	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	–	11.12	52	5,647	情報技術
XCEL ENERGY INC	31.5	53.81	260	28,211	公益事業
STRYKER CORP	23.5	31.26	499	54,044	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	9.7	12.39	193	20,944	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11.5	16.5	240	26,029	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	4	4	33	3,628	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	173.2	235.8	2,144	232,024	生活必需品
EXELON CORP	68.54	90.42	407	44,040	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	14	22.07	242	26,255	ヘルスケア
NVR INC	0.2	0.3	75	8,216	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	82.5	106.05	704	76,241	エネルギー
PEPSICO INC	99.85	133.93	1,439	155,751	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29	42.88	372	40,305	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13.5	20.92	186	20,141	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	42	62.13	906	98,051	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6	–	–	–	金融
PENTAIR PLC	10.25	15.75	63	6,856	資本財・サービス
QUALCOMM INC	99.5	137.16	776	84,005	情報技術
INVESCO LTD	25.5	37	64	6,933	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	5	8.19	134	14,569	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18	23	104	11,346	金融
RAYTHEON COMPANY	19.5	25.67	405	43,860	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4.5	–	–	–	その他
RED HAT INC	12.8	15.3	266	28,818	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	5	7.45	297	32,206	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	15	20.5	151	16,392	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	3.4	4.5	742	80,306	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	26	36.18	326	35,361	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	5.5	8.44	73	7,964	素材
RESMED INC	9.5	13.83	158	17,139	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	8.5	12	101	10,962	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	8	8	46	5,048	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	4	4	43	4,736	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	6.5	–	–	–	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	10.51	–	–	–	その他
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	92.5	135	14,711	金融
CHEVRON CORP	129.5	180.78	2,047	221,540	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	23.5	31.03	181	19,605	公益事業
TESLA INC	9.3	11.94	404	43,730	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首	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	
SYMANTEC CORP	39.5	54	107	11,643	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	10.02	15.81	207	22,415	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	11	11	95	10,349	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13.23	16.05	477	51,683	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	20	28	116	12,605	不動産
TWITTER INC	38	57	183	19,888	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	69	89.27	406	43,934	公益事業
SYSCO CORP	37	43.92	274	29,688	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	19	24.82	294	31,868	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	10	46	5,080	金融
STERICYCLE INC	5	–	–	–	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	13	23	76	8,236	素材
SCHLUMBERGER LTD	93.93	135.88	560	60,626	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10.5	20.26	90	9,841	資本財・サービス
AT&T INC	419.7	685.37	2,062	223,192	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	9	17.58	86	9,334	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	–	36.27	64	6,988	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5.4	7.61	302	32,779	素材
SEMPRA ENERGY	17	27.68	311	33,666	公益事業
TIFFANY & CO	7.5	10.86	93	10,160	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	17	23.49	94	10,201	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	66.5	90.23	868	93,949	情報技術
SALESFORCE.COM INC	46	69.51	1,014	109,788	情報技術
WESTROCK CO	17.12	23.21	90	9,793	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	60.53	83.88	268	29,012	資本財・サービス
ANDEAVOR	10.5	–	–	–	その他
UNION PACIFIC CORP	56.5	69.85	1,050	113,628	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	61	102.44	164	17,810	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	35.5	60.83	390	42,264	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	52.5	78.79	861	93,187	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	49	64.48	631	68,309	資本財・サービス
UNUM GROUP	12	19	61	6,639	金融
SPRINT CORP	41.14	41.14	25	2,786	コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	10	10	10	1,137	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	9.53	14.32	174	18,926	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	11	18	75	8,196	金融
AMEREN CORPORATION	18.5	28.61	184	19,927	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	66.1	90.73	2,210	239,158	ヘルスケア
VERISIGN INC	7.5	10.85	168	18,269	情報技術
VALERO ENERGY CORP	30	38.82	300	32,461	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	3.3	4.8	134	14,602	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17.5	30.08	99	10,716	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6	9.92	123	13,341	ヘルスケア
ANTHEM INC	18	23.46	589	63,796	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	105	140.83	1,586	171,668	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	321.87	432.75	2,068	223,795	金融
WASTE MANAGEMENT INC	32	42.25	388	41,994	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	60	107.9	271	29,359	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10.5	10.5	88	9,612	一般消費財・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WHIRLPOOL CORP	5	5	60	6,572	一般消費財・サービス
WALMART INC	102	141.09	1,338	144,845	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	9	68	7,438	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15.5	19.56	200	21,669	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	5	11.45	130	14,167	一般消費財・サービス
XEROX CORP	9.39	19.88	43	4,708	情報技術
WABTEC CORP	5	6.44	46	5,037	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	45.5	112.06	529	57,309	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.5	6.5	126	13,708	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3.5	3.5	29	3,171	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	24.49	31.29	452	48,950	ヘルスケア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	61	80.64	582	63,016	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8.13	15.36	232	25,202	金融
WESTERN DIGITAL CORP	21.45	25.45	101	10,955	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	22	28.69	195	21,181	公益事業
WESTAR ENERGY INC	9	–	–	–	その他
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	35	42.5	217	23,583	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	127.5	168.27	2,329	251,977	情報技術
PPL CORP	46	59	172	18,696	公益事業
PULTEGROUP INC	19	19	55	5,950	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	17.1	20.12	204	22,094	素材
NORTHERN TRUST CORP	16	20.62	175	18,982	金融
NVIDIA CORP	42.5	55.71	794	85,936	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	6	8.59	159	17,221	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33.03	41.75	504	54,569	金融
QURATE RETAIL INC	29	42.88	88	9,626	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12	12	45	4,952	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	19.5	24.5	138	14,989	生活必需品
NETFLIX INC	30	39.86	1,275	137,981	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	27.5	38.51	910	98,489	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	–	30	118	12,836	公益事業
TORCHMARK CORP	6.5	12.15	96	10,477	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9	13	113	12,271	金融
TEXTRON INC	16	22.1	104	11,304	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	78.5	103.5	504	54,622	コミュニケーション・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	32	45.91	222	24,075	コミュニケーション・サービス
NEWS CORP - CLASS A	29	29	35	3,830	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	12	12	47	5,124	公益事業
OMNICOM GROUP	18.5	18.5	139	15,119	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	217	275.01	1,313	142,161	情報技術
MASTERCARD INC - A	63.5	84.98	1,663	179,990	情報技術
ONEOK INC	22.5	37.36	223	24,142	エネルギー
CENTURYLINK INC	54.39	97.47	157	17,051	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	7.5	9	244	26,450	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	21	32.71	298	32,253	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8	11.91	127	13,846	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	4	67	7,274	情報技術

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MOLSON COORS BREWING CO -B	12.5	17.75	108	11,714	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	37.5	37.5	83	9,018	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	682.63	880.46	2,268	245,381	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11	14.97	136	14,715	ヘルスケア
NORDSTROM INC	8	8	39	4,266	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	52.5	65.84	650	70,398	金融
ANALOG DEVICES INC	23.44	33.36	291	31,544	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	58	95.45	192	20,849	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17.08	23.94	124	13,463	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	61.7	84.69	348	37,713	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	43	51.05	244	26,461	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	12	15.69	106	11,490	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11	17.84	186	20,142	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	12	–	–	–	エネルギー
AVERY DENNISON CORP	6.5	6.5	59	6,450	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	38	53.53	343	37,215	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	44.5	56.56	347	37,572	資本財・サービス
AON PLC	17	22.96	333	36,050	金融
AMGEN INC	49	60.83	1,218	131,867	ヘルスケア
TAPESTRY INC	18	25.5	94	10,207	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	30.62	41.02	283	30,648	資本財・サービス
CELGENE CORP	52.5	70.24	614	66,501	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11.5	15.06	227	24,593	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	77.1	91.64	314	34,006	情報技術
CIT GROUP INC	9	9	37	4,092	金融
CIMAREX ENERGY CO	8	8	54	5,946	エネルギー
CME GROUP INC	23	35.41	632	68,406	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	21.89	33.89	96	10,402	エネルギー
ECOLAB INC	17	23.64	351	38,034	素材
EQUIFAX INC	8.5	12.56	120	13,045	資本財・サービス
GAP INC/THE	13	28.2	73	7,950	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	90	117.75	799	86,551	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	10.76	–	–	–	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	22	22	93	10,151	生活必需品
STATE STREET CORP	26.5	39.48	263	28,524	金融
SUNTRUST BANKS INC	34	46.15	255	27,691	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	81	115.1	504	54,580	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	33.5	45.41	304	32,975	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	13	13	44	4,807	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	8	8	36	3,904	素材
CARDINAL HEALTH INC	24.5	24.5	114	12,346	ヘルスケア
FEDEX CORP	18	22.83	389	42,135	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33	45.69	368	39,827	金融
FMC CORP	7.5	11.42	90	9,813	素材
FLEX LTD	45	45	36	3,904	情報技術
CERNER CORP	18.5	23.68	126	13,688	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6.5	7.54	102	11,141	素材
CITRIX SYSTEMS INC	9.5	13.5	141	15,309	情報技術
INTEL CORP	322.5	427.71	2,053	222,161	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28	28	62	6,722	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28.5	28.5	124	13,496	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	22.5	28.56	371	40,165	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	80	153	92	10,031	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	11.1	13.07	398	43,162	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	14.5	51	5,532	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	7.5	10.28	531	57,512	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8.5	12.36	132	14,375	情報技術
SNAP-ON INC	3	5	78	8,534	資本財・サービス
CARMAX INC	12	19.9	130	14,132	一般消費財・サービス
COMERICA INC	11	14.76	108	11,692	金融
INGREDION INC	5.3	5.3	50	5,487	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	48.38	69.64	590	63,898	公益事業
TARGET CORP	37	49.32	346	37,506	一般消費財・サービス
DOVER CORP	12	12	91	9,912	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	4	4	112	12,117	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6	11.16	67	7,262	資本財・サービス
CINTAS CORP	5.5	7.63	134	14,549	資本財・サービス
CA INC	22	–	–	–	その他
CONAGRA BRANDS INC	25	55.67	119	12,877	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	–	15	104	11,314	生活必需品
CLOROX COMPANY	9	12.78	192	20,869	生活必需品
ENTERGY CORP	11	16	136	14,791	公益事業
MICROSOFT CORP	506.5	683.32	7,124	770,851	情報技術
INCYTE CORP	10.5	14.47	106	11,537	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	69.5	121.21	800	86,602	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	92.56	128.89	1,086	117,553	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	77.5	113.72	403	43,603	情報技術
BLACKROCK INC	8.1	10.57	423	45,764	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	29	56.36	163	17,670	公益事業
HASBRO INC	6	10	85	9,214	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	18.5	26.2	151	16,426	生活必需品
KEYCORP	71	87.73	139	15,044	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	7.5	7.5	75	8,219	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	103	133.02	557	60,343	生活必需品
KOHLS CORP	8.5	16.5	115	12,478	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	3.5	5.97	154	16,680	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	23	–	–	–	金融
APACHE CORP	25	36.73	113	12,263	エネルギー
CHUBB LTD	33.6	42.88	548	59,363	金融
ARROW ELECTRONICS INC	4.5	10	70	7,672	情報技術
ALLSTATE CORP	25	34.1	283	30,680	金融
EBAY INC	66.5	90.53	274	29,667	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	81.5	102.54	918	99,345	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	9	12.83	97	10,597	素材
XILINX INC	16.5	22	195	21,145	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	37.85	–	–	–	その他
DISH NETWORK CORP-A	15	15	42	4,586	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	12	19	82	8,952	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14.5	20.44	261	28,268	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	12	–	–	–	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	22	22	75	8,173	情報技術
LENNAR CORP-A	14	33.94	157	16,997	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LEAR CORP	4	6	86	9,352	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	23	23	109	11,812	金融
PROGRESSIVE CORP	43.5	50.67	310	33,604	金融
PRAXAIR INC	20.5	–	–	–	その他
PACCAR INC	23	35.25	206	22,359	資本財・サービス
PVH CORP	5.5	5.5	56	6,105	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	14.5	18.99	620	67,107	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	5.5	7.42	142	15,430	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	103.5	124.84	797	86,279	一般消費財・サービス
PTC INC	–	12	102	11,127	情報技術
PERRIGO CO PLC	9	9	39	4,303	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	24	34.23	221	23,979	公益事業
INTUIT INC	16	24.25	491	53,170	情報技術
BORGWARNER INC	15.5	15.5	59	6,489	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	17	23	133	14,390	一般消費財・サービス
BALL CORP	18.92	28.92	136	14,733	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	102.5	131.42	471	51,015	ヘルスケア
XL GROUP LTD	18.5	–	–	–	その他
ELECTRONIC ARTS INC	22.5	30.24	268	29,088	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	10.5	10.5	108	11,748	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17.7	23.03	419	45,422	ヘルスケア
VF CORP	21	32.04	239	25,918	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	22	28.41	135	14,692	コミュニケーション・サービス
VIACOM INC-CLASS B	20	30.71	89	9,635	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	4.8	4.8	61	6,616	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6	10.03	123	13,383	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	24.5	38.14	198	21,452	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	318	436.24	1,573	170,191	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	11	21	79	8,594	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	15	22	152	16,463	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	–	56	52	5,640	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	110	110	74	8,033	不動産
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	20,843.96	28,351.43	207,988	22,502,326	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	600銘柄	594銘柄		<60.9%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	23	23	81	6,640	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1.5	1.5	137	11,248	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9.38	24.38	44	3,622	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	14.21	21.21	153	12,557	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	22	42	108	8,849	素材
INTACT FINANCIAL CORP	10	10	100	8,222	金融
BCE INC	9	9	48	4,002	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	11	16	147	12,080	素材
SUNCOR ENERGY INC	118.12	152.12	616	50,489	エネルギー
METRO INC	16	16	76	6,219	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	23	33	193	15,848	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	82	119	838	68,622	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29	38	399	32,699	金融
TORONTO-DOMINION BANK	126	166	1,131	92,559	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	17	17	48	3,957	金融
ROYAL BANK OF CANADA	98	135	1,292	105,764	金融
TOURMALINE OIL CORP	13	13	23	1,900	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	4	14	42	3,491	エネルギー
TRANSCANADA CORP	57	76	401	32,861	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	37.71	55.71	244	19,990	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	192	192	43	3,582	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	83	136	223	18,284	素材
CAE INC	23	23	60	4,929	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	20.2	18.33	116	9,569	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	18	53	4,402	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	6	42	3,456	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	10	53	4,365	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	19	–	–	–	金融
LINAMAR CORP	6	–	–	–	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	11	11	12	1,045	エネルギー
HYDRO ONE LTD	15	15	30	2,532	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	14.89	14.89	93	7,612	生活必需品
WSP GLOBAL INC	–	12	74	6,123	資本財・サービス
EMERA INC	–	12	52	4,335	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	10	32	2,634	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22	30	213	17,471	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	18	18	96	7,875	素材
STARS GROUP INC/THE	–	35	87	7,177	一般消費財・サービス
KINROSS GOLD CORP	105.34	105.34	44	3,654	素材
BANK OF MONTREAL	46	58	532	43,612	金融
POWER CORP OF CANADA	31	31	78	6,425	金融
METHANEX CORP	6	6	44	3,629	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	5	8	157	12,854	情報技術
NUTRIEN LTD	43.27	51.27	334	27,375	素材
AURORA CANNABIS INC	–	70	50	4,107	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	–	20	89	7,282	ヘルスケア
CAMECO CORP	28	28	45	3,700	エネルギー
TELUS CORP	3	3	13	1,108	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	20	20	52	4,320	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	44	132	10,877	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5	5	74	6,078	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80	80	16	1,368	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	78	117	410	33,595	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2	3	180	14,729	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	24	31	200	16,445	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	2	9.01	83	6,799	生活必需品
BLACKBERRY LTD	27	64	63	5,163	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	42	52	240	19,714	金融
ENBRIDGE INC	115	173	790	64,695	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	55	78	420	34,390	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	138	202	416	34,117	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	20	20	61	5,045	ヘルスケア
GOLDCORP INC	63	63	81	6,640	素材
ENCANA CORP	69	69	58	4,827	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10	12	302	24,744	資本財・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IA FINANCIAL CORP INC	11	11	52	4,316	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	14	14	59	4,844	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	53	64	671	54,974	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	13	28	238	19,530	情報技術
HUSKY ENERGY INC	30.12	30.12	46	3,768	エネルギー
ONEX CORPORATION	7	7	51	4,222	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	39	39	100	8,256	コミュニケーション・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	7	25	62	5,151	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	9	19	90	7,383	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	3	9	800	金融
OPEN TEXT CORP	14	27	121	9,982	情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	20	36	2,980	金融
SAPUTO INC	13	13	51	4,240	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	63	71	5,815	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	30	45	317	25,990	生活必需品
FORTIS INC	30	42	188	15,448	公益事業
LUNDIN MINING CORP	66	66	39	3,235	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP	25	–	–	–	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	80	80	85	7,017	エネルギー
DOLLARAMA INC	9	27	94	7,706	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	8	31	2,562	公益事業
ALTAGAS LTD	8	8	10	898	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	20	20	39	3,197	不動産
KEYERA CORP	7	22	60	4,950	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	20	48	100	8,224	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	28	28	25	2,085	エネルギー
カナダ・ドル通貨計 株数、金額	2,877.74	3,722.88	15,054	1,231,917	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	86銘柄	88銘柄		< 3.3%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	160	–	–	–	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	228.24	58	4,569	金融
BHP GROUP LTD	219.58	278.32	954	74,079	素材
SOUTH32 LTD	362.13	563.87	191	14,877	素材
ALUMINA LTD	121	121	28	2,178	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57.74	77.28	256	19,879	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	105	105	48	3,788	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	36	36	38	3,025	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	172.43	268.99	660	51,286	金融
WESTPAC BANKING CORP	230.26	330.42	851	66,050	金融
SANTOS LTD	96	182.7	106	8,237	エネルギー
AUSNET SERVICES	–	285	45	3,505	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	190.88	278.74	702	54,486	金融
RIO TINTO LTD	31.47	33.49	267	20,795	素材
ORIGIN ENERGY LTD	120.5	120.5	83	6,489	エネルギー
AMCOR LIMITED	74.96	109.96	145	11,306	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	153.1	153.1	66	5,191	資本財・サービス
COLES GROUP LTD	–	95.67	113	8,797	生活必需品
OIL SEARCH LTD	84	154.18	115	8,997	エネルギー
SEEK LTD	26	26	45	3,492	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	55.92	55.92	83	6,491	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	58.04	58.04	136	10,579	素材
INCITEC PIVOT LTD	73	204	70	5,461	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	116.77	166.92	1,207	93,688	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	20	20	52	4,087	エネルギー
ORICA LTD	20	20	34	2,698	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	88	98.22	103	8,018	金融
CIMIC GROUP LTD	10	10	44	3,458	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	95.16	117.6	350	27,194	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	26	21	1,682	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	88	173.52	78	6,072	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	30	36	2,800	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	351.14	102	7,929	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	165.13	249.35	63	4,953	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	32	32	48	3,774	素材
MACQUARIE GROUP LTD	21.13	33.47	381	29,603	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	40.35	61.63	143	11,124	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	30	30	30	2,369	金融
CSL LTD	31.02	40.37	787	61,119	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	69.85	95.67	306	23,771	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	4.44	4.44	81	6,314	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	32.12	70.92	87	6,813	素材
SUNCORP GROUP LTD	99.38	149.38	183	14,246	金融
BORAL LTD	86	86	43	3,396	素材
ASX LTD	13	13	80	6,240	金融
COMPUTERSHARE LTD	37	37	64	5,021	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	175.18	270.97	187	14,571	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	25	25	54	4,258	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	25	63	59	4,619	金融
WORLEYPARSONS LTD	–	71.26	95	7,437	エネルギー
AGL ENERGY LTD	40.5	47.39	98	7,678	公益事業
BRAMBLES LTD	113.37	183.37	191	14,841	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	–	8	35	2,717	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9	9	52	4,064	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	6.08	45	3,545	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	6.21	6.21	26	2,022	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	4,563.08	6,373.33	10,253	795,707	
オーストラリア・ドル通貨計 銘柄数<比率>	52銘柄	55銘柄		< 2.2%>	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	90	145	805	11,115	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	170	220	1,095	15,119	一般消費財・サービス
MTR CORP	75	165	689	9,517	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	90	160	1,920	26,496	不動産
SINO LAND CO	340	340	501	6,916	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	195.52	270.52	2,096	28,932	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	80	80	178	2,467	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	35	35	301	4,153	不動産
CLP HOLDINGS LTD	100	190	1,718	23,715	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	95.59	105.14	441	6,093	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	80	80	165	2,279	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	510.96	1,073.05	1,785	24,640	公益事業
HANG SENG BANK LTD	47	64	1,117	15,420	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港ドル	千円	
WHEELOCK & CO LTD	60	60	284	3,920	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	320	580	651	8,996	不動産
WH GROUP LTD	585	915	593	8,194	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	80	119	2,806	38,723	金融
MINTH GROUP LTD	60	60	152	2,098	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD	700	–	–	–	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	120	186	2,576	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	20	146	2,014	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	80	80	203	2,804	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	150	150	244	3,378	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	75	75	212	2,934	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	86	86	214	2,955	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	60	60	232	3,208	不動産
SJM HOLDINGS LTD	100	100	71	981	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	216	2,991	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	185.52	230.52	1,466	20,232	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	55	332	4,591	公益事業
PCCW LTD	600	600	280	3,875	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	876	1,236	8,145	112,404	金融
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	320	–	–	–	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	140	674	9,302	不動産
SANDS CHINA LTD	166	230	813	11,220	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	40	40	43	596	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	120	120	531	7,336	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	140	140	181	2,503	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	290	390	1,138	15,715	金融
WYNN MACAU LTD	60	168	281	3,890	一般消費財・サービス
香港ドル通貨計 株数、金額	7,477.59	8,782.23	32,921	454,316	
香港ドル通貨計 銘柄数<比率>	40銘柄	38銘柄		< 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	90	133	339	27,171	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	128	171	414	33,143	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	20	71	67	5,398	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	93	173	106	8,548	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	52	52	33	2,661	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	10	52	44	3,559	不動産
CAPITALAND LTD	190	190	60	4,846	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	270	270	34	2,785	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	120	29	2,350	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	9	32	2,610	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	218	348	404	32,306	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	450	46	3,706	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	–	32	47	3,817	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	484	924	274	21,943	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	141	50	4,013	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	40	40	10	844	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	90	90	2	179	生活必需品
SATS LTD	77	77	37	3,016	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	69	69	50	4,044	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	100	21	1,735	資本財・サービス
STARHUB LTD	120	–	–	–	コミュニケーション・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	158	50	4,030	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	190	–	–	–	その他
シンガポール・ドル通貨計 株数、金額	3,119	3,670	2,159	172,713	
シンガポール・ドル通貨計 銘柄数<比率>	22銘柄	21銘柄		< 0.5%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	53	3,955	公益事業
A2 MILK CO LTD	–	70	80	5,902	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	168.6	69	5,139	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	81	59	4,337	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	19	145.26	72	5,313	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	–	37	49	3,663	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	44.19	50	3,683	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計 株数、金額	462.79	696.05	435	31,994	
ニュージーランド・ドル通貨計 銘柄数<比率>	5銘柄	7銘柄		< 0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	50	50	17	2,384	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	26	48.02	57	8,025	一般消費財・サービス
BP PLC	1,328.11	1,812.02	947	131,144	エネルギー
UNILEVER PLC	87.04	111.99	458	63,490	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,202.18	1,505.91	236	32,686	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	107.7	140.34	121	16,798	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	105	105	29	4,035	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	5	–	–	–	その他
PRUDENTIAL PLC	172.78	259.64	371	51,371	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	236.79	508.36	112	15,542	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	10.3	17.58	51	7,185	素材
BAE SYSTEMS PLC	243	293.37	142	19,766	資本財・サービス
AVIVA PLC	273.06	327.89	128	17,812	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	349.92	455.6	700	96,922	ヘルスケア
INFORMA PLC	–	110	71	9,923	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	31.33	31.33	46	6,500	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	–	400	70	9,785	資本財・サービス
WORLDPAY GROUP PLC	135.17	–	–	–	その他
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	29	–	–	–	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	42	133.52	60	8,319	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	5	9.38	60	8,341	資本財・サービス
GVC HOLDINGS PLC	–	41.61	30	4,233	一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	65.81	65.81	9	1,296	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	100.76	100.76	28	3,987	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC	–	9.75	29	4,024	ヘルスケア
RELX PLC	66	178.81	292	40,427	資本財・サービス
DIAGEO PLC	172.54	228.95	624	86,495	生活必需品
RIO TINTO PLC	80.59	105.82	413	57,202	素材
STANDARD CHARTERED PLC	220.5	297.45	182	25,323	金融
TESCO PLC	591.54	887.48	187	26,016	生活必需品
FRESNILLO PLC	24	24	22	3,060	素材
SMITH & NEPHEW PLC	59.67	83.29	118	16,427	ヘルスケア

