

# ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

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

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

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

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

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

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

---

---

## 運用報告書 (全体版)

### 第3期

(決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2日)

---

---

#### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

ここに、当作成期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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/>

<4667>  
<2768>  
<2769>  
<4668>  
<2770>  
<2771>  
<4669>  
<2772>  
<2773>

# ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

## 運用報告書（全体版） 第3期

（決算日 2019年12月2日）

（作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2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

大和証券投資信託委託株式会社  
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/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			T O P I X		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率			
1 期末(2017年11月30日)	円 11,827	円 0	% 18.3	1,792.08	% 16.2	% 98.7	% 1.3	百万円 1,308
2 期末(2018年11月30日)	11,209	0	△ 5.2	1,667.45	△ 7.0	98.7	1.3	2,014
3 期末(2019年12月 2 日)	11,793	0	5.2	1,714.49	2.8	98.7	1.4	2,849

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

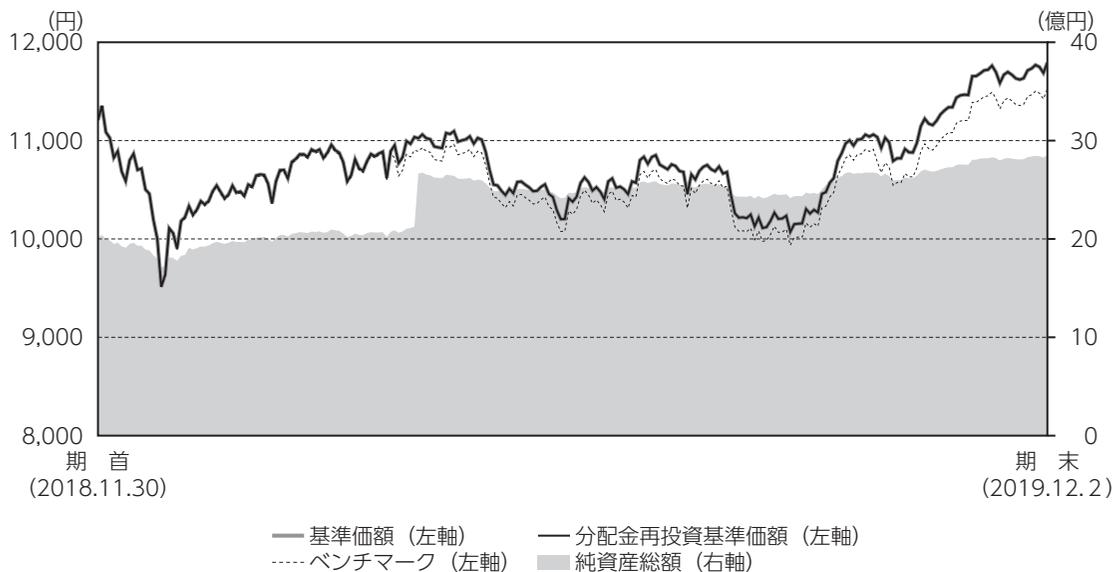
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

\*ベンチマークはTOP I Xです。

#### ■基準価額・騰落率

期首：11,209円

期末：11,793円（分配金0円）

騰落率：5.2%（分配金込み）

#### ■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（TOP I X）が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。

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	騰 落 率		(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2018年11月30日	円	%		%	%	%
	11,209	—	1,667.45	—	98.7	1.3
12月末	10,059	△10.3	1,494.09	△10.4	99.3	0.9
2019年 1 月末	10,553	△ 5.9	1,567.49	△ 6.0	99.1	0.8
2 月末	10,824	△ 3.4	1,607.66	△ 3.6	99.5	0.7
3 月末	10,832	△ 3.4	1,591.64	△ 4.5	97.9	2.1
4 月末	11,010	△ 1.8	1,617.93	△ 3.0	98.7	1.3
5 月末	10,292	△ 8.2	1,512.28	△ 9.3	98.4	1.6
6 月末	10,571	△ 5.7	1,551.14	△ 7.0	99.3	0.9
7 月末	10,665	△ 4.9	1,565.14	△ 6.1	99.0	0.9
8 月末	10,304	△ 8.1	1,511.86	△ 9.3	99.0	1.0
9 月末	10,924	△ 2.5	1,587.80	△ 4.8	98.5	1.6
10月末	11,467	2.3	1,667.01	△ 0.0	98.9	2.0
11月末	11,688	4.3	1,699.36	1.9	98.3	1.9
(期末) 2019年12月 2 日	11,793	5.2	1,714.49	2.8	98.7	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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に開催された米中閣僚級協議などにより通商協議の進展期待が再び高まり、株価は反発しました。しかし5月に入り、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、また中国の通信機器大手メーカーに対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。下落一巡後は、世界景気の動向などに不透明感がある中で、6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことや米国の利下げ期待が支えとなり、株価は底堅く推移しました。その後8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が後退したことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■当ファンド

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

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

株式ポートフォリオは、最適化の手法（株価変動を数理的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがベンチマーク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ベンチマークの構成変化に対応するため、随時、株式の売買を行いました。

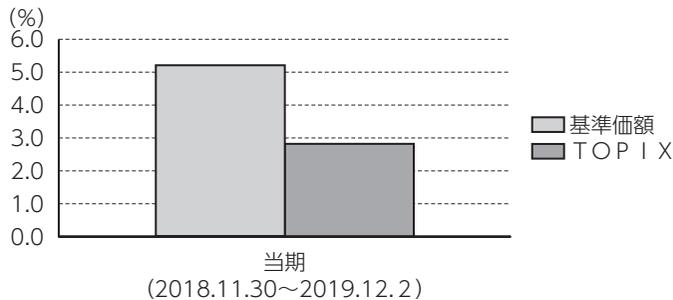
## ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は2.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は5.2%となりました。

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

その他、マザーファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、先物取引の影響、運用管理費用等のコストがかい離の要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

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

### 分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ～2019年12月2日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（%）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,792

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.12.1～2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	25円	0.229%	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10,755円です。
(投 信 会 社)	(16)	(0.152)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	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)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	25	0.236	

(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。

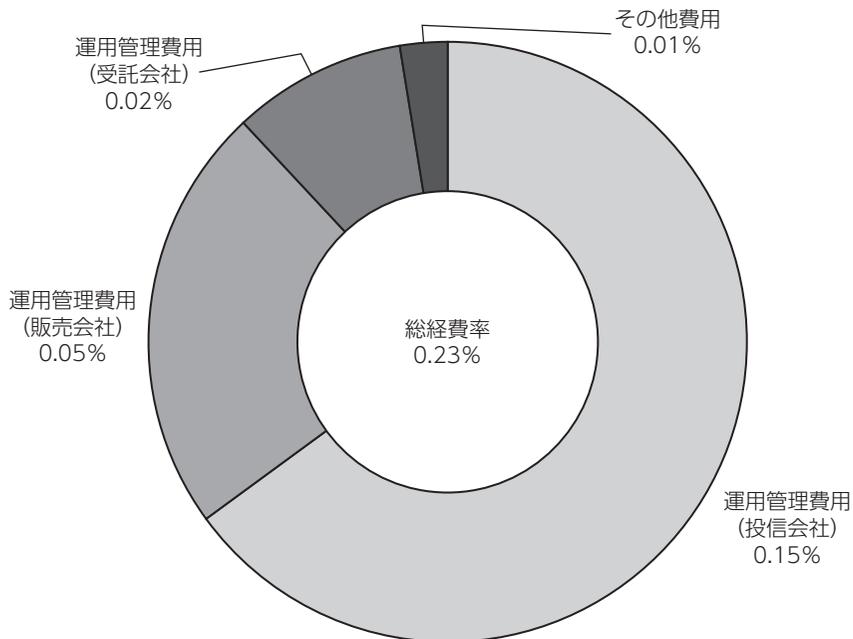
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.23%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2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	899,385	921,611	249,282	255,782

(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12月1日から2019年12月2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	39,448,923千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	139,913,686千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	0.28

(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12月1日から2019年12月2日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 28,073	百万円 10	% 0.0	百万円 11,375	百万円 97	% 0.9
株式先物取引	28,881	6,369	22.1	28,504	6,322	22.2
コール・ローン	4,636,245	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.7%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株式	百万円 45	百万円 13	百万円 316

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

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

(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12月1日から2019年12月2日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	38千円
うち利害関係人への支払額 (B)	9千円
(B)÷(A)	24.5%

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

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

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	1,905,520	2,555,624	2,849,521

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,849,521	99.8
コール・ローン等、その他	5,976	0.2
投資信託財産総額	2,855,497	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12月2日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>2,855,497,882円</b>
コール・ローン等	3,206,818
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	2,849,521,064
未収入金	2,770,000
<b>(B) 負債</b>	<b>5,781,780</b>
未払解約金	2,703,040
未払信託報酬	3,006,400
その他未払費用	72,340
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>2,849,716,102</b>
元本	2,416,486,034
次期繰越損益金	433,230,068
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>2,416,486,034口</b>
<b>1万口当り基準価額(C / D)</b>	<b>11,793円</b>

\* 期首における元本額は1,797,553,299円、当作成期間中における追加設定元本額は1,209,913,301円、同解約元本額は590,980,566円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,793円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 2,320円</b>
受取利息	314
支払利息	△ 2,634
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>186,098,841</b>
売買益	194,806,774
売買損	△ 8,707,933
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 5,580,053</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>180,516,468</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>4,270,102</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>248,443,498</b>
(配当等相当額)	( 219,735,320)
(売買損益相当額)	( 28,708,178)
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>433,230,068</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>433,230,068</b>
追加信託差損益金	248,443,498
(配当等相当額)	( 219,735,320)
(売買損益相当額)	( 28,708,178)
分配準備積立金	184,788,890
繰越損益金	△ 2,320

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	103,549,056
(c) 収益調整金	248,443,498
(d) 分配準備積立金	81,239,834
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	433,232,388
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	433,232,388
(h) 受益権総口数	2,416,486,034口

## &lt;補足情報&gt;

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン TOP I Xインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2019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12月2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12月1日から2019年12月2日まで)

買				付				売				付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円
武田薬品	369.7	1,617,575	4,375	トヨタ自動車	38.4	276,901	7,210								
ソフトバンク	716.1	986,870	1,378	KDDI	95.3	272,893	2,863								
トヨタ自動車	122.8	885,316	7,209	ソニー	42	261,547	6,227								
三菱UFJフィナンシャルG	751.9	412,091	548	ソフトバンクグループ	44.2	246,812	5,583								
ソニー	67.2	407,299	6,061	キーエンス	3.6	241,983	67,217								
NTTドコモ	139.1	393,951	2,832	NTTドコモ	72.2	181,075	2,507								
ソフトバンクグループ	75.3	384,221	5,102	武田薬品	45.8	177,360	3,872								
日本電信電話	67.7	348,882	5,153	ソフトバンク	116.5	175,498	1,506								
任天堂	8.6	337,278	39,218	本田技研	58.6	173,326	2,957								
キーエンス	5.2	317,717	61,099	オリエンタルランド	10.3	162,771	15,803								