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
GLENCORE PLC	805.44	1,067.03	312	43,294	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	54.66	54.66	32	4,484	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15	32	60	8,346	金融
SMITHS GROUP PLC	22.6	40.8	58	8,061	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	6	6	3	434	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109.63	109.63	35	4,955	金融
PEARSON PLC	43	82.71	84	11,682	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	68.5	176.31	48	6,652	生活必需品
NEXT PLC	11.59	11.59	56	7,785	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	170	322.36	48	6,652	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	9.5	17.85	88	12,254	一般消費財・サービス
IMI PLC	24.1	–	–	–	資本財・サービス
BUNZL PLC	19	31.59	76	10,589	資本財・サービス
GKN PLC	92	–	–	–	その他
VODAFONE GROUP PLC	1,831.14	2,477.53	378	52,397	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	8.03	8.03	39	5,437	素材
KINGFISHER PLC	172.29	172.29	39	5,499	一般消費財・サービス
WPP PLC	99.21	130.21	114	15,877	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	36.9	82.44	62	8,637	公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	13	23	3,307	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	48.18	66.64	403	55,839	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	27	48.83	48	6,658	金融
SCHRODERS PLC	5.5	12.27	32	4,500	金融
SSE PLC	61.06	82.82	93	12,884	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	13	39.42	56	7,843	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	59	123.68	61	8,470	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	86.08	121.53	718	99,411	ヘルスケア
FERGUSON PLC	16	19.89	104	14,422	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	399.29	496.81	119	16,544	金融
3I GROUP PLC	57.37	84.39	68	9,519	金融
SKY PLC	63	–	–	–	コミュニケーション・サービス
ASHTEAD GROUP PLC	39	39	72	10,094	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	58.79	97.25	59	8,194	情報技術
NATIONAL GRID PLC	228.11	303.25	239	33,150	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,124.1	6,763.72	363	50,375	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	63.8	125.86	65	9,107	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	61.07	82.23	197	27,395	生活必需品
CENTRICA PLC	380.02	680.02	88	12,301	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7	7	26	3,619	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	160.83	223.21	557	77,143	生活必需品
BHP GROUP PLC	135.12	213.17	363	50,376	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29.6	29.6	67	9,291	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	1,400.19	1,828.42	1,181	163,509	金融
SHIRE PLC	64.38	–	–	–	その他
OLD MUTUAL PLC	307.12	–	–	–	その他
ANGLO AMERICAN PLC	91.68	107.45	194	26,862	素材
MONDI PLC	34	34	59	8,216	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	145	145	31	4,345	生活必需品
CARNIVAL PLC	13.83	13.83	55	7,742	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	16.44	16.44	18	2,615	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	105.61	142.39	235	32,607	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	25.69	25.69	54	7,488	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	557.73	856.24	199	27,554	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	12	12	29	4,087	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	33	33	59	8,175	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	13.72	13.72	58	8,148	一般消費財・サービス
CAPITA PLC	49	–	–	–	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	17	–	–	–	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	10	15.92	78	10,916	資本財・サービス
ITV PLC	275.87	275.87	38	5,263	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20.35	27.35	114	15,891	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	313.55	437.7	1,039	143,912	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	254.47	340.53	815	112,882	エネルギー
MEGGITT PLC	35	99.25	48	6,731	資本財・サービス
G4S PLC	113.2	113.2	23	3,208	資本財・サービス
COBHAM PLC	196.77	–	–	–	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	15.7	31	4,428	金融
INVESTEC PLC	46	46	21	3,017	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	34.6	29	4,054	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	204.57	178.99	47	6,579	金融
EXPERIAN PLC	56.18	75.55	143	19,878	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計 株数、金額	21,017.95	27,729.14	15,606	2,160,147	
イギリス・ポンド通貨計 銘柄数<比率>	99銘柄	92銘柄		< 5.8%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
AZRIELI GROUP LTD	5.3	5.3	98	2,893	不動産
FRUTAROM	4.18	–	–	–	その他
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	50	50	17	526	コミュニケーション・サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	–	110.96	234	6,928	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	138	4,072	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	79	79	189	5,592	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	114	114	261	7,727	金融
NICE LTD	2	8	314	9,266	情報技術
イスラエル・シュケル通貨計 株数、金額	257.48	370.26	1,254	37,007	
イスラエル・シュケル通貨計 銘柄数<比率>	7銘柄	7銘柄		< 0.1%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
DUFRY AG-REG	1.89	1.89	19	2,117	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	251.61	374.02	476	52,976	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.5	0.5	24	2,710	素材
ADECCO GROUP AG-REG	10.87	17.54	85	9,460	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	50.2	65.41	1,657	184,130	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	3.89	28	3,217	金融
SIKA AG-REG	0.14	11.4	145	16,108	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	71	7,920	生活必需品
ABB LTD-REG	131.26	176.76	341	37,937	資本財・サービス
SWISS RE AG	20.5	25	230	25,556	金融
NESTLE SA-REG	217	285.66	2,332	259,139	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1.63	1.63	102	11,389	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3	3	62	6,912	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	185.03	215.08	243	27,059	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	15.65	21.98	81	9,058	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
SGS SA-REG		0.32	0.46	104	11,630	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		–	1.53	31	3,457	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG		3.69	3.69	42	4,761	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG		–	5.08	61	6,834	情報技術
SWATCH GROUP AG/THE-BR		1.8	2.67	79	8,821	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		10.63	13.47	403	44,771	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		3.2	3.2	45	5,030	金融
CLARIANT AG-REG		15.68	15.68	30	3,394	素材
NOVARTIS AG-REG		153.52	202.9	1,726	191,816	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.2	0.2	31	3,454	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		39.17	44.47	293	32,565	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		1.8	2.76	131	14,640	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG		2.34	3.34	124	13,828	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		0.68	0.89	206	22,947	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		0.52	1.11	71	7,922	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		3	5.63	92	10,257	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG		5.42	6.92	192	21,440	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		4.5	4.5	26	2,951	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		31.17	38.01	164	18,224	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		2.31	3.81	149	16,604	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		3	4.95	65	7,231	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		4.5	9.46	77	8,622	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.1	0.1	60	6,704	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額	1,180.73	1,578.6	10,114	1,123,608	
	銘柄数<比率>	36銘柄	38銘柄		< 3.0%>	
(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		129.05	185.25	5,874	98,335	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		59.44	72.36	949	15,898	金融
ISS A/S		13.2	13.2	251	4,202	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		0.3	0.3	252	4,233	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S		5	5	149	2,499	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		13.38	18.57	949	15,897	資本財・サービス
TDC A/S		68	–	–	–	その他
CARLSBERG AS-B		8.06	12.32	858	14,374	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		18.02	18.02	544	9,116	素材
COLOPLAST-B		6.5	10.52	638	10,686	ヘルスケア
DSV A/S		12	16.5	783	13,122	資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING		13.14	13.14	269	4,513	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0.43	0.66	593	9,936	資本財・サービス
TRYG A/S		17	17	277	4,650	金融
PANDORA A/S		7.5	7.5	210	3,521	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		7.5	7.5	462	7,741	素材
GENMAB A/S		4.33	7.33	815	13,644	ヘルスケア
ORSTED A/S		15.33	23.33	1,032	17,281	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額	398.18	428.5	14,913	249,656	
	銘柄数<比率>	18銘柄	17銘柄		< 0.7%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA		74.5	130.5	531	6,784	素材
DNB ASA		62.45	85.45	1,271	16,231	金融
ORKLA ASA		70	70	481	6,148	生活必需品
TELENOR ASA		46	62.5	1,062	13,568	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		76.17	111.21	2,163	27,621	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		14.5	14.5	532	6,795	素材
MOWI ASA		23.5	46.77	848	10,834	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		20	20	268	3,427	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS		17	17	504	6,447	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA		–	13.06	333	4,259	エネルギー
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額	404.12	570.99	7,996	102,118	
	銘柄数<比率>	9銘柄	10銘柄		< 0.3%>	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB		7	7	223	2,731	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS		207	323.35	2,634	32,161	情報技術
VOLVO AB-B SHS		101.88	145.68	1,778	21,709	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		7.77	7.77	458	5,602	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES		21	40	582	7,106	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		15	26	522	6,374	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB		230.18	–	–	–	その他
SWEDISH MATCH AB		12	12	435	5,321	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		32.58	32.58	366	4,479	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS		19	–	–	–	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		96	196.97	1,749	21,356	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		100	165.26	1,638	20,000	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		71.08	90.75	1,864	22,770	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		66.23	90.39	1,215	14,842	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS		18	37.09	556	6,799	資本財・サービス
SANDVIK AB		81.22	101.22	1,375	16,789	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		33.82	45.5	1,780	21,744	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		50.28	76.68	1,736	21,196	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		25	25	354	4,333	資本財・サービス
TELIA CO AB		158	241.07	1,032	12,609	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		20	20	394	4,818	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		25	54.99	1,144	13,975	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		67.9	108.82	1,759	21,484	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS		4.74	9.48	259	3,169	金融
LUNDIN PETROLEUM AB		19	19	474	5,795	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		50.5	50.5	1,132	13,824	生活必需品
BOLIDEN AB		18	31.71	651	7,960	素材
EPIROC AB-A		–	69.82	589	7,199	資本財・サービス
EPIROC AB-B		–	25	198	2,428	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		24	24	167	2,050	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP		–	339.57	2,707	33,057	金融
KINNEVIK AB - B		15	15	338	4,137	金融
HEXAGON AB-B SHS		17	24	1,001	12,231	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		13	13	239	2,930	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	1,627.18	2,469.2	31,367	382,991	
	銘柄数<比率>	31銘柄	32銘柄		< 1.0%>	
ユーロ (アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		–	19.95	49	6,244	素材
AIB GROUP PLC		90	90	32	4,106	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		52.34	102.34	51	6,396	金融

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
KINGSPAN GROUP PLC		－	16	61	7,672	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		12.66	17.12	158	19,859	生活必需品
CRH PLC		50.5	65	158	19,865	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC		4.6	8.89	66	8,273	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	210.1	319.3	579	72,416	
	銘柄数<比率>	5銘柄	7銘柄		<0.2%>	
ユーロ（オランダ）		百株	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N.V.		12.99	25.21	78	9,838	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		59.5	81.13	250	31,255	ヘルスケア
NN GROUP NV		22.5	31	109	13,729	金融
UNILEVER NV-CVA		112.44	141.32	654	81,815	生活必需品
HEINEKEN NV		18.65	29.1	221	27,674	生活必需品
AEGON NV		143.61	143.61	60	7,589	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		88.76	106.52	238	29,818	生活必需品
AKZO NOBEL		17.25	28.18	196	24,558	素材
KONINKLIJKE DSM NV		14.59	19.38	145	18,241	素材
WOLTERS KLUWER		23.76	23.76	124	15,616	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER		9.1	－	－	－	資本財・サービス
ING GROEP NV		264.15	364.4	357	44,734	金融
KONINKLIJKE KPN NV		239	360	89	11,209	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		25.27	34.89	491	61,493	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA		24	34.53	74	9,275	金融
VOPAK		6.3	6.3	27	3,418	エネルギー
RANDSTAD NV		7.5	7.5	30	3,861	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		6	11	81	10,147	生活必需品
ALTICE EUROPE NV		33.5	－	－	－	コミュニケーション・サービス
STMICROELECTRONICS NV		49.17	74.98	90	11,256	情報技術
AIRBUS SE		39.97	51.12	458	57,305	資本財・サービス
EXOR NV		10.88	10.88	55	6,990	金融
CNH INDUSTRIAL NV		73.53	116.91	97	12,217	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		70.44	107.87	148	18,550	一般消費財・サービス
FERRARI NV		8.3	11.3	109	13,658	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	1,381.16	1,820.89	4,194	524,257	
	銘柄数<比率>	25銘柄	23銘柄		<1.4%>	
ユーロ（ベルギー）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA		7	11.1	84	10,508	ヘルスケア
KBC GROUP NV		17.34	22.11	129	16,178	金融
COLRUYT SA		3.5	3.5	22	2,765	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		4	9	70	8,853	金融
SOLVAY SA		5.36	8.73	81	10,203	素材
UMICORE		16	16	59	7,498	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		53.07	65.89	400	50,059	生活必需品
AGEAS		16.54	16.54	64	8,001	金融
PROXIMUS		7	22.69	53	6,747	コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		4.62	4.62	19	2,389	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	134.43	180.18	985	123,206	
	銘柄数<比率>	10銘柄	10銘柄		<0.3%>	
ユーロ（ルクセンブルグ）		百株	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA		－	80.42	59	7,398	不動産
RTL GROUP		3.5	3.5	17	2,159	コミュニケーション・サービス

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELORMITTAL		43.44	53.27	104	13,072	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		0.6	1.31	46	5,793	ヘルスケア
SES		19	44.02	75	9,450	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA		22	47	48	6,095	エネルギー
国小計	株数、金額	88.54	229.52	351	43,969	
	銘柄数<比率>	5銘柄	6銘柄		<0.1%>	
ユーロ（フランス）		百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA		8.45	8.45	22	2,843	コミュニケーション・サービス
TOTAL SA		152.31	219.22	1,048	131,066	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		11.5	18.61	167	20,978	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		28.45	39.38	414	51,760	素材
KERING		5.12	7.08	297	37,178	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		38.93	52.24	314	39,284	資本財・サービス
BOUYGUES SA		12.5	18.92	56	7,116	資本財・サービス
BNP PARIBAS		76.75	95.82	390	48,838	金融
PEUGEOT SA		45.73	64.97	128	16,076	一般消費財・サービス
NATIXIS		76.74	76.74	32	4,117	金融
THALES SA		6	9.18	94	11,865	資本財・サービス
DANONE		39.26	58.53	360	45,038	生活必需品
CARREFOUR SA		51.56	51.56	81	10,215	生活必需品
SUEZ		29.5	29.5	34	4,316	公益事業
VIVENDI		69.25	88.01	191	23,894	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		17.28	23.46	462	57,784	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		32.89	58.49	174	21,816	資本財・サービス
LEGRAND SA		17.5	22.5	115	14,394	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		2	2	7	896	生活必需品
PERNOD RICARD SA		15.58	21.54	297	37,223	生活必需品
SOCIETE BIC SA		1.5	1.5	13	1,681	資本財・サービス
EURAZEO SE		1.59	5.34	33	4,231	金融
REXEL SA		16	38.7	37	4,730	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA		54.11	61.29	174	21,838	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		18.41	25.46	665	83,238	一般消費財・サービス
ACCOR SA		10	18.5	69	8,681	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		12.71	16.45	149	18,670	情報技術
VALEO SA		15.12	19.65	54	6,821	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		13	18.06	95	11,969	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		17	32.27	58	7,359	資本財・サービス
EIFFAGE		4	7.5	55	6,916	資本財・サービス
SODEXO SA		6.69	6.69	61	7,651	一般消費財・サービス
IPSEN		2.76	2.76	32	4,005	ヘルスケア
INGENICO GROUP		4.99	4.99	26	3,253	情報技術
AMUNDI SA		4.37	4.37	21	2,668	金融
TELEPERFORMANCE		5	5	72	9,056	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		5	9.77	74	9,305	コミュニケーション・サービス
ZODIAC AEROSPACE		21.34	－	－	－	その他
FAURECIA		5.6	5.6	20	2,604	一般消費財・サービス
SEB SA		1.97	1.97	24	3,085	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		14.86	27.31	305	38,131	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		0.22	0.22	26	3,308	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
AXA SA	123.65	185.78	359	44,926	金融
LAGARDERE SCA	12	–	–	–	コミュニケーション・サービス
EDENRED	19.13	19.13	66	8,321	資本財・サービス
RENAULT SA	12	16.5	93	11,682	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	2.04	2.68	131	16,455	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	2.53	25	3,165	生活必需品
ATOS SE	6.43	9.46	69	8,689	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	8.99	11.49	121	15,245	情報技術
WENDEL	2.01	2.01	21	2,726	金融
ORANGE	121.29	174.04	238	29,869	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	13.1	13.1	45	5,713	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	13.49	25	3,153	金融
SANOFI	72.79	102.52	759	94,997	ヘルスケア
VINCI SA	31.06	44.64	325	40,678	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	38.63	69.73	126	15,776	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	76.58	99.04	97	12,131	金融
BIOMERIEUX	4.57	4.57	26	3,347	ヘルスケア
ENGIE	123.26	144.44	191	23,895	公益事業
IMERYS SA	3.4	3.4	15	1,946	素材
EDF	34	67.6	93	11,631	公益事業
SAFRAN SA	22.2	31.33	338	42,275	資本財・サービス
ILIAD SA	2.19	2.19	25	3,146	コミュニケーション・サービス
ARKEMA	4.8	8.38	69	8,700	素材
ADP	1	3.5	57	7,126	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14	14	24	3,123	コミュニケーション・サービス
SCOR SE	12.97	12.97	51	6,416	金融
GETLINK SE	39.4	39.4	46	5,828	資本財・サービス
BOLLORE	73	73	26	3,319	資本財・サービス
国小計 株数、金額	1,864.05	2,450.52	10,241	1,280,207	
国小計 銘柄数<比率>	70銘柄	68銘柄		<3.5%>	
ユーロ（ドイツ）	百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	53.6	85.32	559	69,951	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	6	18	42	5,269	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	136.93	229.67	170	21,278	金融
COMMERZBANK AG	72.89	96.89	60	7,533	金融
VOLKSWAGEN AG	2.2	4.2	61	7,738	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	11.72	17.74	259	32,481	一般消費財・サービス
MAN SE	1	–	–	–	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG	49.62	70.78	698	87,271	資本財・サービス
E.ON SE	162.7	222.7	198	24,870	公益事業
UNIPER SE	–	13.8	33	4,133	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23.9	29.21	213	26,635	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	13	31	3,891	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	6.45	6.45	24	3,045	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	7.5	11.8	156	19,514	一般消費財・サービス
BASF SE	60.62	79.21	501	62,704	素材
K+S AG-REG	14	–	–	–	素材
ALLIANZ SE-REG	30.61	38.42	680	85,071	金融
THYSSENKRUPP AG	26.3	40.3	65	8,138	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14.05	18.57	179	22,455	生活必需品
RWE AG	33.07	53.09	106	13,255	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	17	34	4,258	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1.1	5.6	35	4,487	資本財・サービス
BRENNTAG AG	14.36	14.36	57	7,210	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	30.86	37.09	160	20,098	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	9.59	37	4,718	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	1.66	1.66	20	2,500	資本財・サービス
SAP SE	64.24	89.04	794	99,257	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10.36	12.14	227	28,475	金融
SCHAEFFLER AG	21.02	–	–	–	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	7	7	19	2,378	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	9	12.3	69	8,689	素材
KION GROUP AG	6	6	27	3,488	資本財・サービス
WIRECARD AG	10	10	142	17,868	情報技術
COVESTRO AG	8.03	19.45	90	11,373	素材
INNOGY SE	6	15	60	7,590	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG	–	3.05	36	4,540	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12.65	12.65	70	8,791	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	–	10.56	35	4,382	一般消費財・サービス
METRO AG	15	15	20	2,565	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG	5	5	21	2,698	コミュニケーション・サービス
LINDE AG - TENDER	13.3	–	–	–	その他
SIEMENS HEALTHINEERS AG	–	15	52	6,554	ヘルスケア
BEIERSDORF AG	8.15	8.15	73	9,195	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	7	7	26	3,339	素材
MERCK KGAA	8.12	11.49	104	13,041	ヘルスケア
ADIDAS AG	12.57	15.92	308	38,576	一般消費財・サービス
PUMA SE	–	0.51	23	2,922	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	6.5	13.11	116	14,543	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	211.13	289.91	428	53,524	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	17.66	22.71	136	17,123	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	66.01	80.1	391	48,976	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	84.23	130.44	237	29,650	情報技術
HANNOVER RUECK SE	3.5	6.44	77	9,684	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	66.98	89.74	227	28,447	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	12.74	18.97	204	25,585	金融
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	15.6	15.6	24	3,092	コミュニケーション・サービス
LANXESS AG	6	6	26	3,348	素材
MTU AERO ENGINES AG	4	4	67	8,470	資本財・サービス
AXEL SPRINGER SE	4.7	4.7	24	3,113	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	23.63	32.85	136	17,045	不動産
SYMRISE AG	8.3	14.36	98	12,356	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	62.4	20	2,510	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2.5	2.5	15	1,981	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD	3.5	8.11	47	5,975	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	35.6	44.35	179	22,396	不動産
国小計 株数、金額	1,659.15	2,256	9,056	1,132,071	
国小計 銘柄数<比率>	60銘柄	61銘柄		<3.1%>	

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ（ポルトガル）		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		8	29	30	3,871	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		151	275.76	84	10,599	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		36.09	36.09	52	6,575	エネルギー
国小計	株数、金額	195.09	340.85	168	21,046	
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		< 0.1%>	
ユーロ（スペイン）		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		325.71	405.69	305	38,170	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		21.5	21.5	43	5,401	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		424.92	604.32	298	37,320	金融
IBERDROLA SA		368.4	560.28	384	48,072	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		325.87	496.34	51	6,495	金融
BANKINTER SA		67	67	47	5,931	金融
REPSOL SA		83.17	142	208	26,083	エネルギー
GRIFOLS SA		17	30.04	72	9,098	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		1,025.73	1,404.79	589	73,742	金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		48.29	–	–	–	資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA		31.95	43.11	269	33,647	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		21	39.78	89	11,198	公益事業
MAPFRE SA		80.05	80.05	18	2,357	金融
CAIXABANK SA		219.87	304.87	98	12,370	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		49	49	32	4,074	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		21.95	21.95	75	9,487	資本財・サービス
AENA SME SA		4	5.69	78	9,850	資本財・サービス
IBERDROLA SA-RTS		–	560.28	8	1,064	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		69.28	96.55	230	28,771	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		17.93	17.93	20	2,612	資本財・サービス
ENAGAS SA		18.59	36.75	90	11,296	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		40.56	40.56	79	9,881	公益事業
FERROVIAL SA		38.76	38.76	71	8,917	資本財・サービス
BANKIA SA		72.87	159.05	42	5,294	金融
国小計	株数、金額	3,393.4	5,226.29	3,209	401,140	
	銘柄数<比率>	23銘柄	23銘柄		< 1.1%>	
ユーロ（イタリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		130	–	–	–	金融
PRYSMIAN SPA		14.4	14.4	26	3,317	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		96.36	117.33	173	21,720	金融
MEDIOBANCA SPA		44.6	44.6	34	4,267	金融
UNICREDIT SPA		141.35	211.47	219	27,443	金融
TELECOM ITALIA SPA		1,085.03	1,085.03	53	6,725	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		483.81	483.81	20	2,594	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO-RSP		93.84	–	–	–	金融
INTESA SANPAOLO		837.01	1,354.57	271	33,974	金融
ATLANTIA SPA		35.27	60.27	116	14,619	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		29	29	20	2,575	金融
MONCLER SPA		–	15.22	47	5,966	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA		6.92	6.92	20	2,573	ヘルスケア
ENI SPA		163.64	211.46	301	37,682	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		–	44.83	33	4,205	生活必需品
PIRELLI & C SPA		–	56.51	33	4,214	一般消費財・サービス
LEONARDO SPA		25	25	20	2,513	資本財・サービス
ENEL SPA		562.64	711.57	367	45,931	公益事業
SNAM SPA		162	243	98	12,338	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA		13.07	–	–	–	一般消費財・サービス
TERNA SPA		99	199	102	12,840	公益事業
国小計	株数、金額	4,022.94	4,913.99	1,964	245,504	
	銘柄数<比率>	18銘柄	18銘柄		< 0.7%>	
ユーロ（フィンランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		44.93	44.93	106	13,293	素材
NOKIA OYJ		364.94	544.37	290	36,255	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		8.5	41.16	59	7,390	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		41.93	41.93	45	5,707	素材
METSO OYJ		11.08	11.08	27	3,466	資本財・サービス
ELISA OYJ		13	13	49	6,160	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		29.29	38.32	151	18,939	金融
FORTUM OYJ		24	44	82	10,364	公益事業
KONE OYJ-B		26.6	38.6	168	21,085	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		7	17.7	49	6,237	一般消費財・サービス
NESTE OYJ		11	11	83	10,411	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		5	17.63	58	7,340	ヘルスケア
国小計	株数、金額	587.27	863.72	1,173	146,653	
	銘柄数<比率>	12銘柄	12銘柄		< 0.4%>	
ユーロ（オーストリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG		–	13	52	6,522	公益事業
OMV AG		12.09	12.09	49	6,230	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		20	27.5	85	10,714	金融
VOESTALPINE AG		8	18	50	6,304	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		11	11	26	3,306	金融
ANDRITZ AG		5.5	5.5	22	2,868	資本財・サービス
国小計	株数、金額	56.59	87.09	287	35,947	
	銘柄数<比率>	5銘柄	6銘柄		< 0.1%>	
ユーロ（その他）		百株	百株	千ユーロ	千円	
RELX PLC		64	–	–	–	資本財・サービス
国小計	株数、金額	64	–	–	–	
	銘柄数<比率>	1銘柄	–		< –>	
ユーロ通貨計	株数、金額	13,656.72	18,688.35	32,211	4,026,421	
	銘柄数<比率>	237銘柄	237銘柄		<10.9%>	
ファンド合計	株数、金額	77,886.52	103,430.96	–	33,270,926	
	銘柄数<比率>	1,242銘柄	1,236銘柄		<90.1%>	