(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12月2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（147,704,616千円）の内容です。

## (1) 国内株式

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			ファーストコーポレーション	2.8	1,884	不動テトラ	5.5	8,486	新日本建設	9	8,352
極洋	3.3	9,586	ベステラ	1.6	2,012	大末建設	2.5	2,410	NIPPO	17.5	39,480
日本水産	91.3	60,805	スペースバリューHD	11.1	5,716	鉄建建設	4.6	13,091	東亜道路	1.3	4,491
マルハニチロ	13.2	38,781	ダイセキ環境ソリューション	1.7	1,700	西松建設	16.3	39,674	前田道路	22.3	58,024
カネコ種苗	2.8	4,261	第一カッター興業	1.1	2,009	三井住友建設	51.2	31,232	日本道路	2	14,020
サカタのタネ	10.9	38,531	安藤・間	54.4	49,232	大豊建設	4.8	14,395	東亜建設	6.6	10,408
ホクト	7	14,007	東急建設	26.8	21,011	前田建設	52.9	52,582	日本国土開発	12.3	7,699
ホクリヨウ	1.4	952	コムシスホールディングス	32.4	103,356	佐田建設	4.6	1,890	若築建設	3.8	6,463
<b>鉱業 (0.3%)</b>			ミサワホーム	6.3	7,547	ナカノフド一建設	5.8	2,760	東洋建設	23.7	11,944
住石ホールディングス	18.4	2,760	ピーアールホールディングス	10	4,840	興村組	11.4	35,283	五洋建設	83.6	53,253
日鉄鉱業	2.1	9,597	高松コンストラクショングP	5.7	15,578	東鉄工業	9	29,475	世紀東急	10.1	8,928
三井松島HLDGS	3.5	4,210	東建コーポレーション	2.8	20,440	イチケン	1.5	2,682	福田組	2.4	11,580
国際石油開発帝石	366.2	388,721	ソネック	0.9	726	富士ビー・エス	3.1	1,798	住友林業	53.5	85,279
石油資源開発	11.9	33,784	ヤマウラ	3.9	3,428	浅沼組	2.4	10,500	日本基礎技術	7	2,821
K&Oエナジーグループ	4.4	6,938	大成建設	70.3	305,453	戸田建設	87.6	59,743	巴コーポレーション	9.3	3,710
<b>建設業 (2.8%)</b>			大林組	210.7	248,626	熊谷組	9.8	32,095	大和ハウス	208.6	708,197
ヒノキヤグループ	2.3	5,135	清水建設	213.9	227,803	北野建設	1.3	3,387	ライト工業	12.1	19,202
ショーボンドHD	13	55,380	飛鳥建設	6.1	8,967	植木組	0.9	2,290	積水ハウス	230.5	551,932
ミライト・ホールディングス	27.2	44,553	長谷工コーポレーション	81.6	116,524	矢作建設	9.3	7,105	日特建設	5.5	4,334
タマホーム	4.4	8,104	松井建設	8.3	6,490	ピーエス三菱	6.9	4,823	北陸電気工事	3.7	3,877
サンヨーホームズ	0.9	611	銭高組	0.9	3,604	日本ハウスHLDGS	14.4	6,940	ユアテック	12.1	8,191
日本アーク	3.6	2,365	鹿島建設	165.5	241,630	大東建設	25.3	337,881	四電工	1.1	3,063

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
中電工	8.5	21,947	明治ホールディングス	44.6	335,838	理研ピタミン	3.2	13,008	ザ・バック	5	19,550
関電工	30	31,620	雪印メグミルク	16.3	43,455	繊維製品 (0.6%)			化学 (7.2%)		
きんでん	50.1	83,115	プリマハム	10.6	27,072	片倉工業	9.5	13,091	クラレ	103.5	139,518
東京エネシス	7	6,566	日本ハム	25.8	119,970	グンゼ	4.8	24,960	旭化成	436.2	534,126
トーエネック	2.1	7,644	林兼産業	2.3	1,676	東洋紡	26	42,172	共和レザー	3.6	2,890
住友電設	6	14,814	丸大食品	7.2	16,855	ユニチカ	19.3	7,256	昭和電工	46.8	138,762
日本電設工業	11.6	26,308	S Foods	5.4	16,227	富士紡ホールディングス	3.2	11,136	住友化学	482.9	242,898
協和エクシオ	32	92,064	伊藤ハム米久HLDGS	43.4	31,161	倉敷紡績	6.7	17,299	住友精化	2.9	10,121
新日本空調	5.6	12,555	サッポロホールディングス	23.1	61,884	シキボウ	3.4	3,199	日産化学	36.8	163,392
九電工	14.8	52,466	アサヒグループホールディン	141.3	744,085	日本毛織	21.6	23,220	ラサ工業	2.3	3,505
三機工業	15.2	22,496	キリンHD	286.1	698,513	ダイトウボウ	11.5	977	クレハ	5.6	36,680
日揮ホールディングス	64.9	105,267	宝ホールディングス	50.5	54,237	トーア紡コーポレーション	2.6	1,510	多木化学	1.9	8,645
中外炉工業	2.3	3,928	オエノホールディングス	17.8	7,209	ダイドーリミテッド	8.5	2,380	テイカ	4.8	9,379
ヤマト	6.7	4,837	養命酒	2.1	4,200	帝国繊維	7.4	15,110	石原産業	11.8	13,971
太平電業	5.1	11,898	コカ・コーラボトラーズHD	47.3	125,155	帝人	53.7	112,555	片倉コープアグリ	1.7	2,012
高砂熱学	18.3	34,788	サントリー食品インター	45.1	214,450	東レ	476.5	351,657	日本曹達	9.7	28,673
三晃金属	0.9	2,367	ダイドーグループHD	3.5	16,222	サカイ オーベックス	1.7	3,153	東ソー	101.6	168,554
朝日工業社	1.4	4,858	伊藤園	20.5	113,570	住江織物	1.9	5,418	トクヤマ	19	56,544
明星工業	13.6	12,648	キーコーヒー	6.6	15,833	日本フェルト	3.7	1,846	セントラル硝子	13.4	36,139
大気社	10.3	38,161	ユニカフェ	1.7	1,757	イチカワ	0.9	1,331	東亜合成	41.1	52,402
ダイダグ	5	13,160	ジャパンフーズ	1	1,238	日東製網	0.8	1,305	大阪ソーダ	6.6	20,130
日比谷総合設備	6.8	13,253	日清オイリオグループ	8.7	34,104	アツギ	5.4	4,476	関東電化	15.5	16,321
東芝プラントシステム	16.1	42,890	不二製油グループ	16.5	50,737	ダイニック	2.5	1,920	デンカ	24	79,080
OSJB HD	33.3	9,024	かどや製油	0.7	2,670	セーレン	16.2	25,272	信越化学	115	1,369,075
東洋エンジニア	8.9	6,425	J-オイルミルズ	3.5	15,277	ソトー	2.6	2,529	日本カーバイド	2.2	3,271
レイズネクスト	11.3	14,034	キッコーマン	48.5	271,600	東海染工	0.9	1,015	堺化学	4.2	10,558
<b>食料品 (3.9%)</b>			味の素	149	273,564	小松マテーレ	10.8	8,964	第一稀元素化学工	7.1	6,198
日本製粉	19.8	33,976	キユーピー	37.5	92,100	ワコルホールディングス	17.2	53,062	エア・ウォーター	53.8	94,257
日清製粉G本社	76.2	156,819	ハウス食品G本社	25.2	96,768	ホギメディカル	7.5	27,075	大陽日酸	63.2	154,840
日東富士製粉	0.5	3,180	カゴメ	25.6	68,812	レナウン	16.9	1,943	日本化学工業	2	6,380
昭和産業	6.2	20,026	焼津水産化工	3.2	3,366	クラウディアHLDGS	1.7	829	東邦アセチレン	1	1,354
鳥越製粉	6	5,670	アリアケジャパン	6.2	48,856	T S I -ホールディングス	22	12,166	日本パーカラライジング	33	38,511
中部飼料	8.2	11,398	ピエトロ	0.9	1,476	マツオカコーポレーション	1.9	4,174	高圧ガス	10.3	8,270
フィード・ワン	45.4	7,718	エバラ食品工業	1.6	3,497	ワールド	9.3	25,723	チタン工業	0.8	2,142
東洋精糖	1.1	1,249	やまみ	0.3	647	三陽商会	3.5	4,924	四国化成	10.1	13,069
日本甜菜糖	3.5	7,140	ニチレイ	32.1	82,850	ナイガイ	2.5	1,102	戸田工業	1.5	3,321
三井製糖	5.9	13,688	東洋水産	34.7	164,651	オンワードホールディングス	39.7	25,527	ステラ ケミファ	3.6	11,646
塩水港精糖	7.3	1,606	イトアンド	2.3	4,105	ルックホールディングス	2.2	2,712	保土谷化学	2.4	9,360
日新製糖	3.2	6,460	大冷	0.9	1,772	ゴールドウイン	11.9	94,486	日本触媒	10.2	70,074
森永製菓	15.8	88,638	ヨシムラ・フード・HLDGS	3.7	4,465	デサント	12.8	23,168	大日精化	5.8	18,734
中村屋	1.8	8,046	日清食品HD	28.7	236,201	キング	3.1	1,643	カネカ	17	60,605
江崎グリコ	20	101,800	永谷園ホールディングス	3.3	7,101	ヤマトインターナショナル	4.1	1,623	三菱瓦斯化学	62	106,888
名糖産業	3.2	4,208	一正蒲鉾	2.6	2,763	<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>			三井化学	59.6	157,940
井村屋グループ	2.9	5,968	フジッコ	7.3	14,680	特種東海製紙	4.2	17,031	J S R	61.2	118,116
不二家	3.8	8,413	ロックフィールド	7.3	10,804	王子ホールディングス	275.1	173,863	東京応化工業	11.3	46,047
山崎製パン	50.6	103,021	日本たばこ産業	389.5	980,176	日本製紙	29.1	56,308	大阪有機化学	6	8,394
第一屋製パン	1.2	1,194	ケンコーマヨネーズ	3.8	9,887	三菱製紙	7.5	3,810	三菱ケミカルHLDGS	439.8	359,976
モロゾフ	1.1	5,467	わらべや日洋HD	4.4	8,003	北越コーポレーション	43.6	24,808	K Hネオケム	11.6	29,162
亀田製菓	3.8	19,114	なとり	3.8	6,460	中越パルプ	2	4,608	ダイセル	89.9	97,991
寿スブリッツ	6.5	49,790	イフジ産業	1.2	933	巴川製紙	2.8	1,858	住友ペークライト	10.3	44,805
カルビー	30.7	109,292	ピックルスコーポレーション	1.5	4,177	大王製紙	28.9	43,176	積水化学	141.4	271,488
森永乳業	12.5	57,937	北の達人コーポ	23.5	16,544	阿波製紙	1.7	1,050	日本ゼオン	59.3	83,316
六甲バター	4.5	8,136	ユーグレナ	28.8	24,076	レンゴウ	62.2	51,377	アイカ工業	19.7	69,344
ヤフコ	46.4	302,992	ミヨシ油脂	2.5	3,227	トーモク	4.1	7,298	宇部興産	33.2	79,812

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
積水樹脂	11.8	26,974	ノエビアホールディングス	6.4	40,192	ロート製薬	34.5	120,922	日本電気硝子	27	64,260
タキロンシーアイ	14.3	9,666	アジパココスメジャパン	1.5	1,428	小野薬品	157.4	386,810	オハラ	2.7	3,944
旭有機材	3.7	6,364	エステー	4.3	7,464	久光製薬	19.8	107,118	住友大阪セメント	12.7	59,563
日立化成	30.4	122,056	アグロカネショウ	2.1	3,013	持田製薬	9.3	41,617	太平洋セメント	42.5	137,700
ニチパン	3.5	6,811	コニシ	10.9	16,208	参天製薬	125.1	258,206	日本ヒューム	6.8	5,582
リケンテクノス	16.4	8,364	長谷川香料	8.8	17,441	扶桑薬品	2.4	5,047	日本コンクリート	14.3	3,889
大倉工業	3.1	6,029	星光PMC	3.8	4,073	日本ケミファ	0.9	2,674	三谷セキサン	3.1	11,129
積水化成成品	8.8	7,040	小林製薬	18.8	169,952	ツムラ	20.8	66,456	アジアパイルHD	9.5	5,225
群栄化学	1.5	3,748	荒川化学工業	6	9,486	日医工	19	25,650	東海カーボン	70.4	76,665
日本カーボス ポリマー	3.4	2,026	メック	4.6	7,475	キッセイ薬品工業	11.8	35,990	日本カーボン	3.5	14,997
ミライアル	2.3	3,167	日本高純度化学	1.8	4,653	生化学工業	13	16,523	東洋炭素	3.9	9,465
ダイキアクシス	2.3	2,297	タカラバイオ	17.6	37,910	栄研化学	11.8	23,458	ノリタケ	3.7	17,612
ダイキョーニシカワ	13.8	11,923	JCU	8.1	23,911	水製薬	2.9	3,793	TOTO	48	229,680
竹本容器	2.3	2,392	新田ゼラチン	4.2	2,956	鳥居薬品	4.2	11,974	日本碍子	81.9	152,088
森六ホールディングス	3.5	8,326	OATアグリオ	1.1	1,736	JCRファーマ	4.7	43,945	日本特殊陶業	52.3	116,524
日本化薬	40.6	56,352	デクセリアルズ	17.2	18,834	東和薬品	8.6	24,415	ダントーホールディングス	5.4	621
カーリットホールディングス	7	4,410	アース製薬	5.1	29,070	富士製薬工業	4.5	6,345	MARUWA	2.6	19,630
日本精化	5.2	6,489	北興化学	6.8	3,998	沢井製薬	13.8	90,114	品川リフラクトリブ	1.8	5,796
扶桑化学工業	6.6	20,295	大成ラミック	2.2	6,270	ゼリア新薬工業	12.1	26,353	黒崎播磨	1.3	7,566
トリケミカル	1.5	11,700	クミアイ化学	27.7	28,447	第一三共	192.4	1,349,108	ヨータイ	5.3	3,678
ADEKA	30.2	50,434	日本農薬	11.9	6,997	キョーリン製薬HD	14.7	27,621	イソライト	3.4	2,359
日油	24.7	92,131	アキレス	4.6	8,399	大幸薬品	2.7	9,099	東京薬業	8.5	2,898
新日本理化	10.8	2,311	有沢製作所	10.5	10,479	グイト	3.9	12,382	ニッカラー	3	2,286
ハリマ化成グループ	5.4	6,717	日東電工	46.3	287,523	大塚ホールディングス	128	619,392	フジミンコーポレーション	6	17,334
花王	160.9	1,401,117	レック	7.2	9,360	大正製薬HD	14.2	116,156	クニミネ工業	2.8	3,346
第一工業製薬	2.4	8,940	三光合成	7.6	3,283	ペプチドリーム	34	173,740	エーアンドエーマテリアル	1.1	1,399
石原ケミカル	1.8	3,393	きよと	11.5	2,196	<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>			ニチアス	18.4	48,042
日藤化学	2.2	1,955	藤森工業	6	21,180	日本コークス工業	58.2	4,714	ニチハ	9.4	26,103
ニイタカ	1	1,705	前澤化成工業	4.2	5,027	ニチレキ	7.9	10,270	<b>鉄鋼 (0.8%)</b>		
三洋化成	3.9	21,411	未来工業	3.6	8,074	ユシロ化学	3.7	5,087	日本製鉄	297.5	484,478
有機合成薬品	5	1,535	ウェーブロックHLDGS	2.3	1,794	ビーピー・カストロール	2.4	3,717	神戸製鋼所	121.8	69,304
大日本塗料	7.4	8,628	ジェイ エス ピー	4	7,620	富士石油	17.9	4,260	中山製鋼所	9.2	4,572
日本ペイントHOLD	54.3	319,284	エフピコ	7.4	49,210	MORESCO	2.4	3,290	合同製鐵	3.6	9,482
関西ペイント	73.9	206,698	天馬	4.5	9,054	出光興産	75.6	224,229	JFEホールディングス	179.6	253,595
神東塗料	5	1,025	信越ポリマー	12	11,616	JXTGホールディングス	1,042.6	508,371	東京製鐵	32.3	27,002
中国塗料	18.6	19,232	東リ	16.7	5,277	コスモエネルギーHLDGS	19.5	46,683	共英製鋼	7.5	15,750
日本特殊塗料	4.9	6,742	ニフコ	24.6	75,030	<b>ゴム製品 (0.8%)</b>			大和工業	14.1	38,845
藤倉化成	8.8	5,033	バルカー	5.4	14,169	横浜ゴム	39	89,817	東京製鋼	2.7	4,136
太陽ホールディングス	4.8	20,040	ユニ・チャーム	129.6	470,966	TOYO TIRE	38.6	60,988	大阪製鐵	3.5	5,071
DIC	27.7	83,044	ショーエイコーポ	0.7	515	ブリヂストン	206.6	913,378	淀川製鋼所	9	19,161
サカタインクス	14.3	17,117	<b>医薬品 (6.0%)</b>			住友倉庫	60.4	85,284	丸一鋼管	21.6	68,688
東洋インキSCホールディン	13.8	36,997	協和キリン	67.5	158,017	藤倉コンポジット	5.8	2,743	モリ工業	2	5,008
T&K TOKA	5	5,010	武田薬品	559.3	2,511,816	オカモト	4.1	17,138	大同特殊鋼	10.9	54,118
富士フイルムHLDGS	128.9	667,959	アステラス製薬	591.2	1,122,097	フコク	3	2,142	日本高周波	2.4	1,036
資生堂	133.6	1,071,338	大日本住友製薬	49.8	105,725	ニッタ	7.6	24,282	日本冶金工	5.5	12,815
ライオン	87.4	192,629	塩野義製薬	85.9	559,810	住友理工	13	13,299	山陽特殊製鋼	4.7	7,185
高砂香料	4.2	10,844	田辺三菱製薬	80.9	162,042	三菱ベルト	8.8	18,576	愛知製鋼	3.7	13,468
マンダム	15.1	45,828	わかもと製薬	8.2	2,246	バンドー化学	11.8	10,926	日立金属	71.6	110,049
ミルボン	9	56,790	あすか製薬	7.6	10,047	<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>			日本金属	1.6	1,548
ファンケル	27.2	79,804	日本新薬	17.6	175,296	日東紡績	10	41,000	大平洋金属	4.5	10,881
コーサー	12.6	222,138	ピオフェルミン製薬	1.2	2,797	AGC	66.4	270,580	新日本電工	42.4	7,674
コタ	3.5	4,854	中外製薬	70	686,910	日本板硝子	32.2	20,897	栗本鉄工所	3.3	6,537
シーボン	0.9	2,267	科研製薬	11.5	68,655	石塚硝子	1.3	2,973	虹技	1	1,450
ポーラ・オルビスHD	28.7	78,121	エーザイ	80.5	649,796	日本山村硝子	2.8	3,592	日本鉄管	0.7	963