（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) 外国投資信託受益証券

銘柄		期首	当期末			
		口数	口数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
（シンガポール）		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U		70	–	–	–	
合計	口数、金額	70	–	–	–	
	銘柄数<比率>	1銘柄	–		<–>	

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

(3) 外国投資信託証券

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC		0.872	1.372	241	26,089
SIMON PROPERTY GROUP INC		2.094	2.794	484	52,421
BOSTON PROPERTIES INC		1.15	1.556	182	19,770
GGP INC		4	–	–	–
VORNADO REALTY TRUST		1.156	2.128	136	14,759
SBA COMMUNICATIONS CORP		0.8	1.055	174	18,826
EQUITY RESIDENTIAL		2.25	3.603	238	25,852
EQUINIX INC		0.514	0.706	252	27,292
AMERICAN TOWER CORP		3.1	4.045	645	69,880
HOST HOTELS & RESORTS INC		4.228	6.228	108	11,764
KIMCO REALTY CORP		3.3	3.3	51	5,619
COLONY CAPITAL INC		3.5	–	–	–
INVITATION HOMES INC		2.2	2.2	44	4,774
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A		–	2.403	41	4,443
VENTAS INC		2.7	3.702	215	23,318
WEYERHAEUSER CO		4.904	7.435	176	19,064
AGNC INVESTMENT CORP		2.1	4.334	77	8,341
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		1.4	–	–	–
CROWN CASTLE INTL CORP		2.8	4.153	438	47,478
IRON MOUNTAIN INC		1.718	1.718	59	6,397
VEREIT INC		7.75	7.75	58	6,288
PROLOGIS INC		3.415	5.687	348	37,722
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		0.7	1.2	140	15,228
CAMDEN PROPERTY TRUST		0.65	0.65	56	6,147
DUKE REALTY CORP		3.1	3.1	82	8,928
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.45	0.6	147	15,907
FEDERAL REALTY INVS TRUST		0.45	0.974	118	12,851
WELLTOWER INC		2.35	3.797	264	28,624
HCP INC		2.8	4.55	129	14,034
LIBERTY PROPERTY TRUST		1	1	42	4,647
MID-AMERICA APARTMENT COMM		0.7	1.1	104	11,304
MACERICH CO/THE		0.7	0.7	32	3,518
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		9.6	9.6	94	10,220
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		0.65	1.552	74	8,063
REALTY INCOME CORP		1.8	2.55	160	17,364
PUBLIC STORAGE		1.1	1.54	305	33,019
REGENCY CENTERS CORP		1.15	1.15	67	7,317
SL GREEN REALTY CORP		0.65	0.65	56	6,063
UDR INC		1.9	1.9	74	8,039
WP CAREY INC		–	1.6	109	11,821
DIGITAL REALTY TRUST INC		1.45	1.8	183	19,830
EXTRA SPACE STORAGE INC		0.8	1.285	113	12,305
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	87.951	107.467	6,334	685,344
	銘柄数<比率>	40銘柄	39銘柄		<1.9%>
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		2	2	42	3,487
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1.4	1.4	33	2,778
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	3.4	3.4	76	6,265
	銘柄数<比率>	2銘柄	2銘柄		<0.0%>
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE GROUP		4.303	4.303	51	3,980
TRANSURBAN GROUP		17.162	26.027	303	23,569
SYDNEY AIRPORT		9.129	9.129	60	4,689
APA GROUP		7.5	7.5	67	5,220
SCENTRE GROUP		30.929	43.529	174	13,511
DEXUS		6.5	6.5	68	5,326
GPT GROUP		14.648	14.648	78	6,103
MIRVAC GROUP		31.638	31.638	71	5,548
STOCKLAND		14.3	14.3	51	3,983
WESTFIELD CORP		13.956	–	–	–
GOODMAN GROUP		14.731	14.731	161	12,562
VICINITY CENTRES		19.523	19.523	50	3,908
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	184.319	191.828	1,139	88,406
	銘柄数<比率>	12銘柄	11銘柄		<0.2%>
(香港)		千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT		13.5	24	1,917	26,462
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		–	52	422	5,826
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		34	34	399	5,508
香港ドル通貨計	口数、金額	47.5	110	2,739	37,798
	銘柄数<比率>	2銘柄	3銘柄		<0.1%>
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		28	28	50	4,029
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		12	30.5	80	6,462
CAPITALAND MALL TRUST		9	9	21	1,705
SUNTEC REIT		26	26	48	3,846
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	75	93.5	200	16,044
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		4.808	4.808	39	5,496
SEGRO PLC		5.92	5.92	36	5,047
HAMMERSON PLC		4.9	10.958	37	5,187
BRITISH LAND CO PLC		6.3	6.3	34	4,734
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	21.928	27.986	147	20,466
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.1%>
ユーロ(フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		–	1.249	179	22,378
UNIBAIL-RODAMCO SE		0.609	–	–	–
ICADE		0.406	0.406	27	3,483
GECINA SA		0.334	0.334	39	4,901
KLEPIERRE		1.4	2.394	67	8,379
COVIVIO		0.353	0.353	29	3,732
ユーロ通貨計	口数、金額	3.102	4.736	343	42,876
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<0.1%>
合計	口数、金額	423.2	538.917	–	897,201
	銘柄数<比率>	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	当期末 売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT（アメリカ）	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	－
	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	当期末 比率
	千円	%
株式	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・シュケル＝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５０ＶＡ25,088,268円、ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ55,351,015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。

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版）

第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／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（預託証書を含みます。）	
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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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/

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	10,094	100	1.9	10,127	1.3	97.0	1.4	2.6	1
2期末（2018年6月15日）	11,273	220	13.9	11,344	12.0	97.9	1.5	2.4	1
3期末（2019年6月17日）	11,306	30	0.6	11,184	△ 1.4	96.1	1.3	2.9	16

（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：11,273円
期　末：11,306円（分配金30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		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
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期首）2018年６月15日	11,273	—	11,344	—	97.9	1.5	2.4
６月末	10,960	△ 2.8	11,001	△ 3.0	95.6	2.0	2.5
７月末	11,389	1.0	11,428	0.7	96.1	1.5	2.4
８月末	11,631	3.2	11,644	2.6	95.7	1.8	2.4
９月末	11,921	5.7	11,930	5.2	96.2	1.4	2.4
10月末	10,867	△ 3.6	10,866	△ 4.2	95.5	1.9	2.6
11月末	11,116	△ 1.4	11,088	△ 2.3	95.1	2.3	2.6
12月末	9,953	△ 11.7	9,913	△ 12.6	96.2	1.2	2.7
2019年１月末	10,598	△ 6.0	10,537	△ 7.1	96.1	1.2	2.7
２月末	11,229	△ 0.4	11,166	△ 1.6	96.2	1.1	2.7
３月末	11,302	0.3	11,216	△ 1.1	95.8	1.6	2.8
４月末	11,803	4.7	11,697	3.1	96.4	0.9	2.7
５月末	11,052	△ 2.0	10,907	△ 3.9	96.0	1.1	2.8
（期末）2019年６月17日	11,336	0.6	11,184	△ 1.4	96.1	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、ＦＲＢ（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（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。

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＆Ｐ500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。

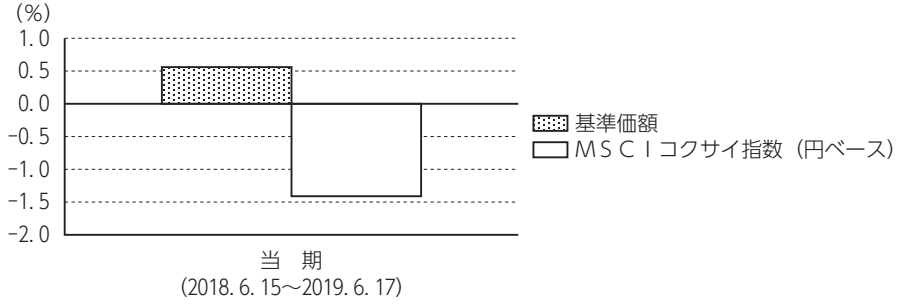
ベンチマークとの差異について

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

当作成期の１万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（１万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項目			当期 2018年６月16日 ～2019年６月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**30**
	対基準価額比率	（%）	0.26
	当期の収益	（円）	15
	当期の収益以外	（円）	15
翌期繰越分配対象額		（円）	1,561

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

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

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

■収益分配金の計算過程（１万口当り）

項目		当期
（ａ）経費控除後の配当等収益	✓	25.20円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益		284.70
（ｃ）収益調整金	✓	1,194.40
（ｄ）分配準備積立金		87.03
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		1,591.35
（ｆ）分配金		30.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		1,561.35

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

今後の運用方針

■当ファンド

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

■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	49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11, 173円です。**
（投 信 会 社）	(35)	(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）	(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. 004	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. 000)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	1	0. 009	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. 009)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	8	0. 068	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. 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）	(4)	(0. 034)	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	58	0. 521	

（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マザーファンド	6,167	14,998	11	29

（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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国株式インデックスマザーファンド	463	6,619	16,579

（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	16,579	100.0
コール・ローン等、その他	6	0.0
投資信託財産総額	16,585	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・シュケル＝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	**16,585,133円**
コール・ローン等	5,237
外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	16,579,096
未収入金	800
（B）負債	**48,416**
未払収益分配金	43,879
未払信託報酬	4,342
その他未払費用	195
（C）純資産総額（A－B）	**16,536,717**
元本	14,626,454
次期繰越損益金	1,910,263
（D）受益権総口数	**14,626,454口**
１万口当り基準価額（C／D）	**11,306円**

＊期首における元本額は1,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は13,626,454円、同解約元本額は０円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は11,306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)有価証券売買損益	**460,415円**
売買益	460,545
売買損	△　130
(B)信託報酬等	△　**7,127**
(C)当期損益金（A＋B）	**453,288**
(D)前期繰越損益金	**127,308**
(E)追加信託差損益金	**1,373,546**
（配当等相当額）	(　1,746,996)
（売買損益相当額）	(△　373,450)
(F)合計（C＋D＋E）	**1,954,142**
(G)収益分配金	△　**43,879**
次期繰越損益金（F＋G）	**1,910,263**
追加信託差損益金	1,351,607
（配当等相当額）	(　1,725,057)
（売買損益相当額）	(△　373,450)
分配準備積立金	558,656

（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	36,862円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	416,426
(c) 収益調整金	1,746,996
(d) 分配準備積立金	127,308
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	2,327,592
(f) 分配金	43,879
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	2,283,713
(h) 受益権総口数	14,626,454口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１　万　口　当　り　分　配　金	30円

分配金の課税上の取扱いについて

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

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（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127～154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（ジャージィー）	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, 531千口）の内容です。

(1)外国株式

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	
（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

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	
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
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

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	
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

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	
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
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

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	
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
FREEPORT-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
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

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	
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

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	
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
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

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	
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
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

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	
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
SYNOPSYS 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

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	
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
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 SOFTWRE	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

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	
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
SKYWORKS 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

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	
CARMAX INC	46	384	41,756	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	315	34,330	金融
INGREDION INC	19	155	16,846	生活必需品
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
WW 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
KOHLS 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

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
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	83,179.23	676,313	73,488,262	
	銘柄数<比率>	616銘柄		<65.3%>	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
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
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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千カナダ・ドル	千円	
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	11,209.58	51,463	4,168,542	
	銘柄数<比率>	86銘柄		<3.7%>	

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	
(オーストラリア)				
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
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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
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	19,252.08	34,719	2,594,623	
	銘柄数<比率>	58銘柄		<2.3%>	
		百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
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
WHEELOCK & 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
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	24,743.84	98,614	1,367,781	
	銘柄数<比率>	37銘柄		<1.2%>	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
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

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
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
YANGZIJIANG 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 AGRI-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	12,213.2	6,124	485,389	
	銘柄数<比率>	21銘柄		<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		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	1,825.89	1,380	97,484	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<0.1%>	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
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

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	
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
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
ASHTEAD 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

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
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	83,458.15	50,226	6,868,418	
	銘柄数<比率>	94銘柄		<6.1%>	
		百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)					
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・シュケル通貨計	株数、金額	1,300.5	4,263	128,376	
	銘柄数<比率>	8銘柄		<0.1%>	
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
DUFRY 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
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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スイス・フラン	千円	
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	4,926.14	35,096	3,817,478	
	銘柄数<比率>	39銘柄		<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	1,159.5	43,991	717,936	
	銘柄数<比率>	17銘柄		<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	1,602.83	22,137	276,503	
	銘柄数<比率>	10銘柄		<0.2%>	

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		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
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	6,831.8	93,877	1,074,898	
	銘柄数<比率>	32銘柄		<1.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(アイルランド)					
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	903.3	1,848	225,225	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<0.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(オランダ)					
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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
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	5,188.14	14,574	1,776,183	
	銘柄数<比率>	24銘柄		<1.6%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）					
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	532.9	3,224	392,991	
	銘柄数<比率>	10銘柄		<0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ルクセンブルグ）					
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	株数、金額	653.2	886	108,014	
	銘柄数<比率>	6銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）					
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

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	千ユーロ	千円	
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

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
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	株数、金額	7,374.18	34,100	4,155,848	
	銘柄数<比率>	69銘柄		<3.7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）					
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
BRENNTAG 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

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 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
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	6,658.87	28,920	3,524,498	
	銘柄数<比率>	61銘柄		<3.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）					
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	859.5	496	60,560	
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）					
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
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	14,256.13	10,106	1,231,678	
	銘柄数<比率>	22銘柄		<1.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）					
PRYSMIAN SPA		68.5	115	14,133	資本財・サービス

銘柄		2019年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
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	14,934.99	6,350	773,957	
	銘柄数<比率>	19銘柄		<0.7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）					
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	2,609	3,347	407,938	
	銘柄数<比率>	12銘柄		<0.4%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）					
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	222	714	87,122	
	銘柄数<比率>	6銘柄		<0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	54,192.21	104,570	12,744,017	
	銘柄数<比率>	239銘柄		<11.3%>	
ファンド合計	株数、金額	305,894.95	—	107,829,712	
	銘柄数<比率>	1,264銘柄		<95.8%>	

（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。

(2)外国投資信託証券

銘柄		2019年6月17日現在		
		口数	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
(アメリカ)				
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	口数、金額	337.728	22,829	2,480,675
	銘柄数<比率>	40銘柄		<2.2%>
		千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		2.1	71	5,786
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3.7	84	6,812
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		3.9	104	8,478
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	9.7	260	21,077
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.0%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
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

銘柄		2019年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
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	口数、金額	703.505	4,771	356,573
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.3%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
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	口数、金額	241	7,581	105,161
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
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	口数、金額	272.3	651	51,662
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)				
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	口数、金額	75.762	522	71,505
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ(フランス)				
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	口数、金額	12.9	1,045	127,355
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.1%>
ファンド合計	口数、金額	1,652.895	—	3,214,011
	銘柄数<比率>	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
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	1,491	—

(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）

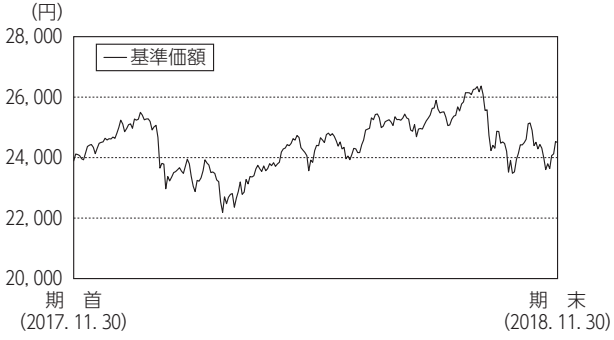
外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★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（預託証書を含みます。）
株式組入制限	無制限

大和投資信託
Daiwa Asset Management
東京都千代田区丸の内一丁目９番１号
http://www.daiwa-am.co.jp/

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額		MSCIコクサイ指数（円ベース）		株　式組入比率	株　式先物比率	投資信託証　券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(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	1円
(株式)	(1)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	2
(株式)	(2)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	13
(保管費用)	(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 (—)	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 (—)	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・シュケル 384 (△ 270)	百株 —	千イスラエル・シュケル —
	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
外国	デンマーク	百株 117.9 (—)	千デンマーク・クローネ 4,436 (—)	百株 203.5	千デンマーク・クローネ 1,246
	ノルウェー	百株 230 (—)	千ノルウェー・クローネ 3,758 (—)	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 (—)	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 (—)	千ユーロ 528 (△ 960)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ(オランダ)	百株 585.9 (—)	千ユーロ 1,713 (—)	百株 204.5	千ユーロ 289
	ユーロ(ベルギー)	百株 66.5 (—)	千ユーロ 435 (—)	百株 2.1	千ユーロ 18
	ユーロ(ルクセンブルグ)	百株 49.2 (—)	千ユーロ 118 (—)	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
	ユーロ(ポルトガル)	百株 165 (—)	千ユーロ 53 (—)	百株 —	千ユーロ —
	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 (—)	百株 4.5	千ユーロ 19
	ユーロ(オーストリア)	百株 12.5 (—)	千ユーロ 56 (△ 8)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ(その他)	百株 20 (—)	千ユーロ 35 (—)	百株 299.19	千ユーロ 608
	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
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	60.61 (△ 10.421)	3,041 (△ 241)	19.95 (—)	232 (—)
		千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
	カナダ	0.7 (—)	14 (—)	— (—)	— (—)
		千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	オーストラリア	102.7 (—)	625 (△ 14)	54.196 (—)	458 (—)
		千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
	香港	18.5 (—)	590 (—)	1.5 (—)	97 (—)
		千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
	シンガポール	32.1 (—)	68 (△ 1)	— (—)	— (—)
		千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
	イギリス	5.9 (—)	44 (—)	21.1 (—)	41 (—)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ(フランス)	2.11 (—)	304 (—)	0.18 (—)	23 (—)

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

(3)先物取引の種類別取引状況

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	株式先物取引	18,905	18,303	—	—

(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)

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

(注1)金額は受渡し代金。
(注2)金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

■組入資産明細表
(1)外国株式

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	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 IN	—	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 IN	—	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 IN	135	151.5	1,228	139,399	金融

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

外国株式インデックスマザーファンド

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

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

銘柄	期首	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	
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 SOFTWRE	—	30.5	341	38,730	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	11.5	13.3	261	29,685	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	43.5	50.5	324	36,851	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	109	124	300	34,148	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,280.01	2,491.01	6,984	792,564	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	41	46	445	50,499	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	156	17,803	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	173.5	190.5	2,120	240,608	金融
ANALOG DEVICES INC	82.99	95.49	854	96,997	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	180	238	510	57,873	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	72	382	43,398	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	210.22	230.22	1,000	113,478	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	127	135	724	82,260	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41.5	48	341	38,795	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	40	44.5	496	56,366	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	45	51	89	10,156	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	—	—	—	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	21	23	219	24,879	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	136	153.5	1,079	122,446	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	149	165.5	1,114	126,440	資本財・サービス
AON PLC	60	63	1,031	117,008	金融
AMGEN INC	168.5	172.5	3,490	396,110	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N. V.	10	—	—	—	エネルギー
TAPESTRY INC	64	76.5	290	32,994	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	101.36	115.36	876	99,496	資本財・サービス
CELGENE CORP	178	192	1,347	152,852	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	38.8	43.3	849	96,402	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	245	263	961	109,044	情報技術
CIT GROUP INC	33	33	152	17,333	金融
CIMAREX ENERGY CO	22.5	25	209	23,715	エネルギー
CME GROUP INC	78	93.5	1,766	200,423	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	88.44	98.94	323	36,745	エネルギー
ECOLAB INC	59	68.5	1,084	123,111	素材
EQUIFAX INC	27.5	31.5	323	36,743	資本財・サービス
GAP INC/THE	58	59.5	158	17,992	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	300	336	2,341	265,699	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	41.48	—	—	—	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	68.5	77.5	350	39,774	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
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

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
MAGNA INTERNATIONAL INC	84	87	572	48,869	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	11	20.37	198	16,921	生活必需品
BLACKBERRY LTD	119	135	157	13,492	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	142.5	158.5	769	65,772	金融
ENBRIDGE INC	381	488	2,144	183,205	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	207.5	220.5	1,296	110,769	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	460	529	1,151	98,372	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	71	87	274	23,453	ヘルスケア
GOLDCORP INC	199.59	233.59	292	24,961	素材
ENCANA CORP	231	258	238	20,385	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34	38	1,061	90,705	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	25	29	140	11,962	金融
GILDAN 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	9,665.33	10,989.17	45,333	3,872,423	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数＜比率＞	89銘柄	89銘柄		＜3.6%＞	
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)					
HEALTHSCOPE LTD	375	455	100	8,316	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	617	728	180	14,999	金融
BHP BILLITON LIMITED	747	847.5	2,625	218,131	素材
SOUTH32 LTD	1,207	1,341	421	34,982	素材
ALUMINA LTD	569	623	143	11,956	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	176	245	763	63,445	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	355	425	171	14,229	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	133	143	11,955	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	626	712.5	1,774	147,453	金融
WESTPAC BANKING CORP	788.48	902.48	2,384	198,091	金融

外国株式インデックスマザーファンド

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

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	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	330	375	2,004	29,083	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	550	650	3,152	45,742	一般消費財・サービス
MTR CORP	345	400	1,606	23,303	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	340	420	4,758	69,047	不動産
SINO LAND CO	740	900	1,215	17,629	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	631.69	706.69	5,759	83,570	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	280	320	681	9,890	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	125	1,079	15,661	不動産
FIRST PACIFIC CO	560	—	—	—	金融
CLP HOLDINGS LTD	380	435	3,821	55,449	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	279.24	359.16	1,440	20,897	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	210	210	448	6,505	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,912.56	2,481.81	3,871	56,177	公益事業
HANG SENG BANK LTD	179	204	3,674	53,310	金融
WHEELOCK & CO LTD	200	220	992	14,396	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,330	1,590	1,707	24,778	不動産
WH GROUP LTD	1,945	2,225	1,294	18,789	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	273	313	7,142	103,639	金融
MINTH GROUP LTD	—	180	490	7,117	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD	1,320	1,520	249	3,617	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	460	500	779	11,303	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	58	76	608	8,822	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	165	190	452	6,561	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	355	425	718	10,421	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	145	175	473	6,868	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	290.4	326.4	860	12,479	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	140	170	676	9,817	不動産
SJM HOLDINGS LTD	470	470	330	4,801	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	262	288	794	11,533	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	616.69	696.69	3,901	56,610	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	150	180	1,062	15,409	公益事業
PCCW LTD	950	1,170	530	7,690	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	2,812	3,212	20,685	300,143	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	280	330	1,582	22,959	不動産
SANDS CHINA LTD	572	644	2,192	31,817	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	300	334	4,857	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	355	1,512	21,943	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	236	311	4,527	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	875	960	2,908	42,206	金融
WYNN MACAU LTD	380	420	748	10,859	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計 株数、金額	21,726.58	24,758.75	86,853	1,260,243	
香港・ドル通貨計 銘柄数<比率>	39銘柄	39銘柄		<1.2%>	
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
UNITED OVERSEAS BANK LTD	313	359	901	74,721	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	415	473	1,143	94,802	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	136.7	131	10,934	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	345	395	242	20,136	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	132	140	87	7,229	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	104	90	7,499	不動産
CAPITALAND LTD	590	689	217	18,047	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	420	568	71	5,932	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
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	89,576.69	79,841.11	47,102	6,830,372	
	銘柄数<比率>	105銘柄	96銘柄		<6.3%>	
		百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)						
AZRIELI GROUP LTD		10	10	186	5,713	不動産
FRUTAROM		9	—	—	—	その他
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		483	483	206	6,325	コミュニケーション・サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD		140	176	382	11,708	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		6	6	273	8,353	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		245	266	678	20,755	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		334	410	1,001	30,637	金融
NICE LTD		14	16.5	706	21,609	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		30	30	202	6,201	金融
イスラエル・シュケル通貨計	株数、金額	1,271	1,397.5	3,637	111,304	
	銘柄数<比率>	9銘柄	8銘柄		<0.1%>	
		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)						
DUFRY AG-REG		8.5	8.5	92	10,523	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG		855	1,022.5	1,395	158,913	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2	2	108	12,346	素材
ADECCO GROUP AG-REG		39	42.5	210	23,971	資本財・サービス