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
三菱製鋼	4.9	5,586	長府製作所	6.8	16,734	日阪製作所	8.1	8,100	栗田工業	36.3	113,800
日亜鋼業	9.6	3,283	リンナイ	12.9	108,747	やまびこ	12.9	14,718	橋本チエイン	9.6	36,672
日本精練	1.1	3,294	ダイニチ工業	3.5	2,404	平田機工	3.1	24,707	大同工業	3.2	2,678
エンビプロHD	2.5	1,905	日東精工	9.1	5,951	ペガサスミシン製造	6.7	3,437	木村化工機	5.5	3,426
シンニッタン	10.3	4,593	三洋工業	0.9	1,835	マルマエ	2.7	2,816	アナスト岩田	10.4	10,566
新家工業	1.5	2,164	岡部	13.5	12,501	タツモ	3.1	3,713	ダイフク	34.3	226,037
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>			ジーテクト	8.3	14,408	ナプテスコ	39.2	133,672	サムコ	1.8	2,188
大紀アルミニウム	10.8	8,456	東プレ	12.4	21,439	三井海洋開発	7.1	17,728	加藤製作所	3.7	6,811
日本軽金属HD	168.2	38,181	高周波熱練	12.7	11,264	レオン自動車	6.5	10,770	油研工業	1.1	1,870
三井金属	17.9	49,421	東京製綱	4.8	5,548	SMC	21.1	1,053,523	タダノ	32.4	35,348
東邦亜鉛	3.4	7,259	サンコール	3.7	1,809	ヤマハモーターロッドHLDGS	5.8	3,271	フジテック	24.4	42,578
三菱マテリアル	43.9	129,592	モリテックスチル	5.2	2,230	ホンカワミクロン	2.3	10,384	C K D	18.7	34,688
住友鉱山	84.9	280,254	パイオラックス	9.8	21,716	ユニオンツール	2.5	8,225	キトー	5.1	8,420
DOWAホールディングス	16.8	66,360	エイチエフ	6.5	5,492	ユニレス工業	8.6	14,551	平和	18.8	42,657
古河機金	11.8	17,888	日本発条	71.3	70,016	日精工エースビー	2.2	10,769	理想科学工業	5.9	11,168
エス・サイエンス	29.7	1,514	中央発條	0.8	2,332	サトーホールディングス	9.5	32,015	SANKYO	15	55,800
大阪チタニウム	6.9	10,853	アドバネクス	0.9	1,486	技研製作所	5.8	25,752	日本金銭機械	7.4	6,874
東邦チタニウム	11.9	11,543	立川ブラインド	2.9	4,167	日本エアテック	2.1	1,484	マースグループHLDGS	4.3	8,754
UACJ	10.1	25,118	三益半導体	5.9	11,870	カワタ	1.9	2,173	福島工業	4.2	14,700
CKサンエツ	1.4	4,207	<b>機械 (5.1%)</b>			日精樹脂工業	5.5	5,643	オーイズミ	2.8	1,610
古河電工	20.7	62,721	日本ドライケミカル	1.6	2,339	オカグアイオン	2.1	2,601	ダイコク電機	3.1	5,214
住友電工	248.4	415,945	日本製鋼所	20.2	45,753	ワイエシイホールディングス	2.9	2,073	竹内製作所	11.2	18,950
フジクラ	80.3	36,857	三浦工業	28.7	106,046	小松製作所	304.4	787,482	アミノ	17.6	57,816
昭和電線HLDGS	7.7	7,815	タクマ	22.5	28,755	住友重機械	38.4	121,536	JUKI	9.3	8,500
東京特殊電線	1	2,237	ツガミ	13.7	15,494	日立建機	26.9	79,381	サンデンホールディングス	8.8	6,740
タツタ電線	13.2	7,748	オークマ	7.7	47,355	日工	9.1	6,834	蛇の目ミシン	6.3	2,576
カナレ電気	1.1	2,066	東芝機械	7.5	21,007	巴工業	2.8	6,389	マックス	10.2	21,481
平河ヒューテック	2.5	3,385	アマダホールディングス	84.3	105,122	井関農機	6.7	11,101	グローリー	18.6	61,938
リョービ	8.2	17,244	アイダエンジニア	17.9	17,935	TOWA	6.8	7,820	新晃工業	6.3	11,913
アールステイ	8.7	4,645	滝澤鉄工所	2	2,794	丸山製作所	1.5	1,857	大和冷機工業	9.7	12,532
アサヒHD	11.7	30,501	F U J I	28.5	55,489	北川鉄工所	3	6,804	セガサミーホールディングス	66.7	105,719
<b>金属製品 (0.6%)</b>			牧野フライス	7.8	42,198	ロウツェ	2.9	11,382	日本ピストンリング	2.5	3,602
稲葉製作所	3.7	5,294	オーエスジー	30.7	69,289	タカキタ	2.3	1,278	リケン	3.1	13,314
宮地エンジニアリングG	2	4,170	ダイジェット	0.7	1,029	クボタ	356.6	615,313	T P R	9.1	19,028
トーカロ	18.4	20,460	旭ダイヤモンド	17.3	11,348	荏原実業	1.7	3,852	ツバキ・ナカシマ	13.7	23,509
アルファCO	2.3	3,015	DMG森精機	42.1	73,801	三菱化工機	2.3	4,383	ホシザキ	19.7	189,317
SUMCO	79.6	134,603	ソデイツク	15.6	15,943	月島機械	12.4	21,154	大豊工業	5.5	4,807
川田テクノロジーズ	1.4	9,590	ディスコ	9	211,950	帝国電機製作所	5.5	7,271	日本精工	126.6	136,348
RS TECHNOLOGIES	1.9	7,058	日東工器	3.6	8,017	東工機械	2.7	1,001	NTN	155.7	53,872
信和	2.8	3,080	日進工具	1.9	4,417	新東工業	15.8	16,400	ジェイテクト	64.4	89,129
東洋製罐グループHD	42.3	82,146	パンチ工業	5.9	3,386	渋谷工業	5.9	18,644	不二越	6.2	31,868
ホッパホールディングス	3.6	7,056	富士ダイス	2.9	1,919	アイチ コーポレーション	11.5	8,314	日本トムソン	19.8	9,880
コロナ	3.7	4,403	豊和工業	3.6	2,692	小森コーポレーション	16.9	19,620	T H K	39.1	121,992
横河ブリッジHLDGS	12.4	23,448	OKK	2.8	1,898	鶴見製作所	5.2	10,691	ユーシン精機	5.2	5,506
駒井バルテック	1.2	2,034	石川製作所	1.6	2,155	住友精密	1	3,450	前澤給装工業	2.4	5,152
高田機工	0.6	1,552	東洋機械金属	4.7	2,693	日本ギア工業	2	828	イーグル工業	8.4	9,122
三和ホールディングス	63.7	77,714	津田駒工業	1.3	1,683	酒井重工業	1.3	3,984	前澤工業	4.4	1,720
文化シャッター	19.6	19,031	エンシユウ	1.6	2,185	荏原製作所	29.6	99,012	日本ピラー工業	6.8	10,281
三協立山	9.2	11,481	島精機製作所	10.7	29,735	石井鉄工所	0.9	2,285	キッツ	27.2	20,726
アルインコ	4.8	5,745	オプトラン	7.4	21,704	西島製作所	6.7	6,445	マキタ	87.6	324,558
東洋シャッター	1.6	1,209	NCホールディングス	2	1,228	北越工業	6.9	8,818	日立造船	53.3	23,185
LIXILグループ	98.1	184,918	イワキポンプ	3.1	3,552	ダイキン工業	85.6	1,349,912	三菱重工業	112.6	477,874
日本フィルコン	5	2,650	フリュー	6.4	6,720	オルガン	2.4	15,696	I H I	48.4	125,065
ノーリツ	13.8	19,430	ヤマシンフィルタ	14.4	12,614	トーヨーカネツ	2.9	6,623	スター精密	10.5	16,264