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		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	千デンマーク・クローネ	千円	
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	1,218.6	1,133	39,180	678,209	
	銘柄数<比率>	18銘柄	17銘柄		<0.6%>	
		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)						
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	1,384.83	1,590.83	22,195	294,752	
	銘柄数<比率>	10銘柄	10銘柄		<0.3%>	
		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)						
ICA GRUPPEN AB		19	19	630	7,884	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS		710.3	811.3	6,156	77,013	情報技術
VOLVO AB-B SHS		366	421	5,346	66,887	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		15	18	954	11,945	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES		87.5	97.5	1,388	17,368	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		54.5	59.5	1,226	15,340	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB		708.5	—	—	—	その他
SWEDISH MATCH AB		41.5	46	1,645	20,584	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		89.5	137	1,565	19,580	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS		56	—	—	—	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		350.5	430.5	4,091	51,184	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		352	410.5	4,125	51,610	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		209	235	4,951	61,942	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		226	235.5	3,993	49,954	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS		76.5	91.5	1,322	16,546	資本財・サービス
SANDVIK AB		262.5	298.5	4,020	50,300	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		105.5	123	4,841	60,564	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		157	173.5	3,801	47,555	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		74	84.5	1,286	16,088	資本財・サービス
TELIA CO AB		600	770	3,237	40,505	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		70	77	1,493	18,677	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		91	103	2,086	26,105	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		233	268.5	4,528	56,648	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS		9	18	492	6,160	金融
LUNDIN PETROLEUM AB		42	46.5	1,111	13,902	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		141	157	3,658	45,762	生活必需品
BOLIDEN AB		65	70	1,417	17,732	素材
EPIROC AB-A		—	179.5	1,351	16,906	資本財・サービス
EPIROC AB-B		—	97	703	8,795	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		97.5	114.5	827	10,356	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP		—	794	6,485	81,132	金融
KINNEVIK AB - B		53	60.5	1,435	17,960	金融

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
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	5,464.3	6,562.3	84,197	1,053,312	
	銘柄数<比率>	31銘柄	32銘柄		<1.0%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（アイルランド）						
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	472.1	855.8	1,512	195,366	
	銘柄数<比率>	4銘柄	6銘柄		<0.2%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オランダ）						
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	4,592.86	4,974.26	12,589	1,626,472	
	銘柄数<比率>	27銘柄	23銘柄		<1.5%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）						
UCB SA		30	32.5	238	30,793	ヘルスケア
KBC GROUP NV		58	65	414	53,524	金融
COLRUYT SA		16	16	90	11,703	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		18.5	20	160	20,685	金融
SOLVAY SA		17	19.5	188	24,295	素材
UMICORE		45	54	204	26,481	素材

外国株式インデックスマザーファンド

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

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
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	6,174.86	7,107.65	30,332	3,918,679	
	銘柄数＜比率＞	65銘柄	68銘柄		＜3.6%＞	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）						
BAYER AG-REG		193.5	246.7	1,573	203,242	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		38	42.5	102	13,243	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		486.5	531.5	441	56,991	金融
COMMERZBANK AG		246.85	263.35	207	26,853	金融
VOLKSWAGEN AG		8	8.9	129	16,752	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		43	49.7	745	96,349	一般消費財・サービス
MAN SE		8.5	—	—	—	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG		179.5	202	2,066	266,965	資本財・サービス
E.ON SE		517	591	530	68,555	公益事業
UNIPER SE		—	53.5	123	15,972	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		78	86.5	630	81,409	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		42	45	108	13,987	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG		23.6	25.6	105	13,645	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		25.5	29.7	394	50,973	一般消費財・サービス
BASF SE		213.5	244.2	1,583	204,621	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
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	5,532.67	6,419.43	27,233	3,518,304	
国小計 銘柄数<比率>	57銘柄	63銘柄		<3.3%>	

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）						
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	671.5	836.5	434	56,118	
	銘柄数＜比率＞	3銘柄	3銘柄		＜0.1%＞	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）						
TELEFONICA SA		1,046.27	1,250.27	975	126,052	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		76.5	82.5	162	20,937	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,555.12	1,748.12	872	112,693	金融
IBERDROLA SA		1,357.34	1,621.34	1,070	138,286	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,229.09	1,449.09	162	21,042	金融
BANKINTER SA		151	183	135	17,528	金融
REPSOL SA		287	366.5	554	71,685	エネルギー
GRIFOLS SA		67	77.5	203	26,232	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		3,782.5	4,264.5	1,796	232,134	金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		158	—	—	—	資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA		101	117	749	96,767	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		84.5	90.5	196	25,359	公益事業
MAPFRE SA		254.5	254.5	64	8,298	金融
CAIXABANK SA		816	941	340	44,007	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		152	152	107	13,836	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		53.76	67.26	227	29,413	資本財・サービス
AENA SME SA		16	18.5	262	33,950	資本財・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		253	285	778	100,553	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		56	56	70	9,151	資本財・サービス
ENAGAS SA		54	59	142	18,346	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		100	115	217	28,161	公益事業
FERROVIAL SA		117	134	242	31,316	資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		157	—	—	—	生活必需品
BANKIA SA		241.05	301.05	87	11,313	金融
国小計	株数、金額	12,165.63	13,633.63	9,420	1,217,067	
	銘柄数＜比率＞	24銘柄	22銘柄		＜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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
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	12,386.89	13,910.49	5,798	749,129	
	銘柄数<比率>	19銘柄	19銘柄		<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	2,101.5	2,346.5	3,049	394,022	
	銘柄数<比率>	12銘柄	12銘柄		<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	180.5	193	679	87,848	
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<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	279.19	—	—	—	
	銘柄数<比率>	2銘柄	—		<—>	
ユーロ通貨計	株数、金額	45,373.4	51,199.56	94,924	12,263,329	
	銘柄数<比率>	233銘柄	236銘柄		<11.4%>	
ファンド合計	株数、金額	278,979.17	293,599.53	—	102,418,129	
	銘柄数<比率>	1,256銘柄	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	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.197	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 口数、金額	287,678	317,917	18,871	2,141,387
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	39銘柄	39銘柄		<2.0%>
	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1.5	1.5	46	4,010
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	3.7	78	6,706
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3.9	3.9	96	8,208
カナダ・ドル通貨計 口数、金額	8.4	9.1	221	18,925
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.0%>

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)					
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	口数、金額	610.701	659.205	3,766	312,919
	銘柄数<比率>	12銘柄	11銘柄		<0.3%>
		千口	千口	千香港・ドル	千円
(香港)					
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	口数、金額	203.5	220.5	5,900	85,623
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.1%>
		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)					
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	口数、金額	233.7	265.8	559	46,386
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>
		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)					
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	口数、金額	103.212	88.012	530	76,872
	銘柄数<比率>	5銘柄	4銘柄		<0.1%>
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ(フランス)					
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	口数、金額	10.35	12.28	1,021	132,018
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<0.1%>
合計	口数、金額	1,457.541	1,572.814	—	2,814,132
	銘柄数<比率>	71銘柄	69銘柄		<2.6%>

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

(3)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT（アメリカ）	2,428	—

（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
	千円	%
株式	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・シュケル＝30.60円、１スイス・フラン＝113.90円、１デンマーク・クローネ＝17.31円、１ノルウェー・クローネ＝13.28円、１スウェーデン・クローネ＝12.51円、１ユーロ＝129.19円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（106,744,284千円）の投資信託財産総額（107,731,273千円）に対する比率は、99.1％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年11月30日現在

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

＊期首における元本額は39,734,106,968円、当作成期間中における追加設定元本額は7,457,653,079円、同解約元本額は3,227,735,145円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスＶＡ507,485,808円、ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）14,096,372円、ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）197,649,153円、ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）25,055,668円、ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）627,330,937円、外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）812,920円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）550,738,616円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）1,489,095,675円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）529,688,114円、Ｄ－Ｉ'ｓ 外国株式インデックス5,542,491円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 197,868円、iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）723,449,418円、iFree 8資産バランス557,965,043円、iFree 年金バランス8,203,476円、ＤＣダイワ外国株式インデックス27,624,252,366円、ダイワ・ライフ・バランス３０ 569,101,264円、ダイワ・ライフ・バランス５０ 839,595,806円、ダイワ・ライフ・バランス７０ 676,868,528円、大和ＤＣ海外株式インデックスファンド1,489,592,147円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 4,144,667円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 13,247,986円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 4,228,403円、ダイワつみたてインデックス外国株式4,608,188円、ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ76,173円、ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ156,042円、ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ1,204,032円、ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ2,140,945円、ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ237,257,604円、ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ353,114,328円、ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ3,137,819,193円、ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）153,703,054円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式631,981,535円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド88,367,711円、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）453,744円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,746,321,380円、ダイワライフスタイル２５ 19,463,084円、ダイワライフスタイル５０ 70,173,613円、ダイワライフスタイル７５ 58,841,550円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は24,496円です。

外国株式インデックスマザーファンド

■損益の状況

当期　自 2017年12月 1 日　至 2018年11月30日

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

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

ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版）

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

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/

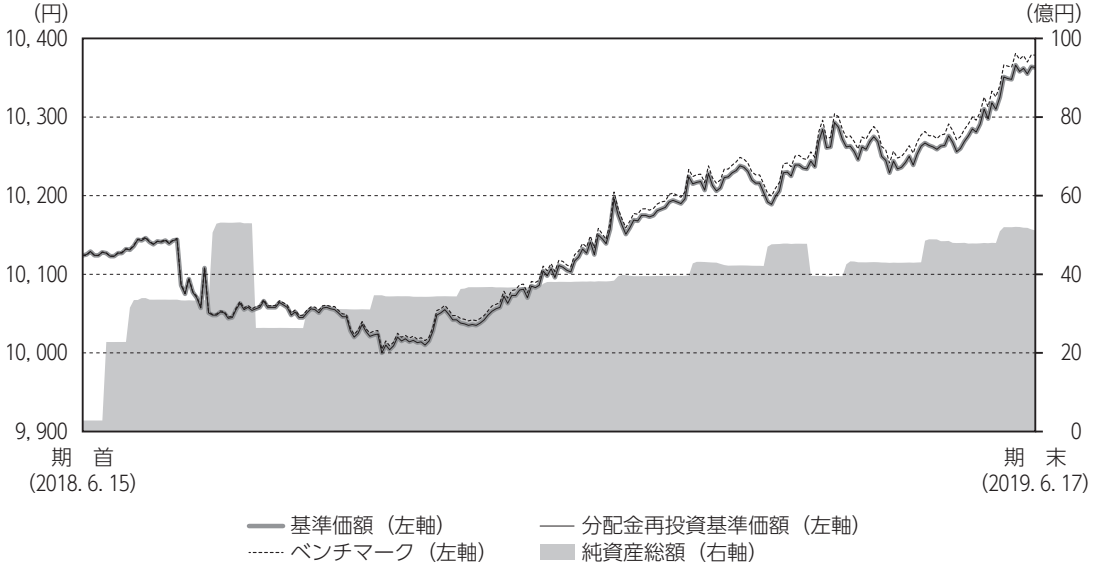
設定以来の運用実績

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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	10,065	0	0.7	521.587	0.7	99.4	—	24
2期末(2018年6月15日)	10,124	0	0.6	525.468	0.7	99.4	—	279
3期末(2019年6月17日)	10,363	0	2.4	538.684	2.5	99.4	—	5,116

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。
(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：10,124円
期　末：10,363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。

ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

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	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2018年６月15日	10,124	—	525.468	—	99.4	—
６月末	10,127	0.0	525.663	0.0	99.1	—
７月末	10,108	△ 0.2	524.694	△ 0.1	99.3	—
８月末	10,052	△ 0.7	521.874	△ 0.7	98.9	—
９月末	10,027	△ 1.0	520.614	△ 0.9	99.5	—
10月末	10,042	△ 0.8	521.502	△ 0.8	99.4	—
11月末	10,083	△ 0.4	523.683	△ 0.3	99.5	—
12月末	10,157	0.3	527.623	0.4	99.5	—
2019年１月末	10,196	0.7	529.658	0.8	99.5	—
２月末	10,216	0.9	530.781	1.0	99.4	—
３月末	10,287	1.6	534.623	1.7	99.4	—
４月末	10,253	1.3	532.961	1.4	99.5	—
５月末	10,318	1.9	536.316	2.1	99.2	—
(期末)2019年６月17日	10,363	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、ファンドの資金流出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

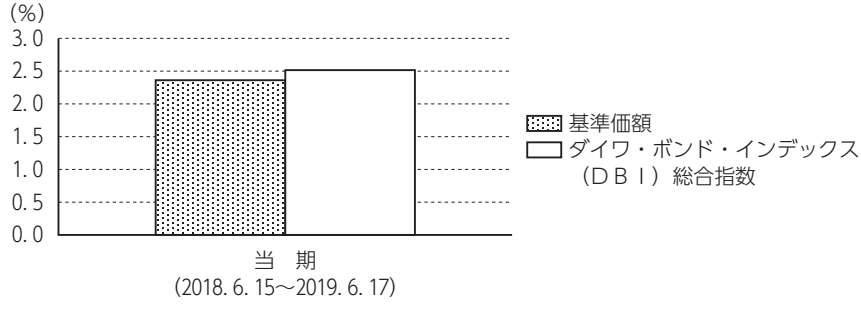
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流出入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

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やポートフォリオの利回り水準等を勘案し、収益分配は行いませんでした。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

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）	362

（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、ファンドの資金流出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. 147%	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, 150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）	(6)	(0. 054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 銀 行）	(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. 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. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合　　計	15	0. 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	6,207,153	8,713,213	2,849,873	3,992,640

（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					
区分	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	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4.6％

※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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	199,030	3,556,309	5,111,839

（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	5,111,839	98.5
コール・ローン等、その他	76,398	1.5
投資信託財産総額	5,188,238	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	**5,188,238,172円**
コール・ローン等	8,348,486
日本債券インデックスマザーファンド（評価額）	5,111,839,357
未収入金	68,050,329
(B)負債	**71,345,435**
未払解約金	68,074,795
未払信託報酬	3,152,833
その他未払費用	117,807
(C)純資産総額（A－B）	**5,116,892,737**
元本	4,937,687,762
次期繰越損益金	179,204,975
(D)受益権総口数	**4,937,687,762口**
１万口当り基準価額（C／D）	**10,363円**

＊期首における元本額は275,900,547円、当作成期間中における追加設定元本額は8,652,065,532円、同解約元本額は3,990,278,317円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,363円です。

ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

■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, 754円**
受取利息	747
支払利息	△ 3, 501
（B）有価証券売買損益	**109, 187, 024**
売買益	136, 405, 225
売買損	△ 27, 218, 201
（C）信託報酬等	△ **5, 788, 526**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**103, 395, 744**
（E）前期繰越損益金	**161, 404**
（F）追加信託差損益金	**75, 647, 827**
（配当等相当額）	(38, 788, 670)
（売買損益相当額）	(36, 859, 157)
（G）合計（D＋E＋F）	**179, 204, 975**
次期繰越損益金（G）	**179, 204, 975**
追加信託差損益金	75, 647, 827
（配当等相当額）	(38, 788, 670)
（売買損益相当額）	(36, 859, 157)
分配準備積立金	103, 557, 148

（注１）信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
（注２）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、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	30, 654, 502円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	72, 677, 761
（c）収益調整金	75, 647, 827
（d）分配準備積立金	224, 885
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	179, 204, 975
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	179, 204, 975
（h）受益権総口数	4, 937, 687, 762口

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「日本債券インデックスマザーファンド」の決算日（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200～208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（55,985,054千口）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						
区分	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	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）

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	
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
	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

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	
	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

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	
	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
	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

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	
	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
	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

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	
	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

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	
		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
		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

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	
		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
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	120,935	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	119,242	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	197,973	2036/07/31
種別小計	銘柄数	26銘柄				
	金額			2,800,000	2,942,906	

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	
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	1銘柄				
	金額			100,000	99,870	
普通社債券		9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,286	2020/07/24
		20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	102,865	2020/07/27
		15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	102,092	2020/08/21
		17 シテイグループ・インク	2.0400	100,000	102,359	2020/09/16
		72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	101,957	2020/12/22
		44 野村ホールデイング	0.7230	100,000	101,081	2021/02/25
		2 イオンFS	0.5720	100,000	100,826	2021/03/18
		9三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	103,071	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,460	2022/06/20
		11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	103,657	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	103,834	2022/08/25
		4 JXホールデイングス	1.1450	100,000	103,787	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	102,718	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	104,206	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,362	2023/12/20
		1 三菱UFJFG劣後	0.9400	100,000	103,208	2024/06/26
		5 野村不動産HD	0.9240	100,000	104,037	2025/05/30
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	103,346	2025/11/13
		4 フアーストリテイリング	0.7490	100,000	103,831	2025/12/18
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	100,214	2026/08/21
		17 パナソニツク	0.4700	100,000	101,959	2026/09/18
		509 関西電力	0.4700	100,000	101,358	2027/05/25
		12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	101,284	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	100,749	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,960	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	99,782	2028/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	119,489	2029/01/29
		18 エヌテイテイ都市開	1.0900	100,000	108,165	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	108,814	2029/12/12
		332 北海道電力	0.9070	100,000	104,587	2036/04/25
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	121,210	2045/01/27
種別小計	銘柄数	31銘柄				
	金額			3,100,000	3,220,570	
合計	銘柄数	354銘柄				
	金額			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）

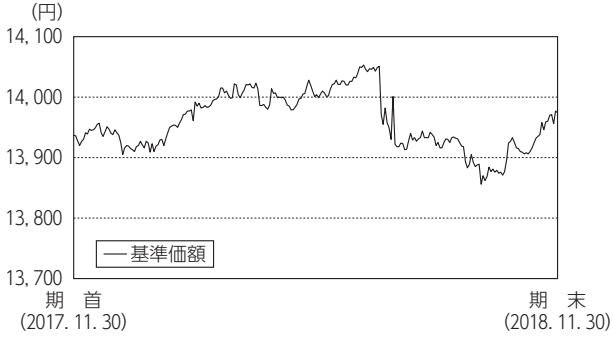
日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数(ベンチマーク)		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2017年11月30日	13,937	—	522.295	—	99.4	—
12月末	13,946	0.1	522.656	0.1	99.5	—
2018年1月末	13,923	△ 0.1	521.766	△ 0.1	99.5	—
2月末	13,977	0.3	523.788	0.3	99.5	—
3月末	13,998	0.4	524.618	0.4	99.4	—
4月末	13,987	0.4	524.225	0.4	99.7	—
5月末	14,019	0.6	525.397	0.6	99.2	—
6月末	14,026	0.6	525.663	0.6	99.2	—
7月末	14,001	0.5	524.694	0.5	99.4	—
8月末	13,925	△ 0.1	521.874	△ 0.1	99.0	—
9月末	13,892	△ 0.3	520.614	△ 0.3	99.6	—
10月末	13,916	△ 0.2	521.502	△ 0.2	99.5	—
(期末)2018年11月30日	13,974	0.3	523.683	0.3	99.6	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：13,937円　期末：13,974円　騰落率：0.3%
【基準価額の主な変動要因】
金利の上昇(債券価格は下落)はマイナス要因となりましたが、債券からの利息収入がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」
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、ファンドの資金流出入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

◆ポートフォリオについて
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流出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、ファンドの資金流出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。

日本債券インデックスマザーファンド

■１万口当りの費用の明細

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

（注１）費用の項目および算出法については前掲の「１万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
（注２）項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況
公　社　債

（2017年12月１日から2018年11月30日まで）

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	23,825,721	13,083,950 (—)
	地方債証券	692,825	761,442 (—)
	特殊債券	234,179	101,392 (—)
	社債券	1,127,317	1,011,646 (—)

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

■主要な売買銘柄
公　社　債

（2017年12月１日から2018年11月30日まで）

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

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

■組入資産明細表

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

作成期	当期末						
区分	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	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）

当期末					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	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
	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

日本債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
		%	千円	千円	
	129 5年国債	0.1000	1,020,000	1,026,579	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	221,357	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	206,314	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	55,250	2021/09/21
	130 5年国債	0.1000	880,000	886,186	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	103,746	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	230,000	237,912	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	70,490	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	69,621	2021/12/20
	131 5年国債	0.1000	920,000	926,992	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	181,510	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	134,405	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	149,844	2022/03/21
	132 5年国債	0.1000	580,000	584,645	2022/06/20
	324 10年国債	0.8000	410,000	423,427	2022/06/20
	133 5年国債	0.1000	550,000	554,719	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	320,877	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	200,000	215,410	2022/09/20
	134 5年国債	0.1000	510,000	514,666	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	31,000	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	466,834	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	48,330	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,618	2022/12/20
	135 5年国債	0.1000	950,000	959,015	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	360,874	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	104,810	2023/03/20
	136 5年国債	0.1000	700,000	706,874	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	520,900	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	98,948	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	141,341	2023/06/20
	137 5年国債	0.1000	80,000	80,790	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	638,854	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	377,497	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	98,700	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	310,000	321,085	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	192,752	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	148,009	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	726,068	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	60,837	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	134,650	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	122,844	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	800,000	830,992	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	94,517	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	140,952	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	780,000	806,816	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	197,275	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	284,691	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	306,924	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	135,123	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	82,644	2024/12/20

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

日本債券インデックスマザーファンド

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
			%	千円	千円	
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	118,832	2029/07/31
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	117,488	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	114,840	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	186,665	2036/07/31
種別小計	銘柄数	29銘柄				
	金額			3,100,000	3,227,508	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	98,303	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	98,303	
普通社債券		29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,193	2020/03/19
		260 北陸電力	2.3300	100,000	103,386	2020/05/25
		9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,282	2020/07/24
		20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	104,214	2020/07/27
		15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	103,016	2020/08/21
		17 シテイグループ・インク	2.0400	100,000	103,327	2020/09/16
		72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	102,548	2020/12/22
		44 野村ホールデイング	0.7230	100,000	101,318	2021/02/25
		2 イオン FS	0.5720	100,000	100,459	2021/03/18
		9三菱 UFJ 信託 BK 劣	1.6800	100,000	103,810	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,552	2022/06/20
		11三菱 UFJ 信託 BK	1.3600	100,000	104,310	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	104,149	2022/08/25
		4 JX ホールデイングス	1.1450	100,000	104,148	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	102,720	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	104,250	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,403	2023/12/20
		1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,423	2024/06/26
		5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	103,776	2025/05/30
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	103,016	2025/11/13
		4 フアーストリテイリング	0.7490	100,000	103,693	2025/12/18
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,504	2026/08/21
		17 パナソニツク	0.4700	100,000	101,133	2026/09/18
		509 関西電力	0.4700	100,000	100,585	2027/05/25
		12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	100,394	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	99,917	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,974	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,817	2028/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	118,447	2029/01/29
		18 エヌテイテイ都市開	1.0900	100,000	106,649	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	107,302	2029/12/12
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	110,940	2045/01/27
種別小計	銘柄数	32銘柄				
	金額			3,200,000	3,306,672	
合計	銘柄数	358銘柄				
	金額			72,854,000	78,137,032	

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	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。

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

運用報告書（全体版）

第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	純資産総額の10%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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/