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
<b>電気機器 (14.2%)</b>	千株	千円	E I Z O	千株	千円	メガチップス	千株	千円	豊田自動織機	千株	千円
日清紡ホールディングス	44.8	45,651	ジャパンディスプレイ	5.2	21,736	OBARA GROUP	6.3	15,510	モリタホールディングス	54.4	351,968
イビデン	41.1	105,996	日本信号	61.7	4,380	澤藤電機	3.5	13,597	三桜工業	11.7	20,545
コニカミノルタ	146.9	106,649	京三製作所	17.1	22,298	原田工業	0.8	1,706	デンソー	8.5	11,390
ブラザー工業	82.1	180,702	能美防災	15.8	8,152	コーセル	3.2	3,120	東海理化電機	148	733,044
ミネベアミツミ	124.7	269,227	ホーチキ	8.9	21,208	アイ・オー・データ	8.1	10,133	三井E&S HD	17.7	38,285
日立	323	1,391,807	星和電機	4.9	8,168	リソソ電子工業	5.6	29,680	川崎重工業	21.7	20,007
三菱電機	672.2	1,031,490	エレコム	3.4	1,897	オプテックスグループ	11	17,842	名村造船所	52.3	129,756
富士電機	40.5	138,712	パナソニック	7.3	30,258	千代田インテグレ	3.1	7,424	サナヤホールディングス	21.5	6,170
東洋電機製造	2.6	4,069	シャープ	768	792,576	アイ・オー・データ	2.5	2,555	日本車輛	8	1,448
安川電機	72.3	293,899	アンリツ	77.8	128,836	スタンレー電気	13.8	132,204	三菱ロジスネクスト	2.4	7,620
シンフォニア テクノロジー	8.7	11,979	富士通ゼネラル	43.3	89,717	岩崎電気	47.4	147,177	近畿車輛	10.5	12,873
明電舎	12.4	26,635	ソニー	18.3	38,558	ウシオ電機	2.6	3,705	日産自動車	1	1,501
オリジン	1.8	2,730	T D K	424.9	2,973,450	岡谷電機	38.9	63,912	いすゞ自動車	792.8	545,684
山洋電気	3.2	17,472	帝国通信工業	32.4	378,756	ヘリオステクノH	5.2	1,981	トヨタ自動車	194.8	251,389
デンヨー	5.7	11,913	タムラ製作所	3	3,615	エノモト	6.1	3,050	日野自動車	749.2	5,797,309
東芝テック	8.4	37,464	アルプスアルパイン	22.3	14,718	日本セラミック	2	2,310	三菱自動車工業	84	92,568
芝浦メカトロニクス	1.2	4,764	池上通信機	59.5	147,976	遠藤照明	6.8	19,454	エフテック	249.2	123,603
マブチモーター	18.5	78,162	日本電波工業	2.1	2,196	古河電池	3.4	2,393	レシップホールディングス	4.7	3,548
日本電産	80.9	1,320,692	鈴木	6	4,008	双信電機	4.8	3,758	GMB	2.6	1,713
ユー・エム・エレクトロニクス	4	2,192	日本トリム	3.6	2,937	ファルテック	3.2	1,638	武蔵精密工業	1.2	954
トックス・セミコンダクター	3.9	5,729	ローランド ディー・ジー	0.9	4,464	図研	4.8	7,656	日産車体	1.2	1,512
東光高岳	3.7	4,428	フオスター電機	3.7	8,047	日本電子	4.4	11,044	新明和工業	15	22,845
ダブル・スコープ	10.1	8,413	S M K	7	14,161	カシオ	13.3	41,097	極東開発工業	13.1	14,907
宮越ホールディングス	2.5	2,570	ヨコオ	1.7	5,064	ファナック	59.5	123,760	日信工業	18	26,280
ダイエー	7.4	27,343	ティアック	4.3	13,996	日本シイエムケイ	63.9	1,357,236	トビー工業	12.5	20,387
ヤーマン	9.8	6,879	ホシデン	4.9	1,131	エンプラス	15.7	10,330	ティラド	13.5	30,024
J V Cケンウッド	54.9	15,097	ヒロセ電機	18.3	24,119	大真空	3.4	12,410	タチエス	5.6	11,670
ミマキエン지니어リング	6	3,168	日本航空電子	10.4	142,584	ローム	2.4	3,957	NOK	2.4	4,884
第一精工	2.4	6,348	T O A	15.4	32,401	浜松ホトニクス	29.8	273,266	フタバ産業	11	15,862
日新電機	15.8	18,201	マクセルホールディングス	7.2	7,920	三井ハイテック	48.2	214,731	K Y B	36.1	62,416
大崎電気	13.3	9,908	古野電気	14.5	21,663	新光電気工業	7.4	15,177	大同メタル工業	18.8	15,528
オムロン	62.5	408,750	ユニデンホールディングス	8.7	10,988	京セラ	22.6	24,769	プレス工業	7.5	24,862
日東工業	9.9	24,789	スマグコーポレーション	1.8	3,306	太陽誘電	94.5	703,552	ミクニ	13	9,464
I D E C	9.7	22,940	アイコム	5.1	6,757	村田製作所	29.9	88,952	太平洋工業	33.3	14,785
正興電機製作所	1.6	1,331	リオン	3.7	9,575	双葉電子工業	197.5	1,289,477	ケーヒン	8.6	2,967
不二電機工業	0.8	1,020	本多通信工業	2.8	8,299	北陸電気工業	10.5	14,584	河西工業	14.1	21,333
ジーエス・エアサ コーポ	22.4	51,609	船井電機	5.7	3,106	ニチコン	2.7	3,034	アイシン精機	9.1	7,944
サクサホールディングス	1.5	2,967	横河電機	6.8	5,032	日本ケミコン	22.7	28,034	マツダ	55.4	235,173
メルコホールディングス	2.3	7,130	新電元工業	61.7	124,263	K O A	5.1	10,613	今仙電機製作所	197.9	193,348
テクノメディカ	1.5	3,151	アズビル	2.4	8,844	市光工業	10.1	14,544	本田技研	6.3	5,928
日本電気	81.5	361,860	東亜ディーケーケー	42.4	135,044	小糸製作所	10	8,680	スズキ	529.3	1,642,947
富士通	64.8	651,240	日本光電工業	3.3	2,838	ミツバ	40.3	229,710	S U B A R U	133.2	633,366
沖電気	27.3	41,769	チノー	27.8	82,538	SCREENホールディングス	12.4	9,188	安永	208.7	599,699
岩崎通信機	2.9	2,334	共和電業	2.3	3,270	キャノン電子	11.7	88,920	ヤマハ発動機	3.2	4,137
電気興業	3.2	9,968	日本電子材料	7	3,101	リコー	361.8	1,102,042	ショーフ	87.7	202,323
サンケン電気	7.3	23,141	堀場製作所	2.7	2,343	象印マホービン	171.1	192,316	T B K	15.7	35,748
ナカヨ	1.3	2,177	アドバンテスト	13.3	97,755	MUTOHホールディングス	19.7	35,420	エクセディ	8	3,448
アイホン	3.8	7,242	小野測器	50	266,000	東京エレクトロン	1	1,796	豊田合成	9.2	23,073
ルネサスエレクトロニクス	320.7	230,583	エスベック	2.8	1,503	輸送用機器 (7.8%)	44.8	1,011,136	愛三工業	21.7	56,506
セイコーエプソン	83.4	138,610	キーエンス	5.9	12,578	トヨタ紡織	19.6	33,829	盟和産業	10.6	9,179
ワコム	45.3	20,294	日置電機	60.9	2,312,373	芦森工業	1.4	1,948	日本プラスト	5	3,733
アルバック	13.4	57,620	シスメックス	3.5	13,090	ユニプレス	13	21,944	ヨロズ	1.2	1,122
アクセル	2.8	1,976	日本マイクロニクス	48	372,528				6.3	9,109	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
エフ・シー・シー	11	26,532	萩原工業	3.7	5,982	東邦瓦斯	33.3	138,861	NSユニテッド海運	3.5	8,116
シマノ	25.2	451,584	トッパン・フォームズ	14.4	16,732	北海道瓦斯	3.6	5,709	明治海運	6.7	2,291
テイ・エス テック	15.6	53,274	フジールインターナショナル	15.1	37,553	広島ガス	14.1	5,061	飯野海運	30.4	10,944
ジャムコ	3.4	5,134	タカラトミー	30.1	40,484	西部瓦斯	7.6	19,152	共栄タンカー	0.6	1,066
<b>精密機器 (2.3%)</b>			廣済堂	4.7	4,136	静岡ガス	19.1	17,724	乾汽船	3.7	4,247
テルモ	190.2	743,682	エステールホールディングス	1.9	1,290	メタウォーター	3.2	13,024	<b>空運業 (0.5%)</b>		
クリエートメディック	2.2	2,345	アーク	26.1	2,531	<b>陸運業 (4.6%)</b>			日本航空	116.6	395,390
日機装	20.1	27,094	タカノ	2.6	2,139	SBSホールディングス	5.8	11,408	ANAホールディングス	116.4	437,431
日本エム・ディ・エム	3.9	9,075	プロネクス	5.8	6,994	東武鉄道	70.9	287,499	パスコ	1.2	2,232
島津製作所	80.3	266,194	ホクシン	4.2	722	相鉄ホールディングス	21.5	65,360	<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>		
JMS	5.6	4,160	ウッドワン	2.3	2,734	東急	169.5	369,001	トランコム	1.8	14,040
クボテック	1.7	742	大建工業	4.6	9,080	京浜急行	86.3	193,484	日新	5.5	9,586
長野計器	4.9	3,836	凸版印刷	94.8	206,474	小田急電鉄	100	270,800	三菱倉庫	20.2	57,267
パイ・テクノロジー	3.1	18,631	大日本印刷	87.9	258,426	京王電鉄	34.9	246,394	三井倉庫HOLD	7.3	14,592
東京計器	4.2	4,263	共同印刷	2.1	6,195	京成電鉄	46.8	212,238	住友倉庫	23.5	35,485
愛知時計	0.9	3,874	N I S S H A	13.8	15,635	富士急行	9.2	39,238	渋沢倉庫	3.5	7,521
インターアクション	3.6	9,007	光村印刷	0.6	1,061	新京成電鉄	1.8	4,145	東陽倉庫	11.3	3,796
オーバル	6	1,512	TAKARA & COMPANY	3.2	5,446	東日本旅客鉄道	118.3	1,193,055	日本トランスシティ	14.1	7,726
東京精密	12.2	48,007	アシックス	55.5	99,123	西日本旅客鉄道	59.9	579,532	ケイヒン	1.2	1,593
マニー	26.8	78,658	ツツミ	2.1	4,403	東海旅客鉄道	55.9	1,243,495	中央倉庫	3.9	4,828
ニコン	108.8	163,852	小松ウォール工業	2	4,816	西武ホールディングス	90.2	174,086	川西倉庫	1.2	1,264
トプコン	33.9	49,866	ヤマハ	40	245,200	鴻池運輸	10.7	17,794	安田倉庫	5.2	5,174
オリンパス	372	607,848	河合楽器	2.1	7,717	西日本鉄道	18.7	49,162	フェイスホールディングス	1.3	832
理研計器	5.9	13,717	クリナップ	6.2	4,371	ハマキョウレックス	5.2	19,058	東洋埠頭	1.9	2,682
タムロン	5.4	13,656	ピジコン	40.6	205,842	サカイ引越センター	3.5	24,395	宇徳	5.4	2,899
HOYA	135.3	1,356,382	兼松サステック	0.4	712	近鉄グループHLDGS	63.7	391,755	上組	36.4	88,961
シード	2.9	3,129	キングジム	5.6	4,995	阪急阪神HLDGS	84.9	402,850	サンリツ	1.5	1,050
ノーリツ鋼機	4.5	8,532	リントック	16	39,408	南海電鉄	30.2	91,808	キムラユニティー	1.7	1,873
エー・アンド・デイ	6.1	4,898	イトーキ	14.3	7,393	京阪ホールディングス	28.3	154,235	キューソー流通システム	1.6	3,003
朝日インテック	57	182,115	任天堂	41.2	1,781,488	神戸電鉄	1.6	6,384	近鉄エクスプレス	13.5	26,244
シチズン時計	78.7	48,007	三菱鉛筆	11.1	19,280	名古屋鉄道	52.4	183,138	東海運	3.6	1,018
リズム時計	2.1	1,971	タカラスタンダード	13.9	27,897	山陽電鉄	4.6	10,340	エアイティー	4.5	4,356
大研医器	4.6	2,898	コクヨ	32.3	52,810	日本通運	22.5	157,725	内外トランスライン	2.2	3,236
メニコン	9.2	40,020	ナカバヤシ	6.6	3,920	ヤマトホールディングス	111.6	212,151	日本コンセプト	2	2,860
シンシア	0.8	486	グローブライド	3	8,109	山丸	17.7	100,713	<b>情報・通信業 (8.5%)</b>		
松風	3	5,100	オカムラ	23.5	25,380	丸連	3.6	986	NECネットエスアイ	6.2	21,359
セイコーHD	9.5	26,752	美津濃	6.1	17,110	丸全昭和運輸	5.2	16,172	クロスキャット	1.7	1,700
ニプロ	46.6	61,838	<b>電気・ガス業 (1.5%)</b>			センコーグループHLDGS	35.2	32,278	システナ	23.5	41,266
<b>その他製品 (2.3%)</b>			東京電力HD	536.7	259,226	トニーホールディングス	1.5	7,680	デジタルアーツ	3.2	20,224
中本パックス	1.7	2,533	中部電力	205.6	315,698	ニッコンホールディングス	22.8	62,244	日鉄ソリューションズ	9.9	37,719
スノーピーク	3	3,288	関西電力	254.7	318,629	臼石輸送	0.7	1,946	キューブシステム	3.5	2,793
パラマウントベッドHD	7.1	30,601	中国電力	93	135,408	福山通運	8.1	33,898	エイジア	1.2	1,582
トランザクション	4.3	4,300	北陸電力	61.6	48,664	セイノーホールディングス	47.7	70,548	コア	2.8	4,046
S H O - B I	2	790	東北電力	168	185,640	エスライン	1.9	1,894	ソリトンシステムズ	2.9	3,187
ニホンフラッシュ	3.1	8,738	四国電力	60.6	64,175	神奈川中央交通	1.6	6,424	ソフトクリエイトHD	2.9	5,173
前田工業	7.4	14,430	九州電力	138.7	134,677	日立物流	11.7	36,387	T I S	22	145,420
永大産業	8.7	2,966	北海道電力	63	33,516	丸和運輸機関	6.7	17,219	ネオス	2.6	2,152
アートネイチャー	7.2	5,565	沖縄電力	12.5	25,037	C&Fロジホールディングス	6.4	9,011	電算システム	2.5	7,462
パナダイナムHLDGS	69.5	464,816	電源開発	53.5	143,273	九州旅客鉄道	56.8	214,704	グリー	45.5	23,796
アイフィスジャパン	1.7	1,320	エフオン	3.1	2,433	SGホールディングス	66.8	175,884	コーエーテックモHD	13.5	36,234
共立印刷	11.6	1,902	イーレックス	9.5	16,596	<b>海運業 (0.2%)</b>			三菱総合研究所	2.8	11,732
S H O E I	3.2	16,192	レノバ	11.1	12,876	日本郵船	53.3	102,602	ボルテージ	1.3	692
フランスベッドHLDGS	9.5	9,709	東京瓦斯	129.2	342,767	商船三井	40.3	118,562	電算	0.7	1,522
パイロットコーポレーション	11.7	49,959	大阪瓦斯	130.4	270,840	川崎汽船	19.6	36,828	AGS	3.7	2,941

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
ファインデックス	5.5	6,567	マークライズ	3.3	6,897	ジャストシステム	10.7	60,562	光通信	6.8	175,984
プレインパッド	1.3	7,475	メディカル・データ・ビジ	5	4,920	TDCソフト	5.8	5,214	NTTドコモ	487.3	1,465,311
K Lab	12.7	10,795	gumi	8.4	6,056	Zホールディングス	905.7	346,883	エムティアイ	6.4	4,428
ポルトゥウィン・ピットクル	8	8,592	ショーケース	1.5	1,009	トレンドマイクロ	29.3	175,800	GMOインターネット	26	58,994
イーブイアジアティブ	0.9	1,848	モバイルファクトリー	1.5	2,094	IDホールディングス	2.5	3,600	ファイバーゲート	1.3	1,800
ネクソン	187.7	281,737	テラスカイ	2.4	6,842	アルオラクル	13.4	134,402	アйдママーケティングコミュ	2	2,454
アイススタイル	17	13,753	デジタル・インフォメーション	2.9	4,912	アルファシステムズ	2.1	5,888	KADOKAWA	17.8	31,612
エムアップ	1.9	4,911	PCIホールディングス	1.3	2,889	フューチャー	8	14,760	学研ホールディングス	2.2	16,478
エイチーム	4.5	5,121	パイプHD	0.8	1,507	CAC HOLDINGS	4.3	6,759	ゼンリン	13.1	24,981
エニゴモ	4.6	4,862	アイビーシー	1.2	1,508	S Bテックノロジー	2.4	4,778	昭文社	3.1	1,305
テクノスジャパン	5.1	2,677	ネオジャパン	1.2	1,242	トーセ	1.8	1,684	インプレスホールディングス	5.3	969
enish	2.9	1,847	P R T I M E S	0.6	1,477	オービックビジネスC	6.7	32,763	アイネット	3.4	5,185
コプロラ	15.6	27,496	ランドコンピュータ	1	1,074	伊藤忠テクノソリューション	30	88,530	松竹	4.4	71,412
オルトプラス	4.9	4,018	ダブルスタンダード	0.8	4,400	アイティフォー	8	7,032	東宝	39.4	175,921
ブロードリーフ	32.7	23,184	オープンドア	3.3	5,887	東計電算	1	3,640	東映	2.5	42,925
クロス・マーケティングG	2.9	1,070	マイネット	2.1	1,232	エックスネット	1	964	NTTデータ	175.6	266,560
デジタルハーツHLDGS	3.5	3,577	アカツキ	23	14,766	大塚商社	35.7	157,794	ピー・シー・イー	0.8	3,584
システム情報	3.3	3,676	ベネフィットジャパン	0.5	742	サイボウズ	7.7	9,224	ビジネスB 太田昭和	1.1	2,614
メディアドゥハLDGS	2.2	8,272	UBICOMホールディングス	1.4	1,762	ソフトブレイン	3.8	2,154	D T S	14.7	34,574
じげん	16.3	9,030	L I N E	15.1	77,614	電通国際情報S	4.1	17,240	スクウェア・エニックス・HD	28.1	153,707
ブイキューブ	4	2,188	カナミックネットワーク	4	2,904	デジタルガレージ	11.9	49,206	シーイーシー	7.1	16,053
エンカレッジ・テクノロジー	1.1	897	ノムラシステムコーポレーション	1.4	781	イーエムシステムズ	4.6	9,466	カプコン	31.1	81,575
サイバーリンクス	1	1,295	チェンジ	1.3	3,270	ウェザーニューズ	2.2	7,568	アイ・エス・ピー	1.3	2,593
ディー・エル・イー	4.3	786	シンクロ・フード	2.8	1,486	C I J	4.9	4,924	ジャステック	4.2	4,704
フィックススターズ	7	11,396	オークネット	4.1	5,514	ビジネスエンジニアリング	0.7	2,124	S C S K	15.2	87,704
CARTA HOLDINGS	3.2	4,358	セグエグループ	1.1	942	日本エンタープライズ	6.6	1,531	日本システムウエア	2.2	5,662
オプティム	1.7	5,924	イトレッド	0.8	1,210	WOWOW	3.2	8,643	アイネス	6.5	8,872
セレス	2.1	2,559	AOI TYO HOLDINGS	6.7	4,629	スカラ	4.6	3,620	T K C	5.6	28,728
ティーガイア	5.9	15,452	マクロミル	11.8	12,095	インテリジェントウェイブ	2.4	1,790	富士ソフト	8.4	35,910
セック	1	3,885	ビーグリー	1.3	1,667	IMAGICA GROUP	5.6	3,606	NSD	10.8	38,772
日本アジアグループ	6.9	2,649	オロ	1.7	7,301	ネットワンシステムズ	25.1	79,065	コナミホールディングス	24	116,640
豆蔵ホールディングス	4.5	6,493	テモナ	0.8	384	システムソフト	15.4	1,724	福井コンピュータHLD	2.6	10,075
テクマトリックス	4.6	10,695	ニーズウェル	0.8	554	アルゴグラフィックス	5.6	18,676	J B C Cホールディングス	4.5	8,383
プロシッパ	1.9	2,479	サインポスト	1	1,833	マーベラス	10	7,580	ミロク情報サービス	5.8	19,633
ガンホー・オンライン・エンター	15.9	38,112	ソルクシーズ	2.8	2,662	イーベックス	11.4	15,207	ソフトバンクグループ	523.5	2,217,546
GMOベイメントゲートウェイ	10.9	86,219	フェイス	2.3	1,987	日本ユニシス	20.6	74,057	<b>卸売業 (5.0%)</b>		
ザッパラス	3.5	1,487	プロトコーポレーション	5.9	6,141	兼松エレクトロニクス	3.6	12,330	ハウスイ	0.6	522
システムリサーチ	1.7	3,109	ハイマックス	0.8	1,521	東京放送HD	40.1	70,175	高千穂交易	2.5	2,732
インターネットアジアティブ	9.8	25,019	野村総合研究所	110.2	254,451	日本テレビHLD S	55.1	80,005	伊藤忠食品	1.7	8,874
さくらインターネット	7	4,648	サイバネットシステム	4.7	3,684	朝日放送グループHD	6.6	4,943	エレマテック	6.1	6,447
ヴィンクス	1.9	2,395	C Eホールディングス	3.8	1,778	テレビ朝日HD	18.1	32,018	J A L U X	1.9	4,789
GMOクラウド	1.2	3,500	日本システム技術	1.1	1,389	スカパー J S A T H D	43.5	20,184	あらた	5.3	22,869
S R Aホールディングス	3.5	8,911	インテジホールディングス	8.2	7,904	テレビ東京HD	5.4	12,436	トーマンデバイス	1	2,825
MINORIソリューションズ	1.2	3,235	東邦システムサイエンス	1.7	1,615	日本BS放送	2.2	2,384	東京エレクトロンデバイス	2.4	5,412
システムインテグレート	2.1	1,856	ソースネクスト	31.3	15,368	ビジョン	6.1	10,937	フィールズ	5.1	2,544
朝日ネット	4.6	2,842	インフォコム	7.2	17,769	スマートパリユー	1.9	1,546	双日	366.3	128,571
e B A S E	3.9	4,668	ラクスル	3.5	12,827	USEN-NEXT HLDGS	2.5	2,777	アルフレッサホールディングス	73.5	169,270
アパント	4.7	4,869	F I G	7.1	2,222	ワイヤレスゲート	3.1	2,042	横浜冷凍	18.6	20,088
アドソール日進	2.3	5,485	アルテリア・ネットワークス	7.3	11,877	コネクシオ	3.8	5,795	神栄	1	746
フリンベイト	3.9	3,638	ヒト・コミュニケーションズHD	1.5	2,400	日本通信	51.1	11,242	ラサ商事	3.5	3,115
コムチュア	7.4	17,774	フォーカスシステムズ	4	3,608	クロップス	1.2	900	ラークンホールディングス	3.2	2,249
サイバーコム	1.2	2,550	クレスコ	2	7,160	日本電信電話	440.9	2,468,158	アルコニックス	7	10,129
アステリア	4.1	2,652	フジ・メディア・HD	63.6	95,209	KDD I	491.6	1,548,540	神戸物産	22.8	77,292
アイル	2.3	3,744	オービック	22.9	334,569	ソフトバンク	599.6	889,506	あいホールディングス	9.5	18,971

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
ディービーエックス	千株	千円	マルカ	千株	千円	クワザウ	千株	千円	ハードオフコーポレーション	千株	千円
2.3	2,194	17.8	2.3	5,285	14.1	2.4	1,454	2.6	2.6	2,106	
ダイブオウHD	5.6	31,248	I DOM	17.8	9,434	ワキタ	14.1	15,439	アスクル	6.9	20,734
15.8	29,609	3.9	9,172	21.2	53,784	東邦ホールディングス	21.2	53,784	グオホールディングス	11.9	15,684
ラクト・ジャパン	2.5	8,700	進和	1.4	652	サンゲツ	18.2	38,857	アダストリア	9.2	23,331
12.4	13,739	2.8	4,751	9.7	13,774	ミツウロコグループ	9.7	13,774	ジーフット	4.1	2,550
八洲電機	5.1	4,498	シークス	8.4	13,053	シネンホールディングス	2.7	5,216	シー・ワイ・エス・バイエリア	1.1	738
3.8	3,154	2.1	1,497	14.7	13,156	伊藤忠エネクス	14.7	13,156	くら寿司	3.4	16,609
6.9	14,048	3.7	5,409	18.6	41,552	サンリオ	18.6	41,552	キャンドウ	3.1	5,068
1.5	1,630	2.3	3,330	4.6	5,515	サンウ テクノス	4.6	5,515	パルグループHLDGS	3.4	12,155
2.8	1,940	463	1,128,794	7.3	21,513	リョーサン	7.3	21,513	エディオン	30.4	36,084
1.9	2,661	689.4	568,892	10.3	9,270	新光商事	10.3	9,270	サーコーポレーション	13.5	8,410
35	38,780	1.1	1,893	3	5,619	トーホー	3	5,619	ワッツ	2.9	1,786
黒谷	1.5	675	長瀬産業	37.1	60,398	三信電気	3.5	5,950	ハローズ	2.5	6,450
Cominix	1.1	902	蝶理	4.2	8,290	東陽テクニカ	7.6	8,664	フジオードシステム	2.8	9,996
三洋貿易	3.3	7,761	豊田通商	73.9	287,101	モスフード サービス	8.7	26,709	あみやき亭	1.4	5,103
1.1	2,304	10	6,010	6.6	16,288	加賀電子	6.6	16,288	ひらまつ	12.1	3,690
4.8	7,132	24.8	35,017	6.8	4,154	兼松	6.8	4,154	大黒天物産	1.6	5,136
2	1,502	1.2	1,300	4.8	8,438	ツカモトコーポレーション	4.8	8,438	ハニーズホールディングス	5.8	8,062
10.6	48,548	581.8	1,144,691	2.9	3,071	三井物産	2.9	3,071	ファーマライズHD	1.5	951
2.1	3,276	3.8	15,428	10.6	57,240	日本紙パルプ	10.6	57,240	アルペン	5	9,200
2.4	1,653	23	164,910	8.7	3,010	日立ハイテクノロジーズ	8.7	3,010	ハブ	1.9	1,962
1.5	892	8.6	10,552	2.6	2,100	カメイ	2.6	2,100	クオールホールディングス	9.8	15,523
14.4	30,600	0.9	2,395	1.2	4,698	東都水産	0.9	2,395	ジンスホールディングス	3.5	23,520
2	1,486	1	2,719	0.6	901	OUGホールディングス	1	2,719	ビックカメラ	39.3	47,670
0.8	1,232	2.5	11,012	15.7	4,725	スターゼン	2.5	11,012	DCMホールディングス	35.8	38,270
5.9	7,953	25.9	27,065	3.3	4,963	山善	25.9	27,065	ペッパーフードサービス	5.3	7,006
1.4	2,525	1.2	4,824	0.7	1,229	樺本興業	1.2	4,824	Monotaro	47.1	145,303
4.8	4,392	417.8	692,085	4.8	24,336	住友商事	417.8	692,085	東京一番フーズ	1.6	1,001
1.7	921	2.8	14,672	2	5,838	内田洋行	2.8	14,672	DDホールディングス	2.6	4,074
4	5,244	464.5	1,350,533	13.8	38,626	三菱商事	464.5	1,350,533	きちりホールディングス	1.7	1,441
5.1	5,620	3.2	11,888	24.5	44,124	第一実業	3.2	11,888	アークランドサービスHD	4.8	8,980
3.8	2,052	18.9	47,439	4.8	3,840	キャノンマーケティングJPN	18.9	47,439	J. フロント リテイリング	79.1	116,514
9.6	24,585	3.7	5,213	10.4	38,116	西華産業	3.7	5,213	ドトール・日レスHD	10.5	23,446
7.3	21,403	5.4	4,924	1.2	1,101	佐藤商事	5.4	4,924	マツモトキヨシHLDGS	27.4	115,080
4.8	7,521	6.8	13,912	3.9	4,102	松田産業	6.8	13,912	ブロンコビリー	3.4	9,319
9.8	53,116	5.9	3,309	12.5	25,050	第一興商	5.9	3,309	ZOZO	45.5	100,373
71.4	169,360	6.3	22,050	6.1	3,946	メディアパルHD	6.3	22,050	トレジャー・ファクトリー	1.9	2,128
1.4	3,990	1.7	4,511	5.9	12,366	S P K	1.4	3,990	物語コーポレーション	1.6	13,808
2.4	6,792	3.9	1,220	5	1,440	萩原電気HLDGS	2.4	6,792	ココカラファイン	6.9	44,436
4.3	41,108	12.4	35,216	3.5	7,017	アズワン	4.3	41,108	杉本商事	3.5	7,017
2.3	3,367	4.3	14,555	18.8	50,214	スズデン	2.3	3,367	因幡電機産業	18.8	50,214
1.9	2,559	5.4	7,155	2.2	5,337	尾家産業	1.9	2,559	東テク	2.2	5,337
シモジマ	4	4,960	4.8	7,944	82.9	4	4,960	ミスミグループ本社	82.9	226,980	
ドウシシャ	6.2	11,222	フルサト工業	3.6	5,925	アルテック	6.2	11,222	アルテック	5.2	1,190
小津産業	1.4	2,529	岩谷産業	14.7	54,022	タキヒヨー	1.4	2,529	タキヒヨー	2	3,876
高速	3.9	4,617	すてきなイスグループ	2.5	2,725	蔵玉産業	3.9	4,617	蔵玉産業	1.3	1,877
たけびし	2.3	3,360	昭光通商	2.3	1,649	スズケン	2.3	3,360	スズケン	28	136,920
リックス	1.5	2,448	ニチモウ	1	1,987	ジェコス	1.5	2,448	ジェコス	4.6	4,393
丸文	6	3,624	極東貿易	1.9	4,168	グローセル	6	3,624	グローセル	6.7	3,055
ハピネット	5.5	7,876	イワキ	8.6	4,093	小売業 (4.7%)	5.5	7,876	ローソン	16.7	101,536
橋本総業HLDGS	1.3	2,291	三菱石油	16.3	17,261	ローソン	1.3	2,291	サンエー	5.5	27,775
日本ライフライン	19.6	30,262	稲畑産業	14.6	23,155	サンエー	19.6	30,262	カワチ薬品	5.1	11,755
タカショー	3.2	1,600	GS I クレオス	1.6	1,788	カワチ薬品	3.2	1,600	エービーシー・マート	10.3	76,838
エクセル	1.9	2,386	明和産業	6.1	3,782	エービーシー・マート	1.9	2,386			