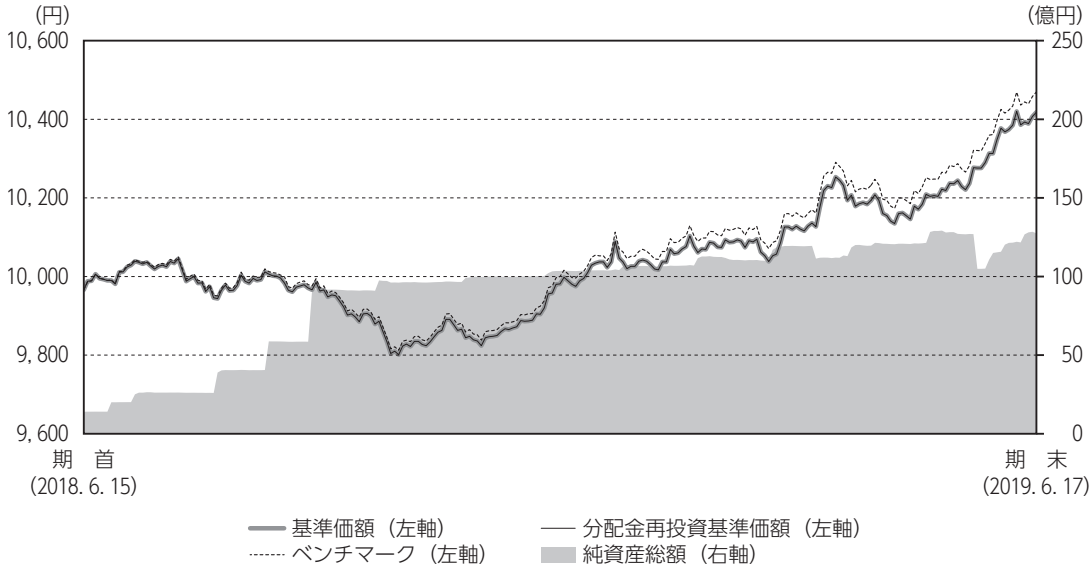
設定以来の運用実績

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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	10,212	0	2.1	10,230	2.3	93.8	4.0	20
2期末(2018年6月15日)	9,966	0	△ 2.4	10,037	△ 1.9	95.4	2.1	1,398
3期末(2019年6月17日)	10,418	0	4.5	10,544	5.1	97.3	1.4	12,750

（注１）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注２）FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
（注３）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注４）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注５）公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注６）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
（注７）債券先物比率は買建比率－売建比率です。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

＊分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
＊分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
＊ベンチマークは 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：　9,966円
期　末：10,418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	9,966	—	10,037	—	95.4	2.1
６月末	10,012	0.5	10,085	0.5	93.7	4.0
７月末	9,962	△ 0.0	10,039	0.0	95.2	1.0
８月末	9,973	0.1	10,053	0.2	95.0	0.3
９月末	9,906	△ 0.6	9,988	△ 0.5	97.7	1.4
10月末	9,877	△ 0.9	9,962	△ 0.8	93.8	1.2
11月末	9,905	△ 0.6	9,991	△ 0.5	97.0	0.7
12月末	10,037	0.7	10,130	0.9	94.3	—
2019年１月末	10,076	1.1	10,176	1.4	96.7	—
２月末	10,062	1.0	10,166	1.3	98.4	—
３月末	10,245	2.8	10,353	3.2	96.8	—
４月末	10,171	2.1	10,284	2.5	97.6	0.6
５月末	10,313	3.5	10,435	4.0	94.9	1.2
（期末）2019年６月17日	10,418	4.5	10,544	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

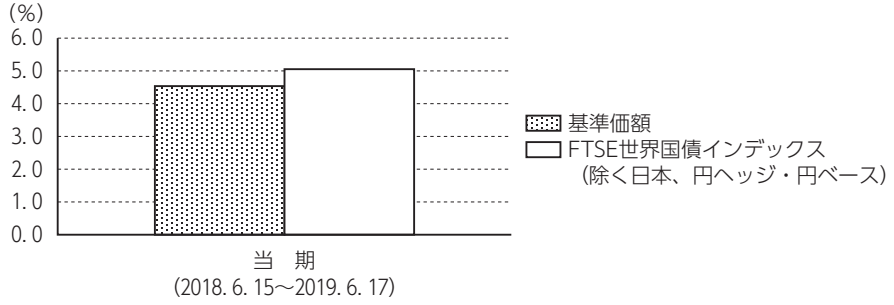
外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

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。

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。

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やポートフォリオの利回り水準等を勘案し、収益分配は行いませんでした。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

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)	588

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

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

外貨建資産については為替ヘッジを行い、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	41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10, 041円です。**
（投 信 会 社）	(28)	(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）	(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
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. 022	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(1)	(0. 013)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	44	0. 435	

（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
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	15,401,966	14,861,883	4,149,000	4,069,697

（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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	1,464,801	12,717,767	12,738,116

（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	%
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	12,738,116	98.9
コール・ローン等、その他	145,070	1.1
投資信託財産総額	12,883,186	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（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。

■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	**12,883,186,592円**
コール・ローン等	36,606,529
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（評価額）	12,738,116,315
未収入金	108,463,748
（B）負債	**133,106,671**
未払解約金	109,150,153
未払信託報酬	23,488,424
その他未払費用	468,094
（C）純資産総額（A－B）	**12,750,079,921**
元本	12,238,138,887
次期繰越損益金	511,941,034
（D）受益権総口数	**12,238,138,887口**
１万口当り基準価額（C／D）	**10,418円**

＊期首における元本額は1,403,467,254円、当作成期間中における追加設定元本額は14,932,722,296円、同解約元本額は4,098,050,663円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,418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	△ **9,367円**
受取利息	2,704
支払利息	△ 12,071
（B）有価証券売買損益	**462,780,109**
売買益	550,901,069
売買損	△ 88,120,960
（C）信託報酬等	△ **38,435,633**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**424,335,109**
（E）前期繰越損益金	△ **4,973,719**
（F）追加信託差損益金	**92,579,644**
（配当等相当額）	(301,349,129)
（売買損益相当額）	(△ 208,769,485)
（G）合計（D＋E＋F）	**511,941,034**
次期繰越損益金（G）	**511,941,034**
追加信託差損益金	92,579,644
（配当等相当額）	(301,349,129)
（売買損益相当額）	(△ 208,769,485)
分配準備積立金	419,361,390

（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	209,758,810円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	204,080,377
（ｃ）収益調整金	301,349,129
（ｄ）分配準備積立金	5,522,203
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	720,710,519
（ｆ）分配金	0
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	720,710,519
（ｈ）受益権総口数	12,238,138,887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）

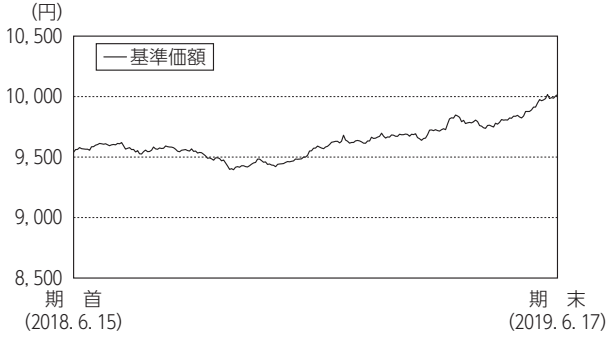
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★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ないます。
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



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	9,541	—	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）債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：9,541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、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」
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。

■１万口当りの費用の明細

項　　目	当　　期
売買委託手数料	0円
（先物・オプション）	(0)
有価証券取引税	—
その他費用	1
（保管費用）	(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
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 170,860	千アメリカ・ドル 52,969 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 4,182	千カナダ・ドル — (—)
	オーストラリア	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	千イギリス・ポンド 15,829	千イギリス・ポンド 6,082 (—)
	スイス	国債証券	千スイス・フラン —	千スイス・フラン 681 (—)
	デンマーク	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	千スウェーデン・クローネ 14,408	千スウェーデン・クローネ — (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 20,906	千メキシコ・ペソ 5,228 (—)
	マレーシア	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	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）	国債証券	千ユーロ 1,770	千ユーロ 502 (—)
	ユーロ（オランダ）	国債証券	千ユーロ 6,330	千ユーロ 3,256 (—)
	ユーロ（ベルギー）	国債証券	千ユーロ 5,747	千ユーロ 1,288 (—)
	ユーロ（フランス）	国債証券	千ユーロ 25,716	千ユーロ 10,591 (—)
	ユーロ（ドイツ）	国債証券	千ユーロ 18,230	千ユーロ 11,944 (—)
	ユーロ（スペイン）	国債証券	千ユーロ 16,761	千ユーロ 5,374 (—)
	ユーロ（イタリア）	国債証券	千ユーロ 22,321	千ユーロ 7,321 (—)
	ユーロ（フィンランド）	国債証券	千ユーロ 885	千ユーロ 291 (—)
	ユーロ（オーストリア）	国債証券	千ユーロ 2,999	千ユーロ — (—)
	ユーロ（ユーロ通貨計）	国債証券	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 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	債券先物取引	16,896	17,108	—	—

（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 買付 銘柄	金額	当期 売付 銘柄	金額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.875% 2020/6/30	2,188,263	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.5% 2019/10/31	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）

作成期 区分	当期末 額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率 5年以上	2年以上	2年未満
			千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 366,488	千アメリカ・ドル 381,573	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

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

作成期	当期末							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
ユーロ（ベルギー）	14,870	17,677	2,154,367	2.4	—	1.9	0.4	0.1
ユーロ（フランス）	57,480	69,733	8,498,374	9.5	—	6.3	2.5	0.7
ユーロ（ドイツ）	35,845	44,336	5,403,291	6.1	—	3.7	1.6	0.7
ユーロ（スペイン）	34,672	42,488	5,178,019	5.8	—	3.9	1.4	0.5
ユーロ（イタリア）	55,917	62,417	7,606,787	8.5	—	5.1	2.5	0.9
ユーロ（フィンランド）	3,300	3,713	452,575	0.5	—	0.3	0.2	—
ユーロ（オーストリア）	8,780	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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	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	32,370	32,672	3,550,140	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	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
	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

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,970	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	56銘柄						
通貨小計 金額				366,488	381,573	41,461,750	
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	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

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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
		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	19銘柄						
	金額				19,654	21,696	1,757,455	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,770	1,928	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
		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	19銘柄						
	金額				20,397	23,311	1,742,068	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	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	12銘柄						
	金額				3,642	3,817	302,610	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	750	812	111,062	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,160	1,622	221,812	2065/07/22

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	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	32銘柄						
通貨小計 金額				32,222	41,758	5,710,491	
				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	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	6銘柄						
通貨小計 金額				19,850	25,711	419,606	
				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,620	2,750	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

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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
		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
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,000	4,206	52,532	2028/04/26
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				13,650	14,251	177,997	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	2,780	3,008	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	7銘柄						
	金額				28,650	32,659	373,950	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	9,200	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	26,416	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	14銘柄						
	金額				98,630	99,114	561,981	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,760	1,855	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	10銘柄						
	金額				11,280	11,609	302,195	
					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	8,010	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	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	11銘柄						
	金額				61,020	56,787	417,390	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,200	1,350	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	11銘柄						
	金額				15,215	15,891	454,983	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（アイルランド）		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	688	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
		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	10銘柄						
	金額				4,748	5,520	672,752	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オランダ）		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

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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	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	17銘柄						
国小計 金額				11,700	14,283	1,740,789	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）	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	25銘柄						
国小計 金額				14,870	17,677	2,154,367	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フランス）	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

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	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
	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	33銘柄						
国小計 金額				57,480	69,733	8,498,374	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）	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

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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		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	34銘柄						
	金額				35,845	44,336	5,403,291	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（スペイン）		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,320	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
		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	30銘柄						
	金額				34,672	42,488	5,178,019	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,600	2,182	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

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	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	43銘柄						
国小計 金額				55,917	62,417	7,606,787	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	190	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

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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		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	11銘柄						
	金額				3,300	3,713	452,575	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	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
		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	16銘柄						
	金額				8,780	10,865	1,324,130	
通貨小計	銘柄数	219銘柄						
	金額				227,312	271,035	33,031,087	
合計	銘柄数	423銘柄						
	金額						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	当期末 売建額
		百万円	百万円
外国	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。

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版）

第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／債券／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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/

設定以来の運用実績

決　算　期	基　準　価　額			FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）		公社債組入比率	債　券先物比率	純資産総　額
	(分配落)	税込み分配金	期　中騰落率	(ベンチマーク)	期　中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	10,065	25	0.9	10,071	0.7	98.8	—	1
2期末(2018年6月15日)	10,028	120	0.8	10,251	1.8	98.6	—	1
3期末(2019年6月17日)	10,184	100	2.6	10,530	2.7	98.5	—	11

(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：10,028円
期　末：10,184円（分配金100円）
騰落率：2.6%（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	10,028	—	10,251	—	98.6	—
6月末	10,055	0.3	10,261	0.1	98.2	—
7月末	10,126	1.0	10,352	1.0	98.1	—
8月末	10,116	0.9	10,371	1.2	98.0	—
9月末	10,281	2.5	10,507	2.5	97.8	—
10月末	10,091	0.6	10,295	0.4	98.1	—
11月末	10,179	1.5	10,404	1.5	98.3	—
12月末	10,111	0.8	10,313	0.6	98.5	—
2019年1月末	10,045	0.2	10,321	0.7	98.1	—
2月末	10,182	1.5	10,441	1.9	98.2	—
3月末	10,315	2.9	10,538	2.8	98.3	—
4月末	10,283	2.5	10,518	2.6	98.3	—
5月末	10,201	1.7	10,507	2.5	97.1	—
(期末)2019年6月17日	10,284	2.6	10,530	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、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。

■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、ＦＲＢ（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

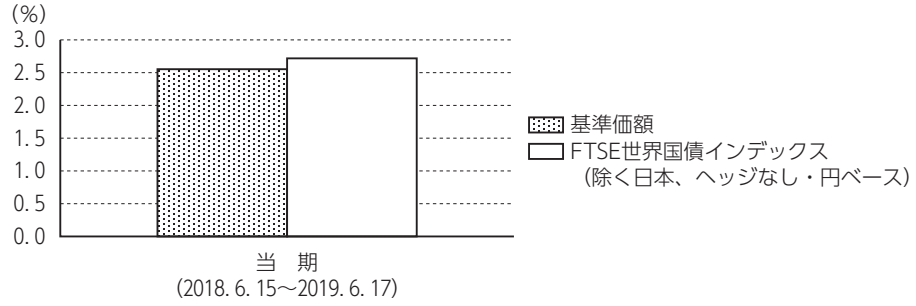
ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

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. 6%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. 05%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

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

当作成期の１万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（１万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項目			当期 2018年６月16日 ～2019年６月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**100**
	対基準価額比率	（%）	0.97
	当期の収益	（円）	30
	当期の収益以外	（円）	70
翌期繰越分配対象額		（円）	183

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

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

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

■収益分配金の計算過程（１万口当り）

項目		当期
（ａ）経費控除後の配当等収益	✓	74.05円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益		17.79
（ｃ）収益調整金	✓	191.47
（ｄ）分配準備積立金		0.18
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		283.50
（ｆ）分配金		100.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		183.50

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項　　目	当　期 (2018. 6. 16～2019. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	42円	0. 412%	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, 153円です。**
（投 信 会 社）	(29)	(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）	(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
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	3	0. 034	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）	(3)	(0. 026)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 009)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合　　計	45	0. 447	

（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
外国債券インデックスマザーファンド	30,999	84,999	27,433	76,128

（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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	369	3,934	10,992

（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	%
外国債券インデックスマザーファンド	10,992	97.7
コール・ローン等、その他	260	2.3
投資信託財産総額	11,252	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
(A)資産	**11,252,851円**
コール・ローン等	260,831
外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	10,992,020
(B)負債	**250,676**
未払収益分配金	108,039
未払信託報酬	139,911
その他未払費用	2,726
(C)純資産総額（A－B）	**11,002,175**
元本	10,803,922
次期繰越損益金	198,253
(D)受益権総口数	**10,803,922口**
１万口当り基準価額（C／D）	**10,184円**

＊期首における元本額は1,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は83,995,237円、同解約元本額は74,191,315円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,184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)有価証券売買損益	**332,045円**
売買益	1,119,117
売買損	△ 787,072
(B)信託報酬等	△ **232,654**
(C)当期損益金（A＋B）	**99,391**
(D)前期繰越損益金	**37**
(E)追加信託差損益金	**206,864**
(配当等相当額)	(206,205)
(売買損益相当額)	(659)
(F)合計（C＋D＋E）	**306,292**
(G)収益分配金	△ **108,039**
次期繰越損益金（F＋G）	**198,253**
追加信託差損益金	131,237
(配当等相当額)	(130,578)
(売買損益相当額)	(659)
分配準備積立金	67,016

(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	80,004円
(ｂ) 経費控除後の有価証券売買等損益	19,222
(ｃ) 収益調整金	206,864
(ｄ) 分配準備積立金	202
(ｅ) 当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	306,292
(ｆ) 分配金	108,039
(ｇ) 翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	198,253
(ｈ) 受益権総口数	10,803,922口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１　万　口　当　り　分　配　金	100円

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

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（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257～275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（62,737,394千口）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期	2019年６月17日現在							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	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
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	37,208	41,013	3,322,082	1.9	—	0.9	0.5	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	40,609	46,401	3,467,590	2.0	—	1.3	0.4	0.2
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	8,333	8,742	692,961	0.4	—	0.2	0.1	0.1
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	63,168	81,416	11,133,679	6.4	—	4.9	0.8	0.6
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ						
デンマーク	40,671	53,887	879,448	0.5	—	0.4	0.1	0.0
	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ						
ノルウェー	32,082	33,445	417,736	0.2	—	0.1	0.1	0.1
	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ						
スウェーデン	46,615	53,287	610,139	0.3	—	0.2	0.1	0.1
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ						
メキシコ	249,388	252,178	1,429,851	0.8	—	0.5	0.2	0.1
	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット						
マレーシア	29,529	30,283	788,287	0.4	—	0.3	0.1	0.0

作成期		2019年6月17日現在							
区分		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
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	千円 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

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	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

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	2.2500	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
	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

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	1.3750	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
	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

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	2.2500	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

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	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
		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	
					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	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

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	
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
		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	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	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	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	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
		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

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	2.6250	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	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,312	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	

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	
				%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
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	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	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	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	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	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	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	

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	
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
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	1,200	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	
					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	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
		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

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	
				%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	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	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	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	
					千ユーロ	千ユーロ		
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	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オランダ）		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	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

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	
		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	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,490	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
		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	2057/06/22
		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	

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	
ユーロ（フランス）		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	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,284	156,564	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,367	2,141	260,953	2027/07/04

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	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
		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	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（スペイン）		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,352	3,589	437,424	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,908	232,589	2025/04/30

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	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
		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	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,462	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

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	
	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

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	
		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
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,140	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	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）		Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	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	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	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

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	
		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）

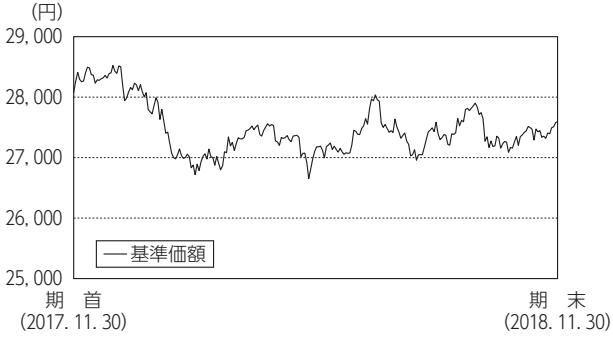
外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★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



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)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。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：28,075円　期末：27,598円　騰落率：△1.7%
【基準価額の主な変動要因】
日本を除く先進国国債に主に投資した結果、債券市場で金利が上昇(債券価格は下落)したことや、ユーロなどの対円為替レートの下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

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

《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	7
（保管費用）	(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
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 183,853	千アメリカ・ドル 118,101 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 9,423	千カナダ・ドル 9,529 (—)
	オーストラリア	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	千イギリス・ポンド 8,326	千イギリス・ポンド 6,837 (—)
	スイス	国債証券	千スイス・フラン —	千スイス・フラン 2,536 (—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 4,310	千デンマーク・クローネ 6,010 (—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,276	千ノルウェー・クローネ 8,171 (—)
	スウェーデン	国債証券	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	国債証券	千メキシコ・ペソ 43,524	千メキシコ・ペソ 22,262 (—)
	マレーシア	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	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）	国債証券	千ユーロ 1,491	千ユーロ 1,649 (—)
	ユーロ（オランダ）	国債証券	千ユーロ 2,458	千ユーロ 2,700 (—)
	ユーロ（ベルギー）	国債証券	千ユーロ 3,735	千ユーロ 3,496 (—)
	ユーロ（フランス）	国債証券	千ユーロ 20,559	千ユーロ 14,751 (—)
	ユーロ（ドイツ）	国債証券	千ユーロ 11,984	千ユーロ 11,891 (—)
	ユーロ（スペイン）	国債証券	千ユーロ 16,350	千ユーロ 10,981 (—)
	ユーロ（イタリア）	国債証券	千ユーロ 16,110	千ユーロ 14,050 (—)
	ユーロ（フィンランド）	国債証券	千ユーロ 1,362	千ユーロ 434 (—)
	ユーロ（オーストリア）	国債証券	千ユーロ 2,184	千ユーロ 2,322 (—)
	ユーロ（ユーロ通貨計）	国債証券	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。

外国債券インデックスマザーファンド

■主要な売買銘柄
公　社　債

（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。

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

作成期		当期末							
区分		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
		千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
ユーロ	アイルランド	8,673	9,523	1,230,284	0.7	—	0.5	0.1	0.1
	オランダ	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
	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
	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	当期末						償還年月日
	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,044	458,909	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,322	490,449	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,103	352,180	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,845	322,868	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,492	509,753	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,146	470,505	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,570	291,621	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,487	282,253	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,102	238,611	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,141	356,509	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,370	268,994	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,433	276,085	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	872	99,002	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,022	342,944	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,329	150,885	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,861	211,226	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,344	152,552	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,201	476,703	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,931	219,137	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,134	128,771	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,466	506,770	2023/05/15

外国債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	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

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

外国債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,262	4,029	457,233	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,897	328,792	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,005	227,534	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,029	4,578	519,505	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,367	268,660	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	1,963	222,845	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	2,910	330,267	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,605	295,692	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,369	268,847	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,395	271,840	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,808	318,654	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,035	571,342	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	2,800	317,748	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,534	401,009	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,538	401,534	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,584	293,239	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,240	254,242	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,335	265,055	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,902	329,370	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,115	580,442	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,867	325,357	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,357	267,451	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,350	3,073	348,733	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,377	156,281	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,403	272,693	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,325	263,858	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,440	1,419	161,117	2019/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,951	221,389	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,425	275,275	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,477	167,617	2020/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,340	5,049	572,979	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,922	331,564	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,405	273,005	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	3,333	378,208	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,094	237,676	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,919	331,322	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,214	251,314	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,871	212,400	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,550	2,453	278,451	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,811	318,983	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	835	94,787	2020/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,435	616,710	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	3,287	373,066	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	2,905	329,717	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,865	325,169	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	3,926	445,560	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,891	328,042	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,909	216,621	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,700	2,647	300,370	2020/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,888	327,777	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,290	259,858	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,000	1,958	222,249	2020/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,554	630,295	2027/08/15

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

外国債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	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	
					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	425	468	40,035	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	555	47,415	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,294	110,551	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,593	136,153	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,540	131,609	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,732	147,996	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,876	1,913	163,441	2020/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	979	83,706	2021/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,781	152,135	2022/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	1,892	161,646	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,213	103,692	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,422	121,538	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,197	1,281	109,466	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,154	98,640	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,706	145,744	2020/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,831	1,786	152,609	2020/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,068	91,264	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,197	102,317	2021/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,480	1,422	121,515	2021/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,116	95,378	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	794	67,878	2022/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,338	114,327	2022/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	500	496	42,404	2019/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,168	99,844	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,568	134,006	2023/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,600	1,584	135,362	2020/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	696	59,474	2020/05/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	593	50,706	2023/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	272	23,235	2051/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	300	297	25,449	2020/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	298	25,466	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,200	2,192	187,256	2020/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	600	600	51,267	2024/03/01
通貨小計	銘柄数	33銘柄						
	金額				37,327	39,025	3,333,538	

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,634	218,868	2021/05/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,489	206,862	2020/04/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,434	202,265	2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,351	195,359	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,021	251,027	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,526	209,933	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,074	2,195	182,363	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,517	209,179	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,358	1,637	136,013	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,189	264,957	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,240	103,048	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	547	45,459	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,184	181,472	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	712	738	61,319	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,522	2,557	212,500	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,078	2,017	167,574	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,132	1,105	91,835	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,795	149,198	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,227	185,099	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	750	752	62,504	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,517	126,111	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	600	591	49,133	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	290	275	22,868	2041/05/21
通貨小計	銘柄数	23銘柄						
	金額				40,248	42,548	3,534,959	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	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	19銘柄						
	金額				7,643	7,826	648,755	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,327	337,466	2020/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,821	1,934	280,567	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,517	365,012	2021/01/22