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額	
すかいーくHD	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円
SFPホールディングス	74.2	164,501	ハークスレイ	1.4	1,461	ヤオコー	7.5	38,325	群馬銀行	130.2	50,778	
綿半ホールディングス	2.8	6,160	サイゼリヤ	10.9	28,677	ゼビオホールディングス	8	10,624	武蔵野銀行	9.8	19,217	
ヨシックス	2.5	5,037	V Tホールディングス	27.5	13,007	ケースホールディングス	63.9	87,287	千葉興業銀行	18.3	6,295	
コナテッド・スーパーマケ ゴルフダイジェスト・オン B E E N O S	1.1	3,150	魚力	1.8	2,754	OLYMPICグループ	3.4	2,213	筑波銀行	27.6	6,706	
あさひ	19.3	18,933	ポプラ	1.9	1,008	日産東京販売HD	9.8	2,724	七十七銀行	22.4	40,185	
日本調剤	3	2,052	フジ・コーポレーション	1.7	3,950	GENKY DRUGSTORES	3.2	8,124	青森銀行	5.2	14,721	
コスモス薬品	2.3	3,539	コナテッドアローズ	6.9	23,046	総合メディカルHD	5.8	11,977	秋田銀行	4.3	9,713	
トーエール	4.9	6,188	ハイデイ日高	9.5	20,776	ブックオフGHD	3.8	4,050	山形銀行	7.5	12,442	
オンリー	2	7,560	京都きもの友禅	4.2	1,470	アインホールディングス	8.9	61,232	岩手銀行	4.4	13,046	
セブン&アイ・HLDGS	2.9	64,525	ピーシーデポコーポ	8.7	4,158	ヤマガ電機	201.7	112,346	東邦銀行	59.5	16,541	
ツルハホールディングス	3.2	2,537	壹番屋	4.7	24,816	アークランドサカモト	10.3	13,194	東北銀行	3.1	3,205	
サンマルクホールディングス	1.1	881	トップカルチャー	2.4	816	ニトリホールディングス	28.7	495,362	みちのく銀行	4.3	6,738	
トリドルホールディングス	25.9	1,065,267	P L A N T	1.7	1,115	グルメ軒屋	4.7	5,616	ふくおかフィナンシャルG	55.9	116,942	
T O K Y O B A S E	17.8	32,769	スギホールディングス	13.2	81,444	愛眼	5.2	1,284	静岡銀行	164.1	137,679	
ウイルプラスHLDGS	14.4	188,208	兼王堂ホールディングス	2.9	7,342	ケユーホールディングス	3.5	3,258	十六銀行	8.3	22,094	
ジャパンミート	5.2	12,126	ヴァア・ホールディングス	8.1	5,402	吉野家ホールディングス	21.7	59,805	スルガ銀行	63	34,335	
サツドラホールディングス	1.4	1,453	スクロール	10.1	3,535	松屋フーズHLDGS	3.2	14,432	八十二銀行	160.1	76,047	
デファクトスタンダード	8.2	23,607	ヨンドーホールディングス	6.7	17,507	サガミホールディングス	8.8	12,108	山梨中央銀行	7.7	8,885	
アレソグホールディングス	5.9	4,230	ファミリーマート	52.9	137,592	関西スーパーマーケット	5.5	5,973	大垣共立銀行	13.1	33,405	
串カツ田中HLDGS	1.1	1,026	水曾路	8.6	24,768	プレナス	4.9	32,438	福井銀行	5.7	9,883	
パロックスジャパン	3.3	7,144	SRSホールディングス	7.7	8,038	ミニストップ	7.4	14,326	北國銀行	6.8	23,868	
カスリのアオキHLDGS	0.6	268	千趣会	12	5,184	アークス	4.9	7,212	清水銀行	2.7	5,886	
力の源HD	3.3	2,897	タカキユー	5	945	パローホールディングス	13.6	31,062	富山銀行	1.3	3,433	
スシローグループHLDGS	1	1,773	ケーヨー	13.6	7,330	藤久	14.7	30,340	滋賀銀行	13.3	36,481	
L I X I L ビバ	0.6	54,714	上新電機	7.8	19,227	ベルク	0.5	408	南都銀行	11	30,393	
メディアカシステムネットワーク	6.6	2,616	日本瓦斯	10.5	36,120	パルク	3.3	17,259	百五銀行	60	21,240	
はるやまHLDGS	3	2,622	ロイヤルホールディングス	11.6	29,487	大庄	3.5	5,617	京都銀行	23.7	108,546	
ノジマ	7.3	62,488	東天紅	0.5	625	ファーストリテイリング	8.9	603,420	紀陽銀行	23.5	40,514	
G-7ホールディングス	6.5	12,460	いなげや	8.2	12,136	サンドラッグ	24.9	96,363	ほくほくフィナンシャルG	44.1	50,009	
イオン北海道	3.4	3,686	島忠	13.9	41,769	サクスパーホールディング	5.6	5,068	広島銀行	98.1	53,464	
ゴジマ	6.1	2,622	チヨダ	7	11,319	ヤマザワ	1.5	2,499	山陰合同銀行	39.4	27,067	
ヒマラヤ	11.8	26,915	ライフコーポレーション	5	12,520	やまや	1.4	3,089	中国銀行	57.1	62,638	
コーナン商事	9.3	13,624	リンガーハット	8.1	20,120	ペルーナ	14.3	10,181	鳥取銀行	2.2	3,040	
エコス	4.9	3,101	Mr Ma x HD	9.1	4,540	<b>銀行業 (5.8%)</b>			伊予銀行	94.6	57,516	
ワタミ	2	676	AOKIホールディングス	13.2	14,968	島根銀行	1.3	915	百十四銀行	7.1	16,031	
マルシェ	87.9	219,574	オクワ	10.4	15,007	じもとホールディングス	45	4,815	四国銀行	10.1	10,554	
パンパシフィックHD	6.9	1,980	コメリ	10.2	24,102	めぶきフィナンシャルG	344.4	97,809	阿波銀行	10.8	29,224	
西松屋チェーン	10.1	13,210	青山商事	13.7	22,974	東京きらびしFG	9	13,788	大分銀行	3.8	10,845	
サンショールディングス	2.5	5,732	しまむら	7.7	69,069	九州フィナンシャルG	108.9	53,687	宮崎銀行	4.4	11,682	
幸楽苑ホールディングス	7.7	3,126	はせがわ	3.5	1,407	ゆうちょ銀行	187.5	200,625	佐賀銀行	4	6,960	
	0.8	1,336	高島屋	48.3	62,983	富山第一銀行	15.9	5,501	沖繩銀行	6.1	22,417	
	1.9	8,550	松屋	13.4	11,443	コンコルディア・フィナンシャル	389.9	174,285	琉球銀行	15.3	19,247	
	6.7	5,353	エイ・ツ・オーリテイリング	31.4	38,716	西日本フィナンシャルHD	45.3	38,776	セブン銀行	221.3	75,463	
	2.4	4,039	近鉄百貨店	2.5	9,025	関西みらいFG	38.8	28,401	みずほフィナンシャルG	9,009.9	1,528,980	
	7.8	10,233	パルコ	6.4	8,729	33FG	6.2	10,589	高知銀行	2.5	2,332	
	1.7	1,327	丸井グループ	60.7	160,915	第四北越フィナンシャルG	11.5	34,557	山口フィナンシャルG	82.8	62,679	
	158.7	285,342	アクシール リテイリング	5.5	21,285	新生銀行	48.7	83,617	長野銀行	2.1	3,597	
	14.5	14,572	井商屋	3.7	891	あおぞら銀行	39.6	111,592	名古屋銀行	5.3	17,967	
	31.7	79,693	イオン	254.8	577,122	三菱UFJフィナンシャルG	4,564.7	2,657,111	北洋銀行	100	24,100	
	4.2	8,891	イズミ	13.5	57,645	りそなホールディングス	728	339,830	愛知銀行	2.4	9,228	
			平和堂	13.5	28,552	三井住友トラストHD	125.4	526,053	中央銀行	2.7	6,093	
			フジ	8	15,768	三井住友フィナンシャルG	458.6	1,838,068	大光銀行	2.2	3,852	
						千葉銀行	227.9	142,209	愛媛銀行	9.3	11,383	
								トマト銀行	2.5	2,672		