外国債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	2.5000	1,582	1,871	271,410	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,505	218,292	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,300	1,285	186,407	2022/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,210	1,077	156,178	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800	782	113,537	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,330	1,264	183,432	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,110	2,112	306,396	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	1,500	1,488	215,861	2023/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,200	1,231	178,565	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	930	844	122,452	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	200	200	29,006	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	70	65	9,552	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,302	188,827	2021/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,368	198,467	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,772	256,960	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,827	265,012	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,766	401,238	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,154	312,440	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,811	262,622	2020/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,744	398,041	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,082	447,051	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,552	225,171	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,596	2,367	343,242	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,480	2,015	292,262	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,316	335,935	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,743	252,774	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,524	221,133	2022/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,620	2,238	324,583	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	1,980	287,130	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	1,889	274,041	2020/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,227	323,034	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	803	868	125,954	2021/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	1,945	282,179	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,317	336,114	2022/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,966	2,445	354,651	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,063	299,210	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,441	354,025	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,392	1,529	221,786	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	2,760	400,370	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	42銘柄						
	金額				62,282	75,569	10,958,405	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	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	

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,436	98,759	2021/05/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,204	5,333	70,833	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,403	58,476	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,422	45,457	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,300	43,824	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,449	45,808	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,400	2,436	32,362	2028/04/26
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				28,882	29,783	395,522	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	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	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.0000	21,447	20,719	116,238	2019/12/11
		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	13,290	10,965	61,514	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	7,000	5,847	32,803	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	9,615	53,944	2021/12/09
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	13,133	12,654	70,989	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	23,149	129,868	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	22,668	20,513	115,081	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,141	51,283	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	8,398	47,114	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	8,687	48,734	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	18,822	105,593	2020/06/11
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	26,534	148,855	2021/06/10
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	11,428	64,113	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	24,599	22,906	128,503	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	18,654	15,315	85,918	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	5,927	33,253	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				247,035	230,626	1,293,812	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	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

外国債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	586	567	15,374	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	659	17,886	2020/07/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	598	16,217	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,064	28,850	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	865	23,460	2021/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	730	19,810	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	701	19,017	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,159	31,436	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	775	21,031	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	697	18,919	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	901	24,441	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	638	17,303	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	351	9,522	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	502	13,612	2022/03/10
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	751	20,369	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	590	576	15,631	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050	1,049	28,439	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,188	32,211	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	500	497	13,490	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	700	707	19,184	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	400	406	11,018	2038/06/08
通貨小計	銘柄数	33銘柄						
	金額				27,913	27,722	751,557	
					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	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	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,203	36,260	2021/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,225	2,388	72,000	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,749	52,741	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,668	80,436	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				31,265	32,086	967,089	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（アイルランド）		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	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	14銘柄						
	金額				8,673	9,523	1,230,284	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オランダ）		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	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	19銘柄						
	金額				22,798	26,808	3,463,419	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,446	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

外国債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	490	495	63,988	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,421	183,580	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	650	662	85,537	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	460	489	63,220	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	298	38,568	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	940	943	121,917	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	550	553	71,495	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,449	316,447	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,627	339,459	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	1,004	129,827	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,873	242,047	2020/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,511	324,476	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,638	211,714	2021/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,297	167,602	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,544	199,581	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	926	119,690	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,484	191,728	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,081	139,733	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,712	221,293	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	741	95,804	2034/06/22
国小計	銘柄数	26銘柄						
	金額				26,571	31,303	4,044,133	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フランス）		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,362	176,040	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	4,223	545,595	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,023	4,491	580,285	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,558	588,968	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,209	3,414	441,075	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,364	2,194	283,558	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,558	459,733	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,624	3,874	500,522	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,489	579,992	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,084	4,926	636,399	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,573	461,678	2020/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	1,923	248,485	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,893	503,036	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,294	425,647	2020/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	3,929	507,646	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	4,043	522,355	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,199	3,824	494,033	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	2,957	382,138	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,238	3,064	395,887	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,634	469,498	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,465	447,729	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,299	426,284	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,399	3,736	482,778	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,346	303,170	2019/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,292	3,361	434,271	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,070	3,096	400,095	2020/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,601	2,735	353,419	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,227	287,790	2020/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,920	4,186	540,851	2031/05/25

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,773	358,292	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,269	2,266	292,865	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	887	857	110,838	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,770	2,801	361,943	2021/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,800	2,766	357,445	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,021	261,098	2022/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,120	1,196	154,623	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	705	91,111	2020/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,607	336,798	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,950	2,109	272,517	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,415	312,058	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,100	4,147	535,817	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	313,271	2021/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	950	966	124,823	2034/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,100	1,106	142,948	2028/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,098	141,921	2024/03/25
国小計	銘柄数	45銘柄						
	金額				113,965	131,955	17,047,346	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,298	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

外国債券インデックスマザーファンド

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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,362	305,239	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,499	2,237	289,081	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,297	296,823	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,338	302,174	2024/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,939	250,605	2020/01/31
国小計	銘柄数	40銘柄						
	金額				66,328	76,226	9,847,645	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,446	186,831	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,447	187,062	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,022	390,422	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,806	233,359	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,454	187,958	2019/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,323	171,039	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,604	207,249	2022/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,568	202,680	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,452	187,635	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,512	195,442	2020/05/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,515	195,747	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,475	190,666	2022/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	770	99,593	2020/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,213	156,772	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,248	290,502	2023/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,184	153,028	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
		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

外国債券インデックスマザーファンド

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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Austria Government Bond	国債証券	—	900	905	116,991	2023/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	580	581	75,185	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	340	381	49,263	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	404	52,223	2022/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,000	1,017	131,406	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,230	158,995	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,339	173,024	2020/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,486	192,029	2021/09/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,610	208,054	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,165	150,555	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	906	117,048	2022/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,000	129,259	2022/11/22
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	546	70,610	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	872	112,710	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,047	135,308	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	743	96,031	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,020	131,801	2024/10/21
国小計	銘柄数	21銘柄						
	金額				16,583	19,236	2,485,214	
通貨小計	銘柄数	299銘柄						
	金額				448,167	506,874	65,483,117	
合計	銘柄数	761銘柄						
	金額						166,684,616	

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

■投資信託財産の構成

2018年11月30日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	166,684,616	98.1
コール・ローン等、その他	3,182,003	1.9
投資信託財産総額	169,866,619	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。
（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝113.47円、1カナダ・ドル＝85.42円、1オーストラリア・ドル＝83.08円、1シンガポール・ドル＝82.89円、1イギリス・ポンド　＝145.01円、1デンマーク・クローネ＝17.31円、1ノルウェー・クローネ＝13.28円、1スウェーデン・クローネ＝12.51円、1メキシコ・ペソ＝5.61円、1マレーシア・リンギット＝27.11円、1南アフリカ・ランド＝8.30円、1ポーランド・ズロチ＝30.14円、1ユーロ＝129.19円です。
（注3）当期末における外貨建純資産（168,411,756千円）の投資信託財産総額（169,866,619千円）に対する比率は、99.1%です。

外国債券インデックスマザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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ＶＡ694,267,908円、ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（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５０ＶＡ（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３０ＶＡ（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５０ＶＡ（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－Ｉ'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４０ＶＡ249,101,467円、ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ154,628,203円、ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ5,694,073,062円、ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ17,320,918円、ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ8,186,659円、ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（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J－REITインデックス（ダイワSMA専用）

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。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券	
	ダイワJ－REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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/

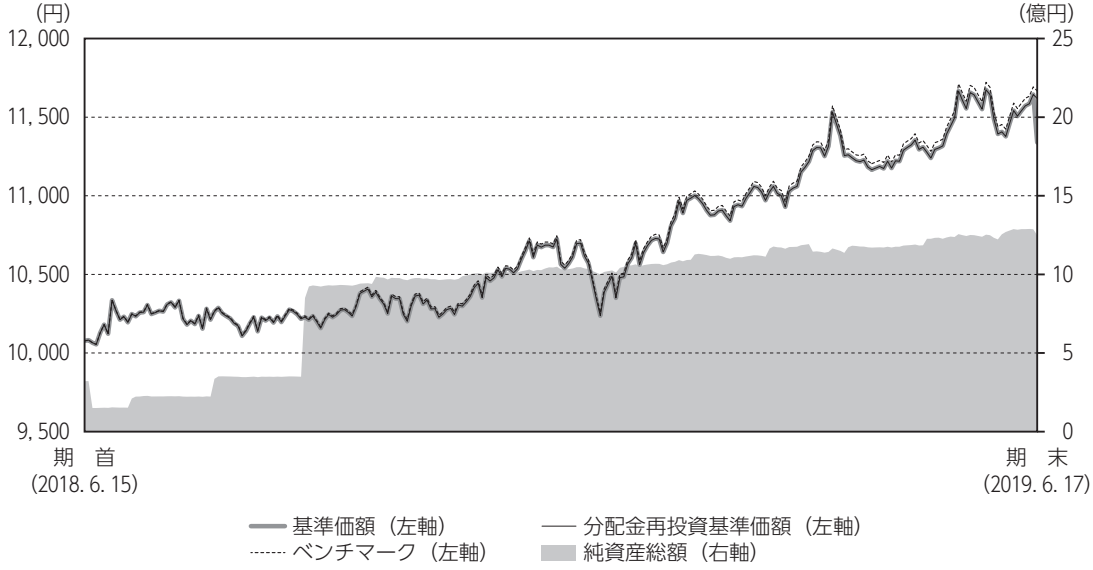
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	9,782	50	△ 1.7	3,274.94	△ 1.6	98.8	1.4	3
2期末（2018年6月15日）	10,077	45	3.5	3,398.25	3.8	98.7	1.5	321
3期末（2019年6月17日）	11,339	280	15.3	3,934.65	15.8	100.8	1.4	1,249

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注3）投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注4）不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：10,077円
期　末：11,339円（分配金280円）
騰落率：15.3%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、国内リート市況が上昇したことを反映して、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

年　月　日	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2018年６月15日	10,077	—	3,398.25	—	98.7	1.5
６月末	10,231	1.5	3,450.92	1.5	97.9	1.5
７月末	10,281	2.0	3,468.88	2.1	97.4	1.5
８月末	10,246	1.7	3,457.71	1.7	97.9	1.5
９月末	10,407	3.3	3,513.39	3.4	98.2	1.4
10月末	10,245	1.7	3,459.73	1.8	97.9	1.4
11月末	10,687	6.1	3,610.49	6.2	98.2	1.5
12月末	10,487	4.1	3,543.83	4.3	98.3	1.4
2019年１月末	10,971	8.9	3,709.11	9.1	97.9	1.4
２月末	11,024	9.4	3,728.00	9.7	97.7	1.5
３月末	11,382	13.0	3,851.10	13.3	98.1	1.5
４月末	11,295	12.1	3,822.76	12.5	98.3	1.4
５月末	11,488	14.0	3,889.57	14.5	98.5	1.4
（期末）2019年６月17日	11,619	15.3	3,934.65	15.8	100.8	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。なお、当作成期末のリート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）は102. 4%となっておりますが、翌営業日計上のマザー解約金額を考慮したリート実質組入比率は100%程度となっております。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

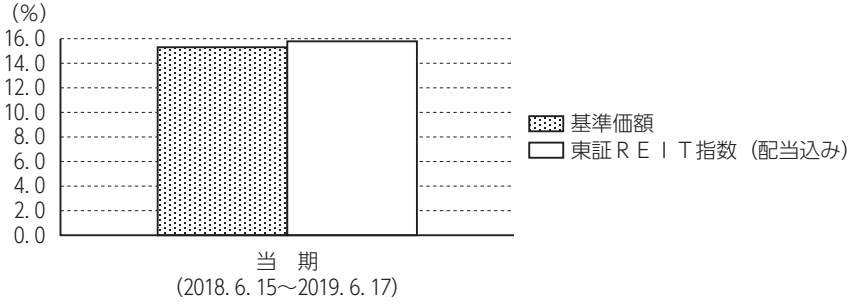
ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度としました。

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

当作成期の１万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（１万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項目			当期 2018年６月16日 ～2019年６月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**280**
	対基準価額比率	（％）	2.41
	当期の収益	（円）	280
	当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額		（円）	1,338

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

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

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

■収益分配金の計算過程（１万口当り）

項目		当期
（ａ）経費控除後の配当等収益	✓	289.24円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益		932.05
（ｃ）収益調整金		396.98
（ｄ）分配準備積立金		0.40
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		1,618.69
（ｆ）分配金		280.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		1,338.69

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項　　目	当　期 (2018. 6. 16～2019. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	36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10, 695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)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
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. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	37	0. 343	

（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Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド	430,086	1,123,887	119,329	314,730

（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					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	55,278	4,049	7.3	14,705	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0.4%

※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）	8千円
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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	127,599	438,357	1,279,520

（注）単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

■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	1,279,520	98.8
コール・ローン等、その他	15,442	1.2
投資信託財産総額	1,294,963	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	**1,294,963,369円**
コール・ローン等	2,527,643
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（評価額）	1,279,520,626
未収入金	12,915,100
(B)負債	**45,657,340**
未払収益分配金	30,850,622
未払解約金	12,859,708
未払信託報酬	1,915,883
その他未払費用	31,127
(C)純資産総額（A－B）	**1,249,306,029**
元本	1,101,807,931
次期繰越損益金	147,498,098
(D)受益権総口数	**1,101,807,931口**
１万口当り基準価額（C／D）	**11,339円**

＊期首における元本額は318,605,408円、当作成期間中における追加設定元本額は1,083,924,855円、同解約元本額は300,722,332円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は11,339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	△ **1,315円**
受取利息	110
支払利息	△ 1,425
(B)有価証券売買損益	**137,664,455**
売買益	148,310,476
売買損	△ 10,646,021
(C)信託報酬等	△ **3,098,943**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	**134,564,197**
(E)前期繰越損益金	**44,158**
(F)追加信託差損益金	**43,740,365**
(配当等相当額)	(584,505)
(売買損益相当額)	(43,155,860)
(G)合計（D＋E＋F）	**178,348,720**
(H)収益分配金	△ **30,850,622**
次期繰越損益金（G＋H）	**147,498,098**
追加信託差損益金	43,740,365
(配当等相当額)	(584,505)
(売買損益相当額)	(43,155,860)
分配準備積立金	103,757,733

（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	31,869,586円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	102,694,611
(c) 収益調整金	43,740,365
(d) 分配準備積立金	44,158
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	178,348,720
(f) 分配金	30,850,622
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	147,498,098
(h) 受益権総口数	1,101,807,931口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１　万　口　当　り　分　配　金	280円

分配金の課税上の取扱いについて

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

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（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309～310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	日本リテールファンド	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
日本リテールファンド	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		
	口数	評価額	比率
不動産投信	千口	千円	%
エスコンジャパンリート	2.915	309,573	0.1
サンケイリアルエステート	2.807	306,805	0.1
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
ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	32	3,318,400	1.2
森ヒルズリート	32.567	4,972,980	1.8
産業ファンド	34.851	4,656,093	1.7
アドバンス・レジデンス	27.675	8,703,787	3.1
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
ＡＰＩ投資法人	14.918	7,078,591	2.5
ＧＬＰ投資法人	70.365	8,570,457	3.1
コンフォリア・レジデンシャル	11.776	3,591,680	1.3
日本プロロジスリート	38.09	9,236,825	3.3
星野リゾート・リート	4.321	2,350,624	0.8
Ｏｎｅリート投資法人	4.139	1,152,297	0.4

ファンド名	2019年６月17日現在		
	口数	評価額	比率
	千口	千円	%
イオンリート投資	29.148	3,987,446	1.4
ヒューリックリート投資法	22.955	4,221,424	1.5
日本リート投資法人	9.166	3,941,380	1.4
インベスコ・オフィス・Ｊリート	173.075	3,028,812	1.1
日本ヘルスケア投資法	1.3	226,590	0.1
積水ハウス・リート投資	83.033	6,626,033	2.4
トーセイ・リート投資法人	5.466	641,708	0.2
ケネディクス商業リート	10.408	2,761,242	1.0
ヘルスケア＆メディカル投資	5.948	728,630	0.3
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
いちごホテルリート投資	4.966	634,654	0.2
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

ファンド名		2019年６月17日現在		
		口　数	評価額	比　率
		千口	千円	%
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
日本ビルファンド		27. 499	20, 871, 741	7. 5
ジャパンリアルエステイト		28. 397	18, 656, 829	6. 7
日本リテールファンド		53. 669	11, 705, 208	4. 2
オリックス不動産投資		56. 58	11, 191, 524	4. 0
日本プライムリアルティ		17. 975	8, 708, 887	3. 1
プレミア投資法人		26. 998	3, 679, 827	1. 3
東急リアル・エステート		19. 039	3, 567, 908	1. 3
グローバル・ワン不動産投資法人		19. 644	2, 624, 438	0. 9
ユナイテッド・アーバン投資法人		62. 629	11, 285, 745	4. 0
森トラスト総合リート		20. 295	3, 559, 743	1. 3
インヴィンシブル投資法人		97. 966	5, 819, 180	2. 1
フロンティア不動産投資		9. 66	4, 578, 840	1. 6
平和不動産リート		17. 684	2, 233, 489	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
福岡リート投資法人		14. 686	2, 571, 518	0. 9
ケネディクス・オフィス投資法人		8. 784	6, 746, 112	2. 4
いちごオフィスリート投資法人		23. 559	2, 391, 238	0. 9
大和証券オフィス投資法人		6. 554	5, 079, 350	1. 8
阪急阪神リート投資法人		12. 777	1, 899, 939	0. 7
スターツプロシード投資法人		4. 44	774, 336	0. 3
大和ハウスリート投資法人		38. 101	9, 765, 286	3. 5
ジャパン・ホテル・リート投資法人		91. 405	7, 952, 235	2. 9
日本賃貸住宅投資法人		31. 94	2, 676, 572	1. 0
ジャパンエクセレント投資法人		25. 428	4, 101, 536	1. 5
合　計	口　数、　金　額	1, 583. 881	274, 642, 114	
	銘柄数＜比率＞	63 銘柄		<98. 4%>

（注１）比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
（注２）評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘　柄　別		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）

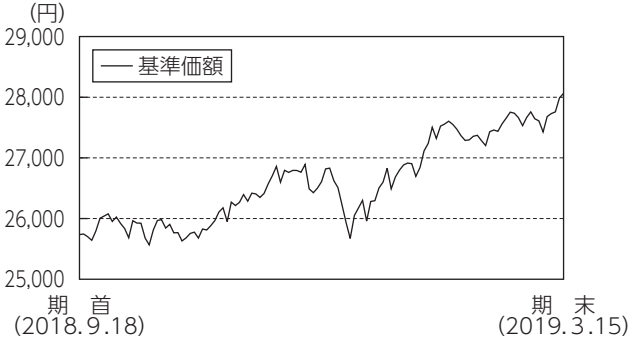
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★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/

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数(配当込み)		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(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：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、当作成期首より、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」

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

◆ポートフォリオについて

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

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。

■１万口当りの費用の明細

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

■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		売	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内	143.303	23,523,803	38.407 (－)	6,156,912 (－)

(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
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	7,232	6,935	－	－

(注１) 金額は受渡し代金。
(注２) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2018年９月19日から2019年３月15日まで)

当期							
買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
野村不動産マスターＦ	10.173	1,540,574	151,437	日本ビルファンド	0.688	466,414	677,927
日本ビルファンド	2.064	1,427,261	691,502	ジャパンリアルエステイト	0.711	429,642	604,279
ジャパンリアルエステイト	2.133	1,317,401	617,628	野村不動産マスターＦ	2.106	314,817	149,485
大和ハウスリート投資法人	5.014	1,248,279	248,958	日本リテールファンド	1.344	286,779	213,377
ジャパン・ホテル・リート投資法人	14.531	1,164,597	80,145	ユナイテッド・アーバン投資法人	1.566	274,638	175,375
ＡＰＩ投資法人	2.236	1,027,665	459,600	オリックス不動産投資	1.415	253,477	179,136
日本リテールファンド	4.03	876,185	217,415	大和ハウスリート投資法人	0.889	223,980	251,947
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.701	811,794	172,685	日本プロロジスリート	0.953	220,697	231,581
三井不ロジパーク	2.241	772,900	344,890	アドバンス・レジデンス	0.691	206,200	298,408
オリックス不動産投資	4.247	771,424	181,639	ＧＬＰ投資法人	1.758	198,095	112,682

(注１) 金額は受渡し代金。
(注２) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当期末		
	口数	評価額	比率
不動産投信	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	8.695	5,086,575	2.1
MCUBS MidCity投資法人	29.488	2,928,158	1.2
森ヒルズリート	30.011	4,309,579	1.7
産業ファンド	30.487	3,673,683	1.5
アドバンス・レジデンス	25.503	7,842,172	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	16.176	2,927,856	1.2
ＡＰＩ投資法人	13.747	6,461,090	2.6
ＧＬＰ投資法人	64.842	7,612,450	3.1
コンフォリア・レジデンシャル	10.852	3,182,891	1.3
日本プロロジスリート	35.1	8,237,970	3.3
星野リゾート・リート	3.982	2,150,280	0.9
Ｏｎｅリート投資法人	3.814	1,052,282	0.4
イオンリート投資	26.86	3,518,660	1.4
ヒューリックリート投資法	21.153	3,839,269	1.6
日本リート投資法人	8.447	3,551,963	1.4
インベスコ・オフィス・Ｊリート	155.116	2,545,453	1.0
日本ヘルスケア投資法	1.198	205,457	0.1
積水ハウス・リート投資	67.515	5,522,727	2.2
トーセイ・リート投資法人	5.037	583,788	0.2
ケネディクス商業リート	9.591	2,647,116	1.1
ヘルスケア&メディカル投資	5.481	615,516	0.2
サムティ・レジデンシャル	5.238	512,276	0.2
野村不動産マスターＦ	81.414	12,668,018	5.1
いちごホテルリート投資	4.576	607,235	0.2
ラサールロジポート投資	19.741	2,106,364	0.9
スターアジア不動産投	8.123	875,659	0.4
マリモ地方創生リート	2.25	245,475	0.1
三井不ロジパーク	6.35	2,216,150	0.9
大江戸温泉リート	4.224	355,660	0.1
さくら総合リート	5.662	482,968	0.2
投資法人みらい	7.048	1,356,740	0.5
森トラスト・ホテルリート投	6.139	839,815	0.3
三菱地所物流ＲＥＩＴ	2.769	697,511	0.3
ＣＲＥロジスティクスファンド	2.62	286,628	0.1
ザイマックス・リート	2.413	281,838	0.1
タカラレーベン不動産投	3.916	356,356	0.1
伊藤忠アドバンスロジ	4.048	369,987	0.1
日本ビルファンド	25.34	18,650,240	7.6
ジャパンリアルエステイト	26.168	16,826,024	6.8
日本リテールファンド	49.456	10,944,612	4.4
オリックス不動産投資	52.139	9,859,484	4.0
日本プライムリアルティ	16.564	7,288,160	3.0
プレミア投資法人	24.879	3,358,665	1.4
東急リアル・エステート	17.544	2,947,392	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人	16.731	2,168,337	0.9
ユナイテッド・アーバン投資法人	57.713	9,915,093	4.0
森トラスト総合リート	18.702	3,278,460	1.3
インヴィンシブル投資法人	90.276	4,730,462	1.9
フロンティア不動産投資	8.901	4,134,514	1.7
平和不動産リート	16.296	2,032,111	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	17.098	3,956,477	1.6
福岡リート投資法人	13.533	2,268,130	0.9
ケネディクス・オフィス投資法人	8.095	6,233,150	2.5
いちごオフィスリート投資法人	21.71	2,251,327	0.9
大和証券オフィス投資法人	6.04	4,705,160	1.9
阪急阪神リート投資法人	11.774	1,733,132	0.7
スターツプロシード投資法人	4.123	710,805	0.3
大和ハウスリート投資法人	35.108	8,594,438	3.5
ジャパン・ホテル・リート投資法人	84.23	7,336,433	3.0
日本賃貸住宅投資法人	29.433	2,628,366	1.1
ジャパンエクセレント投資法人	23.432	3,737,404	1.5
合計 口数、金額	1,414.911	243,042,009	
合計 銘柄数<比率>	61銘柄		<98.4%>

※ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、ＡＰＩ投資法人、ＧＬＰ投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、Ｏｎｅリート投資法人、イオンリート投資、ヒューリックリート投資法人、日本ヘルスケア投資法、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、サムティ・レジデンシャル、三井不ロジパーク、三菱地所物流ＲＥＩＴ、伊藤忠アドバンスロジ、日本ビルファンド、ジャパンリアルエステイト、グローバル・ワン不動産投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急阪神リート投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第１項に規定される法人等をいいます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメントが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。

(注１) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注２) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
国内	東証ＲＥＩＴ	百万円 3,726	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

■投資信託財産の構成

2019年３月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託証券	243,042,009	97.4
コール・ローン等、その他	6,385,429	2.6
投資信託財産総額	249,427,438	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３月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	**249,770,613,383円**
コール・ローン等	3,393,096,965
投資信託証券(評価額)	243,042,009,260
未収入金	53,384,000
未収配当金	2,938,948,158
差入委託証拠金	343,175,000
(B) 負債	**2,811,974,417**
未払金	2,014,536,517
未払解約金	411,662,900
差入委託証拠金代用有価証券	385,775,000
(C) 純資産総額(A－B)	**246,958,638,966**
元本	87,996,565,708
次期繰越損益金	158,962,073,258
(D) 受益権総口数	**87,996,565,708口**
１万口当り基準価額(C／D)	**28,065円**

＊期首における元本額は83,458,696,180円、当作成期間中における追加設定元本額は8,535,553,495円、同解約元本額は3,997,683,967円です。

＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン6,780,051,781円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）72,937,218,516円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年１回決算型）372,388,077円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050　28,858円、ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス86,973,832円、ｉＦｒｅｅ　８資産バランス554,577,788円、ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン4,086,767,027円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020　2,634,198円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030　5,156,529円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040　1,433,303円、ダイワ・ノーロード　Ｊ－ＲＥＩＴファンド46,529,133円、ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス1,032,460,815円、ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）422,735,138円、ダイワファンドラップオンライン　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス368,326,202円、ダイワ・インデックスセレクト　Ｊ－ＲＥＩＴ1,299,284,511円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は28,065円です。

■損益の状況

当期　自2018年９月19日　至2019年３月15日

項目	当期
(A) 配当等収益	**4,707,351,157円**
受取配当金	4,708,157,865
受取利息	251
その他収益金	197
支払利息	△ 807,156
(B) 有価証券売買損益	**14,940,272,724**
売買益	16,023,417,968
売買損	△ 1,083,145,244
(C) 先物取引等損益	**290,235,600**
取引益	290,400,800
取引損	△ 165,200
(D) その他費用	**△ 124,974**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**19,937,734,507**
(F) 前期繰越損益金	**131,341,326,359**
(G) 解約差損益金	**△ 6,598,409,073**
(H) 追加信託差損益金	**14,281,421,465**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**158,962,073,258**
次期繰越損益金(I)	**158,962,073,258**

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

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

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

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、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目９番１号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL　０１２０－１０６２１２

（営業日の９：00～17：00）

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

<5698>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）		
信託期間	無期限		
運用方針	海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	イ．ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券 ロ．先進国ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券	
	先進国ＲＥＩＴマザーファンド	イ．先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券 ロ．先進国のリート指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券） ハ．先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ．国内の債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
	先進国ＲＥＩＴマザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	10,195	80	2.8	10,387	3.9	—	98.7	—	10
2期末（2018年6月15日）	9,848	110	△ 2.3	10,520	1.3	0.8	100.0	1.0	279
3期末（2019年6月17日）	10,580	290	10.4	12,025	14.3	0.6	101.0	1.0	695

（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：　9,848円
期　末：10,580円（分配金290円）
騰落率：10.4%（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況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。

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

年　月　日	基準価額		ＳＰ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
		騰落率	（参考指数）	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期首）2018年６月15日	9,848	—	10,520	—	0.8	100.0	1.0
６月末	10,041	2.0	10,741	2.1	0.6	99.3	1.0
７月末	9,972	1.3	10,716	1.9	1.0	97.9	1.0
８月末	10,293	4.5	11,091	5.4	1.1	96.3	1.6
９月末	9,904	0.6	10,715	1.9	1.6	99.6	1.0
10月末	9,817	△ 0.3	10,646	1.2	1.2	96.5	1.0
11月末	9,984	1.4	10,844	3.1	0.8	98.9	1.0
12月末	9,322	△ 5.3	10,137	△ 3.6	0.8	95.7	0.6
2019年１月末	10,300	4.6	11,246	6.9	0.7	98.2	0.8
２月末	10,345	5.0	11,328	7.7	1.1	99.7	0.8
３月末	10,719	8.8	11,771	11.9	0.4	97.7	1.0
４月末	10,603	7.7	11,675	11.0	0.5	98.8	1.0
５月末	10,542	7.0	11,643	10.7	0.7	96.6	1.0
（期末）2019年６月17日	10,870	10.4	12,025	14.3	0.6	101.0	1.0

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について （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、ＦＲＢ（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ＦＲＢ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ＥＵ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」および「先進国ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■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。

■先進国ＲＥＩＴマザーファンド

日本を除く先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、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 （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。「先進国ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券への投資は、現在行っておりません。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ートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

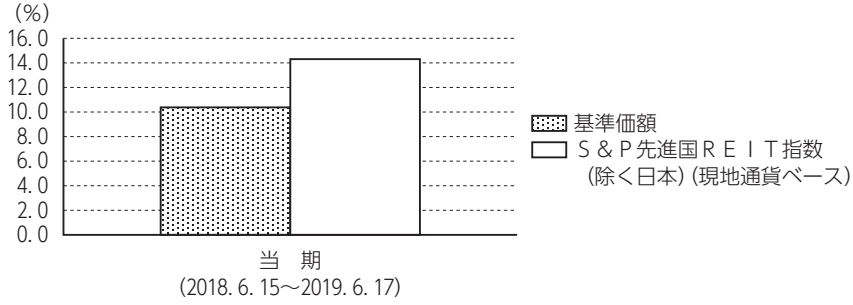
また、運用の効率化を図るため、ＥＴＦおよび不動産投信指数先物を組み入れました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

当作成期の１万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（１万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項目			当期 2018年６月16日 ～2019年６月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**290**
	対基準価額比率	（％）	2.67
	当期の収益	（円）	250
	当期の収益以外	（円）	40
翌期繰越分配対象額		（円）	859

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

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

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

■収益分配金の計算過程（１万口当り）

項目		当期
（ａ）経費控除後の配当等収益	✓	273.30円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益		456.54
（ｃ）収益調整金	✓	374.45
（ｄ）分配準備積立金		45.15
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		1,149.45
（ｆ）分配金		290.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		859.45

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」および「先進国ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有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ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

■先進国ＲＥＩＴマザーファンド

日本を除く先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ＥＴＦおよび不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

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	44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, 171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
売買委託手数料	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)	
有価証券取引税	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)	
そ の 他 費 用	9	0. 090	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. 058)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ　の　他)	(3)	(0. 027)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	55	0. 544	

(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	286,052	658,453	121,339	277,100

（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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	—	10	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	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	129,954	294,668	715,366

（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	715,366	98.5
コール・ローン等、その他	10,528	1.5
投資信託財産総額	725,894	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・シュケル＝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	**1,383,820,217円**
コール・ローン等	2,506,136
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）	715,366,314
未収入金	665,947,767
(B)負債	**688,660,250**
未払金	660,657,359
未払収益分配金	19,055,141
未払解約金	7,627,934
未払信託報酬	1,303,251
その他未払費用	16,565
(C)純資産総額（A－B）	**695,159,967**
元本	657,073,836
次期繰越損益金	38,086,131
(D)受益権総口数	**657,073,836口**
１万口当り基準価額（C／D）	**10,580円**

＊期首における元本額は284,242,850円、当作成期間中における追加設定元本額は644,244,585円、同解約元本額は271,413,599円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,580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	**16,521円**
その他収益金	17,736
支払利息	△ 1,215
(B)有価証券売買損益	**50,128,218**
売買益	108,400,685
売買損	△ 58,272,467
(C)信託報酬等	△ **2,188,595**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	**47,956,144**
(E)前期繰越損益金	**2,967,160**
(F)追加信託差損益金	**6,217,968**
(配当等相当額)	(24,604,464)
(売買損益相当額)	(△ 18,386,496)
(G)合計（D＋E＋F）	**57,141,272**
(H)収益分配金	△ **19,055,141**
次期繰越損益金（G＋H）	**38,086,131**
追加信託差損益金	3,589,673
(配当等相当額)	(21,976,169)
(売買損益相当額)	(△ 18,386,496)
分配準備積立金	34,496,458

（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	17,957,943円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	29,998,201
(c) 収益調整金	24,604,464
(d) 分配準備積立金	2,967,160
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	75,527,768
(f) 分配金	19,055,141
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	56,472,627
(h) 受益権総口数	657,073,836口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１　万　口　当　り　分　配　金	290円

分配金の課税上の取扱いについて

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

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「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327～335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
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	171.1	1,578,395	9,224	VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	172.4	1,578,108	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
	千口	千円	円		千口	千円	円
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	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
（アメリカ）				
VANGUARD REAL ESTATE ETF	14.3	1,282	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
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

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	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	%
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
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

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	%
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

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	%
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	3,785.754	149,538	16,248,841	
	銘柄数<比率>	156銘柄			<71.6%>
		千口	千カナダ・ドル	千円	%
(カナダ)					
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
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	口数、金額	247.556	5,262	426,239	
	銘柄数<比率>	25銘柄			<1.9%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
(オーストラリア)					
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

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	千オーストラリア・ドル	千円	%
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	口数、金額	4,533.925	21,084	1,575,678	
	銘柄数＜比率＞	24銘柄			<6.9%>
		千口	千香港・ドル	千円	%
(香港)					
YUEXIU 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	口数、金額	1,494.5	41,892	581,055	
	銘柄数＜比率＞	6銘柄			<2.6%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円	%
(シンガポール)					
KEPPEL DC REIT		153.628	251	19,969	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT 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
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

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		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	千シンガポール・ドル	千円	%
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	口数、金額	6,506.071	10,093	800,019	
	銘柄数＜比率＞	30銘柄			<3.5%>
		千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
(ニュージーランド)					
STRIDE PROPERTY GROUP		51.48	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	口数、金額	839.21	1,439	101,655	
	銘柄数＜比率＞	6銘柄			<0.4%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円	%
(イギリス)					
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

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	千イギリス・ポンド	千円	%
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	口数、金額	2,783.226	8,017	1,096,457	
	銘柄数＜比率＞	28銘柄			<4.8%>
		千口	千イスラエル・シュケル	千円	%
(イスラエル)					
REIT 1 LTD		28.84	499	15,048	0.1
イスラエル・シュケル通貨計	口数、金額	28.84	499	15,048	
	銘柄数＜比率＞	1銘柄			<0.1%>
		千口	千韓国・ウォン	千円	%
(韓国)					
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		6	38,820	3,559	0.0
韓国・ウォン通貨計	口数、金額	6	38,820	3,559	
	銘柄数＜比率＞	1銘柄			<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ（アイルランド）					
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		58.05	94	11,503	0.1
GREEN REIT PLC		111.57	195	23,822	0.1
HIBERNIA REIT PLC		116.24	159	19,407	0.1
国小計	口数、金額	285.86	449	54,732	
	銘柄数＜比率＞	3銘柄			<0.2%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ（オランダ）					
WERELDHAVE NV		6.47	150	18,372	0.1
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-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	18.181	480	58,550	
	銘柄数＜比率＞	4銘柄			<0.3%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ（ベルギー）					
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	20.444	1,665	202,927	
	銘柄数＜比率＞	7銘柄			<0.9%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ（フランス）					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		23.29	3,163	385,590	1.7
ICADE		7.46	596	72,732	0.3

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	千ユーロ	千円	%
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	93.843	7,208	878,480	
	銘柄数＜比率＞	7銘柄			<3.9%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ（ドイツ）					
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	38.58	490	59,774	
	銘柄数＜比率＞	2銘柄			<0.3%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ（スペイン）					
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	117.393	1,287	156,887	
	銘柄数＜比率＞	3銘柄			<0.7%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ（イタリア）					
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6.24	37	4,547	0.0
国小計	口数、金額	6.24	37	4,547	
	銘柄数＜比率＞	1銘柄			<0.0%>
ユーロ通貨計	口数、金額	580.541	11,618	1,415,901	
	銘柄数＜比率＞	27銘柄			<6.2%>
合計	口数、金額	20,805.623	-	22,264,457	
	銘柄数＜比率＞	304銘柄			<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
		百万円	百万円
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	191	—
	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）

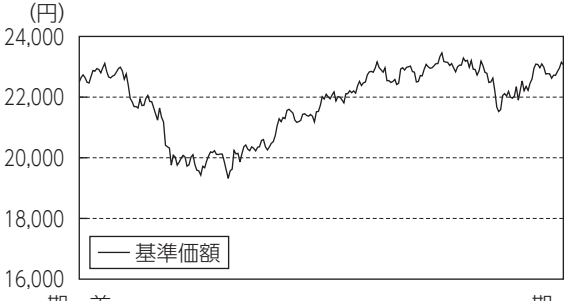
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★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)(ベンチマーク)		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		騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(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グローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのＲＥＩＴ制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
(注３) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注４) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注５) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：22,500円　期末：23,067円　騰落率：2.5%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は、北米やアジア・オセアニア地域を中心に上昇しました。

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

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

アジア・オセアニアリート市況は、2018年に入るとリスク回避の動きから売られましたが、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でリスク選好の動きが強まったことや米国の金利が上昇したことを受けて、上昇に転じました。その後は、米中貿易摩擦が悪材料となって下落する局面もありましたが、米国金利の上昇もあり底堅い推移となりました。

ユーロは、当作成期首からしばらくは、欧州金利の上昇を受けてやや上昇しました。しかし、2018年２月からはリスク回避の動きを受けて下落に転じ、５月にはイタリアの政局混迷を受けてさらに売られました。６月以降は、イタリアの政治情勢への懸念が和らぎ、市場のリスク選好度が強まったことから、ユーロ高に転じました。その後はトルコの債務危機などで上昇下落が続きました。英ポンドもユーロとほぼ同じ動きとなりました。

オーストラリア・ドルは、当作成期首から、原油価格の上昇を受けて買われました。2018年２月からは、リスク回避の動きにより円が買われた結果下落し、その後も、米中貿易摩擦の激化による中国の影響を受けやすいことから、上値の重い展開となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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エートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行ないました。

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

◆ベンチマークとの差異について

当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）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

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

■１万口当りの費用の明細

項　目	当　期
売買委託手数料	4円
（先物・オプション）	(1)
（出資証券）	(0)
（投資信託受益証券）	(0)
（投資信託証券）	(3)
有価証券取引税	5
（出資証券）	(0)
（投資信託受益証券）	(0)
（投資信託証券）	(5)
その他費用	31
（保管費用）	(18)
（その他）	(12)
合　計	40

（注１）費用の項目および算出法については前掲の（１万口当りの費用の明細の項目の概要）をご参照ください。
（注２）項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

（2017年12月１日から2018年11月30日まで）

		買		付		売		付	
		□　数		金　額		□　数		金　額	
外国	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	
		□　数		金　額		□　数		金　額	
外国	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 (－)	
	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 (－)	
	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）金額の単位未満は切捨て。

(3) 出資証券

（2017年12月１日から2018年11月30日まで）

		買		付		売		付	
		□　数		金　額		□　数		金　額	
外国	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）金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2017年12月１日から2018年11月30日まで)

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	不動産投信指数先物取引	百万円 1,139	百万円 1,021	百万円 －	百万円 －

(注１) 金額は受渡し代金。
(注２) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2017年12月１日から2018年11月30日まで)

当期								
買付				売付				
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	153.3	1,384,212	9,029	VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	141.1	1,266,877	8,978

(注１) 金額は受渡し代金。
(注２) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年12月１日から2018年11月30日まで)

当期							
買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	15.5	285,433	18,415	WESTFIELD CORP（オーストラリア）	255.6	185,958	727
PROLOGIS INC（アメリカ）	28.8	204,416	7,097	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A（アメリカ）	31.913	72,464	2,270
UNIBAIL-RODAMCO SE（フランス）	7.67	188,596	24,588	LASALLE HOTEL PROPERTIES（アメリカ）	16.4	62,339	3,801
PUBLIC STORAGE（アメリカ）	7.7	172,809	22,442	EDUCATION REALTY TRUST INC（アメリカ）	11.5	54,161	4,709
VICI PROPERTIES INC（アメリカ）	53.6	131,472	2,452	ALEXANDER & BALDWIN INC（アメリカ）	11.033	29,517	2,675
AVALONBAY COMMUNITIES INC（アメリカ）	6.9	130,373	18,894	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST（カナダ）	4.7	19,954	4,245
WELLTOWER INC（アメリカ）	19.3	129,929	6,732	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA（スペイン）	7.03	14,549	2,069
EQUITY RESIDENTIAL（アメリカ）	18.6	128,924	6,931	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE（カナダ）	18.9	12,965	686
DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）	10.5	128,629	12,250	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN（アメリカ）	6.7	11,326	1,690
VENTAS INC（アメリカ）	17.7	108,217	6,113	ISTAR INC（アメリカ）	8.4	10,881	1,295

(注１) 金額は受渡し代金。
(注２) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

(1) 外国投資信託受益証券

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
VANGUARD REAL ESTATE ETF	17	1,380	156,653	0.8

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

(2) 外国投資信託証券

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MANULIFE US REAL ESTATE INV	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
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
INFRAREIT INC	5.6	126	14,348	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	8.5	229	26,002	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2.5	54	6,169	0.0
VICI PROPERTIES INC	53.6	1,182	134,229	0.7
SPIRIT MTA REIT	5.87	57	6,480	0.0
RETAIL VALUE INC	1.957	56	6,439	0.0
BRT APARTMENTS CORP	1.3	14	1,677	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7.3	63	7,198	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1.4	69	7,917	0.0
SAFETY INCOME & GROWTH INC	1.3	25	2,913	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	26.56	169	19,288	0.1
CORECIVIC INC	18.024	396	45,014	0.2
STORE CAPITAL CORP	27.8	826	93,813	0.5
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15.7	174	19,756	0.1
LIFE STORAGE INC	7	676	76,752	0.4
SELECT INCOME REIT	13.3	258	29,277	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5.9	240	27,287	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	11.882	116	13,212	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	5.3	79	9,002	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	30.5	430	48,832	0.2
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	20.2	320	36,352	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	13.9	456	51,764	0.3
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	17.3	369	41,871	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	15.9	422	47,954	0.2
VENTAS INC	54.279	3,389	384,631	1.9
CARETRUST REIT INC	12.103	240	27,301	0.1
GEO GROUP INC/THE	18.5	429	48,680	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	46.1	731	82,963	0.4
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	14.4	124	14,182	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	27.187	524	59,507	0.3
UMH PROPERTIES INC	4.2	53	6,119	0.0
IRON MOUNTAIN INC	43.6	1,471	166,971	0.8
TERRENO REALTY CORP	8.8	343	39,012	0.2
VEREIT INC	147.308	1,123	127,535	0.6
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63.6	468	53,114	0.3
SUN COMMUNITIES INC	13.1	1,346	152,807	0.8
ACADIA REALTY TRUST	11.911	338	38,356	0.2
ALEXANDER'S INC	0.6	184	20,955	0.1
PROLOGIS INC	96.202	6,462	733,339	3.7
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16.1	1,970	223,571	1.1
BRANDYWINE REALTY TRUST	26.8	377	42,786	0.2
SAUL CENTERS INC	1.7	88	9,990	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22.945	59	6,769	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	13.5	288	32,735	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	14.1	1,321	149,945	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	62.407	523	59,412	0.3
SITE CENTERS CORP	22.278	260	29,550	0.1
DUKE REALTY CORP	54.4	1,527	173,269	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	5.5	551	62,552	0.3

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10.067	2,610	296,244	1.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18.9	600	68,090	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11.2	1,465	166,343	0.8
GETTY REALTY CORP	4.903	148	16,796	0.1
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
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 口数、金額	3,451.612	125,013	14,185,226	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	157銘柄			<71.3%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10.4	102	8,794	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	13.9	186	15,922	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	3.1	37	3,196	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6.4	105	9,009	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2.7	38	3,270	0.0
SLATE OFFICE REIT	5.1	36	3,093	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7.2	75	6,420	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4.5	43	3,693	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4.2	25	2,177	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3.4	186	15,924	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	7	70	6,021	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7.6	98	8,381	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	20.5	248	21,258	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1.7	29	2,532	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5.2	63	5,396	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10.3	322	27,538	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10.8	502	42,962	0.2
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13.79	146	12,497	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21.866	463	39,634	0.2
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23.8	586	50,093	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	129	11,038	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.2	134	11,450	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3.8	99	8,536	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6.5	84	7,206	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7.7	346	29,598	0.1
カナダ・ドル通貨計 口数、金額	210.056	4,163	355,649	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	25銘柄			< 1.8%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	29.9	85	7,104	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	241.18	248	20,638	0.1
RURAL FUNDS GROUP	50.595	113	9,415	0.0
VIVA ENERGY REIT	65.55	140	11,708	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	27.82	118	9,822	0.0
PROPERTYLINK GROUP	65.67	77	6,437	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	136.26	367	30,565	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	39.307	145	12,115	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	91.935	159	13,213	0.1
INDUSTRIA REIT	11.76	32	2,686	0.0
GDI PROPERTY GROUP	69.12	87	7,235	0.0
SCENTRE GROUP	835.07	3,348	278,204	1.4
ARENA REIT	35.38	84	6,995	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21.3	67	5,609	0.0
BWP TRUST	71.56	254	21,164	0.1
DEXUS	158.28	1,714	142,413	0.7

ファンド名		当期末 口数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 比率
		千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
GPT GROUP		279.9	1,505	125,107	0.6
INVESTA OFFICE FUND		76.69	427	35,552	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT		48.78	222	18,480	0.1
MIRVAC GROUP		577.8	1,305	108,488	0.5
STOCKLAND		378.33	1,422	118,183	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP		45.88	148	12,349	0.1
GOODMAN GROUP		251.37	2,684	223,039	1.1
VICINITY CENTRES		501.13	1,368	113,660	0.6
CHARTER HALL GROUP		71.37	507	42,158	0.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP		28.46	87	7,258	0.0
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	4,210.397	16,726	1,389,610	
	銘柄数<比率>	26銘柄			< 7.0%>
(香港)		千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		199	1,000	14,524	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		153	748	10,855	0.1
FORTUNE REIT		218	1,959	28,436	0.1
PROSPERITY REIT		158	456	6,625	0.0
LINK REIT		334	25,200	365,656	1.8
CHAMPION REIT		302	1,645	23,882	0.1
香港ドル通貨計	口数、金額	1,364	31,011	449,980	
	銘柄数<比率>	6銘柄			< 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	口数、金額	5,800.103	7,863	651,814	
	銘柄数<比率>	29銘柄			< 3.3%>

ファンド名		当期末 口数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 比率
(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	口数、金額	734.32	1,069	83,307	
	銘柄数<比率>	6銘柄			< 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	口数、金額	2,494.2	6,894	999,728	
	銘柄数<比率>	27銘柄			< 5.0%>
(イスラエル)		千口	千イスラエル・シュケル	千円	%
REIT 1 LTD		9.34	131	4,035	0.0
イスラエル・シュケル通貨計	口数、金額	9.34	131	4,035	
	銘柄数<比率>	1銘柄			< 0.0%>
ユーロ（アイルランド）		千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		49.01	70	9,054	0.0
GREEN REIT PLC		100.94	141	18,256	0.1
HIBERNIA REIT PLC		103.1	137	17,768	0.1
国小計	口数、金額	253.05	348	45,079	
	銘柄数<比率>	3銘柄			< 0.2%>
ユーロ（オランダ）		千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV		5.96	175	22,714	0.1
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		6.02	179	23,238	0.1
NSI NV		2.731	98	12,701	0.1

ファンド名		当期末			
		口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千ユーロ	千円	%
VASTNED RETAIL NV		2.45	81	10,571	0.1
国小計	口数、金額	17.161	535	69,225	
	銘柄数<比率>	4銘柄			<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	口数、金額	16.478	1,176	151,965	
	銘柄数<比率>	6銘柄			<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	口数、金額	85.921	6,736	870,251	
	銘柄数<比率>	7銘柄			<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	口数、金額	36.3	405	52,405	
	銘柄数<比率>	2銘柄			<0.3%>
ユーロ（スペイン）		千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		10.53	90	11,631	0.1
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		45.393	402	52,016	0.3
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		56.8	639	82,662	0.4
国小計	口数、金額	112.723	1,132	146,310	
	銘柄数<比率>	3銘柄			<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	口数、金額	149.64	143	18,573	
	銘柄数<比率>	2銘柄			<0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額	671.273	10,479	1,353,810	
	銘柄数<比率>	27銘柄			<6.8%>
合計	口数、金額	18,945.301	－	19,473,164	
	銘柄数<比率>	304銘柄			<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
		百万円	百万円
外国	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
	千円	%
投資信託受益証券	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・シュケル＝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－Ｉ'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。

先進国ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書　第６期　（決算日　2019年５月８日）

（作成対象期間　2018年５月９日～2019年５月８日）

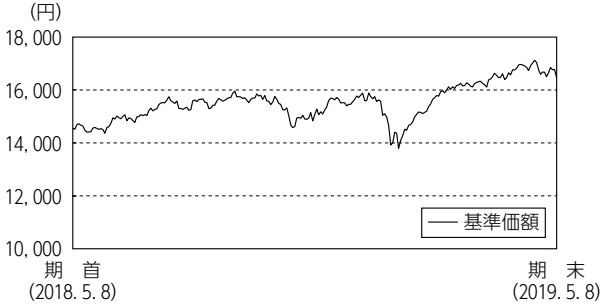
先進国ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運　用　方　針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ．先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ．先進国のリート指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券） ハ．先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ．国内の債券
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



年月日	基準価額		S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)		投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2018年5月8日	14,553	—	16,237	—	—	97.1	2.5
5月末	14,593	0.3	16,357	0.7	—	97.3	0.9
6月末	15,217	4.6	16,991	4.6	—	97.1	2.4
7月末	15,263	4.9	17,083	5.2	—	95.7	3.6
8月末	15,749	8.2	17,700	9.0	19.8	76.3	3.5
9月末	15,551	6.9	17,388	7.1	24.6	70.4	4.1
10月末	15,281	5.0	17,111	5.4	21.3	74.5	4.0
11月末	15,715	8.0	17,555	8.1	—	93.3	6.6
12月末	14,371	△1.3	15,979	△1.6	—	92.6	7.0
2019年1月末	15,713	8.0	17,626	8.5	24.3	70.1	5.4
2月末	16,119	10.8	17,974	10.7	37.7	57.1	5.0
3月末	16,767	15.2	18,560	14.3	31.2	63.8	4.4
4月末	16,762	15.2	18,516	14.0	39.5	57.0	3.4
(期末)2019年5月8日	16,478	13.2	18,270	12.5	39.4	56.9	3.4

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) S&P先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）は、S&P先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。S&P先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 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：14,553円　期末：16,478円　騰落率：13.2%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市況が堅調に推移したことで参考指数（S&P先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース））が上昇した影響が大きく、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」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、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、ＦＲＢ（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で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ＦＲＢ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緩やかな上昇となりました。

欧州リート市況は、当作成期首より、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ＥＵ離脱に関する政治的混乱が続いたことから、ドイツなど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、香港は大型リートの好業績を受けて買われる局面もありましたが、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後退したことから、再び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。その後は、商業施設リートの業績懸念などで売られましたが、2019年に入ると中国景気の先行きに対する安心感が広がり、再び上昇しました。

○為替相場

為替相場は、主要通貨では米ドルが買われました。

為替相場（対円）は、米ドルは、米中貿易摩擦への懸念が後退したことでリスクテイクの動き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。2018年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。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、ユーロ安になりました。当作成期末にかけては、ユーロは下げ止まったものの、上値が重い展開となりました。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、ユーロ同様リスク回避的な動きを受けてオーストラリア・ドル安に転じました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

引き続き、日本を除く先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、S&P先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおお

むね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。

◆ポートフォリオについて

海外リートの組入比率（ＥＴＦ（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を含む。）は、当作成期を通じて、原則として98～99％台で運用を行いました。

海外リートポートフォリオにつきましては、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）採用銘柄の中から流動性の高い海外リートを中心に通常50銘柄程度で組成し、結果として時価総額の大きい海外リートを主としたポートフォリオとなりました。なお、運用の効率化を図るため、ＥＴＦおよび不動産投信指数先物取引も利用しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期を通じて、海外リート組入比率（ＥＴＦ（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を含む。）を基本的に98～99％台で推移させました。その結果、参考指数の上昇に対しマイナスのかい離が発生しました。

また、配当金等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、組み入れている流動性の高い海外リートポートフォリオと参考指数との騰落率の差異、参考指数とファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

日本を除く先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ＥＴＦ（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。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	22円
（先物・オプション）	(3)
（投資信託受益証券）	(3)
（投資信託証券）	(17)
有価証券取引税	21
（投資信託受益証券）	(0)
（投資信託証券）	(21)
その他費用	18
（保管費用）	(14)
（その他）	(4)
合計	61

（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)投資信託受益証券

（2018年５月９日から2019年５月８日まで）

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	296.3 (—)	24,753 (—)	163.1 (—)	13,296 (—)

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

(2)投資信託証券

（2018年５月９日から2019年５月８日まで）

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口 509.1 (△30.233)	千アメリカ・ドル 14,845 (△609)	千口 868.042 (—)	千アメリカ・ドル 31,283 (—)
	カナダ	千口 121.3 (—)	千カナダ・ドル 2,551 (—)	千口 122.8 (—)	千カナダ・ドル 2,125 (—)
	オーストラリア	千口 1,193.38 (—)	千オーストラリア・ドル 6,085 (—)	千口 1,298.2 (—)	千オーストラリア・ドル 7,144 (—)
	香港	千口 108.5 (—)	千香港・ドル 8,990 (—)	千口 141.5 (—)	千香港・ドル 10,502 (—)
	シンガポール	千口 1,626.7 (—)	千シンガポール・ドル 3,569 (△3)	千口 1,813.4 (—)	千シンガポール・ドル 3,782 (—)
	イギリス	千口 572.96 (—)	千イギリス・ポンド 2,512 (—)	千口 680.71 (—)	千イギリス・ポンド 2,968 (—)
	ユーロ （ベルギー）	千口 7.23 (—)	千ユーロ 800 (—)	千口 8.07 (—)	千ユーロ 870 (—)
	ユーロ （フランス）	千口 30.24 (—)	千ユーロ 2,932 (—)	千口 42.49 (—)	千ユーロ 3,058 (—)
	ユーロ （スペイン）	千口 82.16 (△15.61)	千ユーロ 1,029 (△279)	千口 45.05 (—)	千ユーロ 479 (—)
	ユーロ （ユーロ通貨計）	千口 119.63 (△15.61)	千ユーロ 4,762 (△279)	千口 95.61 (—)	千ユーロ 4,409 (—)

（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

(2018年5月9日から2019年5月8日まで)

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	不動産投信指数先物取引	964	964	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1)投資信託受益証券

(2018年5月9日から2019年5月8日まで)

当期								
買付				売付				
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	296.3	2,752,367	9,289	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	163.1	1,499,549	9,194

(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5月9日から2019年5月8日まで)

当期								
買付				売付				
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)	7.02	146,901	20,926	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	9.3	180,408	19,398
LINK REIT (香港)	108.5	127,576	1,175	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	7.3	174,288	23,875
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT (シンガポール)	534.5	118,487	221	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)	8.09	173,982	21,505
COFINIMMO (ベルギー)	7.23	103,327	14,291	LINK REIT (香港)	141.5	149,891	1,059
SCENTRE GROUP (オーストラリア)	316.27	101,757	321	PROLOGIS INC (アメリカ)	17.9	130,186	7,272
COVIVIO (フランス)	8.5	98,926	11,638	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT (シンガポール)	553	118,939	215
UNITE GROUP PLC (イギリス)	73.01	96,659	1,323	SCENTRE GROUP (オーストラリア)	357.09	118,551	331
CAPITALAND MALL TRUST (シンガポール)	515.9	96,599	187	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	5.9	116,507	19,747
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	103.35	96,562	934	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	131.99	113,222	857
LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス)	71.9	94,246	1,310	COFINIMMO (ベルギー)	8.07	111,443	13,809

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国投資信託受益証券

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)					
VANGUARD REAL ESTATE ETF		—	133.2	11,429	1,259,459
合計	口数、金額	—	133.2	11,429	1,259,459
	銘柄数＜比率＞	—	1銘柄		<39.4%>

(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。

(2)外国投資信託証券

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)					
URBAN EDGE PROPERTIES		—	7.5	135	14,892
AVALONBAY COMMUNITIES INC		5.5	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC		11.1	3.9	678	74,787
BOSTON PROPERTIES INC		7.4	2.5	328	36,247
GGP INC		32.5	—	—	—
VORNADO REALTY TRUST		10.8	3.4	226	24,958
EQUITY RESIDENTIAL		14.5	5.6	418	46,137
HOST HOTELS & RESORTS INC		39.3	11.8	228	25,172
CYRUSONE INC		—	2.1	125	13,800
KIMCO REALTY CORP		25.2	9	161	17,811
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A		17.1	—	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		19	—	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC		—	5	155	17,184
INVITATION HOMES INC		—	6.5	159	17,626
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		—	0.6	47	5,255
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		—	8.4	172	18,956
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN		—	5.5	205	22,690
VENTAS INC		13.7	5.3	323	35,606
GEO GROUP INC/THE		—	3.5	71	7,925
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		26.2	7.7	136	15,085
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU		—	2.425	65	7,185
IRON MOUNTAIN INC		14.1	4.9	151	16,662
VEREIT INC		68.5	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC		—	2.5	304	33,563
PROLOGIS INC		20.5	9.4	698	76,979
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		5.3	2.3	320	35,356
COUSINS PROPERTIES INC		61.5	—	—	—
DUKE REALTY CORP		19.3	—	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3	1	278	30,733
FEDERAL REALTY INVS TRUST		4.6	—	—	—
WELLTOWER INC		14.4	4.9	369	40,699
HCP INC		21.7	8.5	253	27,911
HIGHWOODS PROPERTIES INC		10.7	—	—	—
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST		—	7.1	183	20,255
EQUITY COMMONWEALTH		—	11.2	357	39,368
KILROY REALTY CORP		7.5	—	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST		12.9	—	—	—
LEXINGTON REALTY TRUST		—	22.9	207	22,811
MID-AMERICA APARTMENT COMM		5.5	—	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		—	2.6	301	33,233
REALTY INCOME CORP		12.8	—	—	—
PUBLIC STORAGE		5.2	1.9	422	46,610
REGENCY CENTERS CORP		9.1	—	—	—
SL GREEN REALTY CORP		6	2	169	18,635
UDR INC		14.8	—	—	—
WP CAREY INC		11.2	—	—	—
AGREE REALTY CORP		—	4.5	292	32,240
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		—	4.7	164	18,152
DIGITAL REALTY TRUST INC		7.8	2.4	281	31,052
EXTRA SPACE STORAGE INC		6.1	2.4	249	27,545
DCT INDUSTRIAL TRUST INC		10.3	—	—	—
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	575.1	185.925	8,649	953,135
	銘柄数＜比率＞	35銘柄	34銘柄		<29.8%>
		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)					
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		—	12.8	431	35,276
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		37.3	—	—	—
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		—	23	529	43,261
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	37.3	35.8	960	78,538
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	2銘柄		<2.5%>
		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)					
SCENTRE GROUP		249.3	208.48	769	59,443
MIRVAC GROUP		—	189.28	537	41,536
STOCKLAND		183.76	—	—	—
WESTFIELD CORP		97.89	—	—	—
GOODMAN GROUP		96.6	67.96	887	68,581
CHARTER HALL GROUP		—	57.01	572	44,227
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	627.55	522.73	2,766	213,789
	銘柄数＜比率＞	4銘柄	4銘柄		<6.7%>

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千香港・ドル	千円
(香港)					
LINK REIT		102	69	6,534	91,741
香港・ドル通貨計	口数、金額	102	69	6,534	91,741
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		<2.9%>
		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)					
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		269.4	250.9	745	60,277
CAPITALAND MALL TRUST		—	242.2	593	47,999
SUNTEC REIT		410.4	—	—	—
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	679.8	493.1	1,338	108,276
	銘柄数＜比率＞	2銘柄	2銘柄		<3.4%>
		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)					
LAND SECURITIES GROUP PLC		40.9	42.99	395	57,015
SEGRO PLC		76.44	—	—	—
HAMMERSON PLC		72.03	—	—	—
UNITE GROUP PLC		—	39.72	374	53,993
BRITISH LAND CO PLC		61.47	60.38	361	52,011
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	250.84	143.09	1,132	163,020
	銘柄数＜比率＞	4銘柄	3銘柄		<5.1%>
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ベルギー）					
COFINIMMO		4.19	3.35	384	47,414
国小計	口数、金額	4.19	3.35	384	47,414
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		<1.5%>
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（フランス）					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	4.44	664	81,864
UNIBAIL-RODAMCO SE		4.41	—	—	—
KLEPIERRE		16.23	—	—	—
COVIVIO		—	3.95	384	47,360
国小計	口数、金額	20.64	8.39	1,048	129,225
	銘柄数＜比率＞	2銘柄	2銘柄		<4.0%>

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（スペイン）					
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		—	21.5	263	32,524
国小計	口数、金額	—	21.5	263	32,524
	銘柄数＜比率＞	—	1銘柄		<1.0%>
ユーロ通貨計	口数、金額	24.83	33.24	1,696	209,164
	銘柄数＜比率＞	3銘柄	4銘柄		<6.5%>
合計	口数、金額	2,297.42	1,482.885	—	1,817,666
	銘柄数＜比率＞	50銘柄	50銘柄		<56.9%>

（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）＜　＞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
		百万円	百万円
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	93	—
	STOXX 600 REAL（ドイツ）	15	—

（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５月８日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	1,259,459	39.4
投資信託証券	1,817,666	56.9
コール・ローン等、その他	119,860	3.7
投資信託財産総額	3,196,986	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、５月８日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110.19円、１カナダ・ドル＝81.78円、１オーストラリア・ドル＝77.27円、１香港・ドル＝14.04円、１シンガポール・ドル＝80.89円、１イギリス・ポンド＝144.00円、１ユーロ＝123.29円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（3,116,067千円）の投資信託財産総額（3,196,986千円）に対する比率は、97.5％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年５月８日現在

項　　目	当　期　末
(A)資産	**3,264,727,186円**
コール・ローン等	84,004,730
投資信託受益証券（評価額）	1,259,459,799
投資信託証券（評価額）	1,817,666,136
未収入金	68,621,631
未収配当金	4,445,815
差入委託証拠金	30,529,075
(B)負債	**69,087,351**
未払金	69,053,914
未払解約金	32,900
その他未払費用	537
(C)純資産総額（A－B）	**3,195,639,835**
元本	1,939,346,316
次期繰越損益金	1,256,293,519
(D)受益権総口数	**1,939,346,316口**
１万口当り基準価額（C／D）	**16,478円**

＊期首における元本額は2,619,799,668円、当作成期間中における追加設定元本額は3,237,615,714円、同解約元本額は3,918,069,066円です。

＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、先進国ＲＥＩＴ（為替ヘッジなし）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）19,649,023円、ダイナミック・アロケーション・ファンド（適格機関投資家専用）1,200,382,101円、先進国ＲＥＩＴファンド（適格機関投資家専用）520,465,545円、りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド22,486,816円、堅実バランスファンド －ハジメの一歩－39,147,151円、ＤＣダイワ８資産アロケーション・ファンド31,267円、ＤＣダイナミック・アロケーション・ファンド10,323,920円、ダイワ外国３資産アロケーション・ファンド（部分為替ヘッジあり）126,860,493円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は16,478円です。

■損益の状況

当期　自2018年５月９日　至2019年５月８日

項　　目	当　　期
(A)配当等収益	**99,676,822円**
受取配当金	99,301,128
受取利息	171,092
その他収益金	281,149
支払利息	△　76,547
(B)有価証券売買損益	**196,662,315**
売買益	421,693,408
売買損	△　225,031,093
(C)先物取引等損益	**11,182,983**
取引益	21,674,020
取引損	△　10,491,037
(D)その他費用	**△　3,078,768**
(E)当期損益金（A＋B＋C＋D）	**304,443,352**
(F)前期繰越損益金	**1,192,741,256**
(G)解約差損益金	**△　2,134,748,775**
(H)追加信託差損益金	**1,893,857,686**
(I)合計（E＋F＋G＋H）	**1,256,293,519**
次期繰越損益金（I）	**1,256,293,519**

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

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

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版）

第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	イ．ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券 ロ．先進国ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券	
	先進国ＲＥＩＴマザーファンド	イ．先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ．先進国のリート指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券） ハ．先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ．国内の債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
	先進国ＲＥＩＴマザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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/

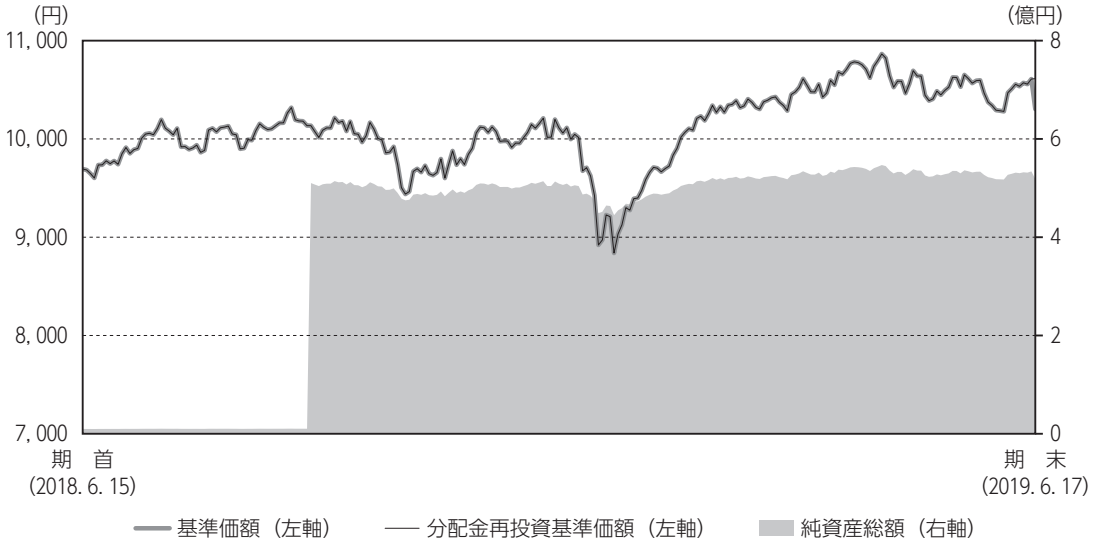
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ＳＡＰ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）		投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（参考指数）	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	9,897	100	△ 0.0	9,936	△ 0.6	—	100.1	—	9
2期末（2018年6月15日）	9,694	330	1.3	10,224	2.9	0.8	101.1	1.0	9
3期末（2019年6月17日）	10,304	310	9.5	11,335	10.9	0.6	101.1	1.0	518

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）ＳＡＰ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、ＳＡＰ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ＳＡＰ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。

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：　9,694円
期　末：10,304円（分配金310円）
騰落率：9.5%（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。

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

年　月　日	基準価額		ＳＡＰ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	（参考指数）	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期首）2018年６月15日	9,694	—	10,224	—	0.8	101.1	1.0
６月末	9,850	1.6	10,402	1.7	0.6	98.1	1.0
７月末	9,884	2.0	10,459	2.3	1.0	97.4	1.0
８月末	10,194	5.2	10,837	6.0	1.1	97.0	1.6
９月末	10,031	3.5	10,645	4.1	1.5	97.1	1.0
10月末	9,878	1.9	10,476	2.5	1.2	97.5	1.0
11月末	10,109	4.3	10,748	5.1	0.8	97.9	0.9
12月末	9,209	△ 5.0	9,782	△ 4.3	0.9	98.2	0.6
2019年１月末	10,067	3.8	10,791	5.5	0.7	98.2	0.8
２月末	10,303	6.3	11,004	7.6	1.1	97.9	0.8
３月末	10,679	10.2	11,363	11.1	0.4	98.3	1.0
４月末	10,641	9.8	11,336	10.9	0.5	98.5	1.0
５月末	10,341	6.7	11,107	8.6	0.8	98.2	1.0
（期末）2019年６月17日	10,614	9.5	11,335	10.9	0.6	101.1	1.0

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について （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、ＦＲＢ（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ＦＲＢ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ＥＵ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の動き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による中国の影響を受け、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て下落しました。

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。

■先進国ＲＥＩＴマザーファンド

日本を除く先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、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 （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。

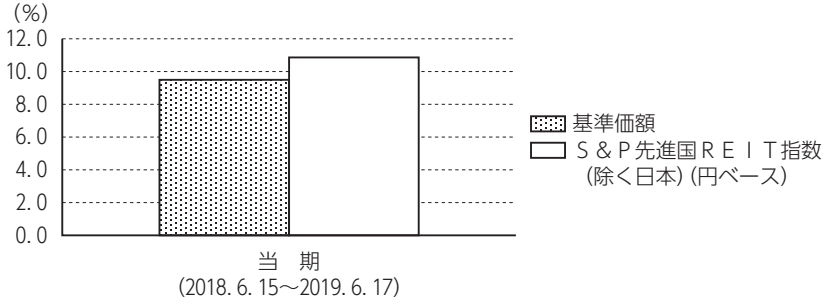
■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

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エートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期の１万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（１万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。
収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（１万口当り）」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項目			当期 2018年６月16日 ～2019年６月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**310**
	対基準価額比率	（%）	2.92
	当期の収益	（円）	265
	当期の収益以外	（円）	45
翌期繰越分配対象額		（円）	303

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

■収益分配金の計算過程（１万口当り）

項目		当期
（ａ）経費控除後の配当等収益	✓	288.21円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益		192.59
（ｃ）収益調整金	✓	132.31
（ｄ）分配準備積立金		0.79
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		613.91
（ｆ）分配金		310.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		303.91

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

今後の運用方針

■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。なお、「先進国ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券に投資する場合もあります。

■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ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

■先進国ＲＥＩＴマザーファンド

日本を除く先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ＥＴＦおよび不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

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. 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, 108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
売買委託手数料	1	0. 014	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. 009)	
有価証券取引税	1	0. 014	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(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. 014)	
そ の 他 費 用	10	0. 097	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. 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. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ　の　他)	(3)	(0. 033)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	56	0. 554	

(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	216,379	499,945	893	2,052

（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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	—	10	当初設定時における取得

（注１）金額は元本ベース。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	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	4,552	220,038	534,186

（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	534,186	99.8
コール・ローン等、その他	1,163	0.2
投資信託財産総額	535,350	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・シュケル＝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	**535,350,038円**
コール・ローン等	1,137,075
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）	534,186,963
未収入金	26,000
(B)負債	**16,712,838**
未払収益分配金	15,603,537
未払信託報酬	1,095,370
その他未払費用	13,931
(C)純資産総額（A－B）	**518,637,200**
元本	503,339,911
次期繰越損益金	15,297,289
(D)受益権総口数	**503,339,911口**
１万口当り基準価額（C／D）	**10,304円**

＊期首における元本額は10,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は493,339,911円、同解約元本額は０円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,304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	△ **124円**
支払利息	△ 124
(B)有価証券売買損益	**26,271,171**
売買益	26,299,200
売買損	△ 28,029
(C)信託報酬等	△ **1,724,100**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	**24,546,947**
(E)前期繰越損益金	△ **306,209**
(F)追加信託差損益金	**6,660,088**
（配当等相当額）	(2,311,320)
（売買損益相当額）	(4,348,768)
(G)合計（D＋E＋F）	**30,900,826**
(H)収益分配金	△ **15,603,537**
次期繰越損益金（G＋H）	**15,297,289**
追加信託差損益金	4,395,059
（配当等相当額）	(46,291)
（売買損益相当額）	(4,348,768)
分配準備積立金	10,902,230

（注１）信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
（注２）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
（注３）収益分配金の計算過程は下記「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	14,506,850円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	9,693,897
(c) 収益調整金	6,660,088
(d) 分配準備積立金	39,991
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	30,900,826
(f) 分配金	15,603,537
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	15,297,289
(h) 受益権総口数	503,339,911口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１　万　口　当　り　分　配　金	**310円**

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

★「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336～344ページ、「先進国ＲＥＩＴマザーファンド」の第６期にかかる運用状況については345～351ページをご参照ください。

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「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。327～335ページをご参照ください。