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
京葉銀行	28.4	17,863	東京センチュリー	13.3	79,667	京阪神ビルディング	10.8	15,519	N J S	1.4	2,419
栃木銀行	31.8	7,345	日本証券金融	29.2	15,855	住友不動産	149	572,011	総合警備保障	25.6	148,736
北日本銀行	2.1	4,609	アイフル	101.1	25,477	テオーシー	13	11,635	カカココム	48.1	127,657
東和銀行	11.7	10,389	リコーリース	5.2	20,332	東京楽天地	1.1	6,754	アイロムグループ	2.3	3,348
福島銀行	6.2	1,878	イオンフィナンシャルサービス	40.5	68,242	スターツコーポレーション	9	24,219	セントレア・ホールディング	4.4	2,270
大東銀行	3.2	2,145	アコム	133	60,914	フジ住宅	7.7	5,474	サイネックス	1.1	751
トモニホールディングス	51.3	21,494	ジャックス	7.3	19,680	空港施設	6.7	3,618	ルネサンス	3.6	6,285
フィデアホール	64.9	8,696	オリコ	179.5	29,079	明和地所	3.6	2,120	ディップ	9	28,035
池田泉州HD	76.6	15,549	日立キャピタル	15.6	42,042	ゴールドクレスト	5.2	11,242	オプトホールディング	3.5	6,240
<b>証券・商品先物取引業 (0.8%)</b>			アプラスフィナンシャル	32.5	3,022	エスリード	2.6	5,644	新日本科学	6.9	5,423
F P G	20.8	22,235	オリックス	414.7	745,423	日神不動産	9.9	4,910	ツクイ	15.1	8,576
マセリアインベストメント	2.9	2,151	三菱UFJ リリース	168.2	118,581	日本エスコ	12	11,868	キャリアデザインセンター	1.6	2,129
S B Iホールディングス	74.1	167,317	九州リースサービス	3.2	1,926	タカラレーベン	30.3	14,816	ベネフィット・ワン	17.6	42,680
日本アジア投資	5.6	1,624	日本取引所グループ	190.2	356,434	サンヨーハウス 名古屋	3.7	3,681	エムスリー	141.6	432,588
ジャフコ	10.2	43,146	イー・ギャランティ	7.1	10,053	イオンモール	33.2	58,930	ツカダ・グローバルHOLD	4.2	2,675
大和証券G本社	532.3	296,012	アックス	3.4	2,220	毎日コムネット	1.4	1,164	プラス	0.7	486
野村ホールディングス	1,166.6	655,979	NECキャピタルリソリューション	2.7	6,650	ファースト住建	2.8	3,693	アウトソーシング	36.7	44,113
岡三証券グループ	56.7	23,020	<b>不動産業 (2.4%)</b>			ランド	359.7	4,316	ウェルネット	6	4,926
丸三証券	19.7	10,775	いちご	84.3	37,007	カチタス	8.2	40,344	ワールドホールディングス	2.1	4,134
東洋証券	23.6	4,082	日本駐車場開発	72.4	12,018	トーセイ	9.1	12,130	ディー・エヌ・エー	31.5	56,070
東海東京HD	76.4	25,823	日産リース	141.6	177,566	穴吹興産	0.7	2,296	博報堂DYHL DGS	89.3	159,668
光世証券	1.6	1,083	三栄建築設計	2.7	4,387	サンフロンティア不動産	9.2	11,720	ぐるなび	11.1	11,599
水戸証券	19.2	5,433	野村不動産H L D G S	40.2	106,650	インテリックス	1.9	1,350	タカミヤ	6.9	4,988
いちよし証券	12.3	8,388	三重交通グループHD	13.5	8,154	ランドビジネス	2.8	2,130	ジャパルベストレキューズ	4.4	4,756
松井証券	37.9	33,655	サムティ	9.4	19,063	日本社宅サービス	1.7	1,881	ファンコミュニケーションズ	17.7	8,938
だいちこう証券ビジ	3.2	2,076	エー・ディー・ワークス	121.8	3,775	グランディアハウス	5.1	2,397	ライク	2.5	4,242
マネックスG	50.1	14,078	日本商業開発	4.2	6,745	日本空港ビルディング	21.2	123,596	ビジネス・ブレイクスルー	2.7	934
極東証券	8.9	6,986	プレサンスコーポレーション	10.7	18,789	<b>サービス業 (5.1%)</b>			エスプール	12.4	8,816
岩井コスモホールディング	6.3	8,076	ユニゾホールディングス	10	49,000	日本工営	4.3	14,534	WDBホールディングス	2.9	7,348
藍澤證券	11.9	8,782	日本管理センター	4.4	5,803	L I F U L L	22.4	12,432	ティア	3.7	2,205
マネーパートナーズGP	7	1,750	サンセイランディック	2	1,764	ジェイエイシリアルメント	4.3	8,995	CDG	0.7	991
スパークス・グループ	22.9	5,702	エストラスト	0.9	724	日本M&Aセンター	48.5	181,875	パリュエコマース	3.6	7,203
小林洋行	1.9	507	フージャースHD	13.3	9,403	メンバーズ	1.9	4,480	インフォマート	35.2	68,288
<b>保険業 (2.3%)</b>			オーブンハウス	19.2	56,064	中広	0.6	327	J Pホールディングス	20.1	5,909
かんぽ生命保険	23.5	44,086	東急不動産HD	180.4	134,217	アイティメディア	1.9	1,502	エコナックホールディングス	11.4	1,516
SOMPOホールディングス	124.7	545,063	飯田GH D	55.3	108,000	タケエイ	6.2	7,954	E P Sホールディングス	9.7	13,938
アニコム ホールディングス	5.5	19,717	イーグランド	1.1	888	E・Jホールディングス	0.8	1,145	レックス	1.6	2,348
MS & AD	173.4	617,304	ピーロット	1.5	3,046	トラスト・テック	7.1	9,606	プレスステージ・インター	24	22,176
S O N Y F H	54.5	140,228	ファーストブラザーズ	1.5	1,917	コシダホールディングス	15.5	24,939	アミューズ	3.5	10,920
第一生命H L D G S	375.2	660,914	ハウスドゥ	3.7	5,990	アルトナー	1.6	1,206	ドリームインキュベータ	1.9	3,173
東京海上HD	237.1	1,427,342	シーアールイー	1.8	1,918	パソナグループ	7.8	13,314	クイック	4	6,732
T & Dホールディングス	205.1	265,604	プロパティエージェン	1	1,156	C D S	1.6	2,416	T A C	4.1	934
アドバンスクリエイト	1.6	2,982	ケイアイスター不動産	2.1	4,191	リンクアンドモチベーション	14.2	10,309	ケネディクス	61	35,746
<b>その他金融業 (1.2%)</b>			アグレ都市デザイン	1.1	585	G C A	7.7	7,338	電通	66.2	267,779
全国保証	18.7	82,467	ジェイ・エス・ビー	0.7	3,234	エス・エム・エス	20	60,100	テイクアンドグヴィーズ	2.5	3,325
ジェイリース	1.8	583	テンポイノベーション	0.7	1,502	サニーサイドアップ	1.4	1,593	ぴあ	1.8	8,676
イントラスト	2.3	1,607	グローバルリンクマネジメント	1.1	746	パーソルホールディングス	64.2	130,582	イオンファンタジー	2.5	7,900
日本モーゲージサービス	1.3	2,111	パーク24	35.6	91,670	リニカル	3.1	3,658	シーティーエス	7.3	5,496
C a s a	2.8	3,536	パラカ	1.7	3,456	クックパッド	22.4	8,332	ネクシィーズグループ	2.2	4,140
アルヒ	10.5	26,407	三井不動産	331	904,126	エスクリ	2	1,604	みらかホールディングス	17.9	49,242
プレミアグループ	3.6	8,409	三菱地所	464.5	933,645	アイ・ケイ・ケイ	3.1	2,241	アルプス技研	5.7	10,402
クレディセゾン	46.4	83,984	平和不動産	12.2	31,890	学情	2.3	3,654	サニックス	11.3	4,282
芙蓉総合リース	7	50,610	東京建物	72.5	119,842	スタジオアリス	3.2	6,236	ダイオーズ	1.2	1,622
みずほリース	10.3	33,784	ダイビル	17.1	20,041	シミツホールディングス	3.6	6,544	日本空調サービス	6.7	5,246

銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在		銘柄	2019年12月2日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
オリエンタルランド	千株	千円	土木管理総合試験	千株	千円	トランス・コスモス	千株	千円
ダスキン	68.3	1,036,794	ネットマーケティング	2.8	1,251	乃村工藝社	6.1	17,531
明光ネットワークジャパン	16.5	50,325	日本郵政	2.3	2,456	藤田観光	27.5	38,775
ファルコホールディングス	7.5	7,732	ベルシステム24HL DGS	526.4	545,613	KNT-CTホールディングス	2.8	8,030
秀英予備校	3.5	6,170	鎌倉新書	10.8	18,565	日本管財	4	6,044
田谷	1.4	655	S MN	4.8	9,254	トーカイ	6.9	13,461
ラウンドワン	1.2	730	一蔵	1	911	白洋舎	6.2	17,787
リゾートトラスト	0.7	525	L I T A L I C O	0.7	525	セコム	0.7	2,004
ビー・エム・エル	2.2	5,900	グローバルキッズCOMP	2.2	5,900	セントラル警備保障	68.1	645,996
ワタベウェディング	8.3	26,601	エポズブルアジア	0.9	679	丹青社	3.1	20,026
りらいあコミュニケーション	1	591	アトラエ	2.9	6,388	メイテック	12.1	14,907
リンソー教育	11.6	16,437	ストライク	1.7	6,519	応用地質	7.9	46,057
早稲田アカデミー	29.3	12,100	ソラスト	2.4	10,512	船井総研ホールディング	6.9	9,660
ユー・エス・エス	2.1	2,028	セラク	17.7	23,133	進学会ホールディングス	13.3	33,861
東京個別指導学院	71.9	153,218	インソース	2	1,592	オオバ	2.5	1,332
サイバーエージェント	2.3	1,665	ペイカレントコンサルティング	3.1	10,648	いであ	5	3,990
楽天	36.9	141,327	ORCHESTRA HLDGS	3.9	23,244	学究社	1.2	2,784
クリーク・アンド・リバー社	299.4	282,034	アイモバイル	1.3	1,453	ベネッセホールディングス	1.9	2,530
デー・オー・ダブリュー	3.3	3,712	キャリアインデックス	2	1,426	イオンディライト	21.4	62,231
山田コンサルティングGP	5.6	4,704	MS-Japan	2.6	1,128	ナック	7.9	30,573
セントラルスポーツ	3.1	5,660	船場	2.1	3,175	ニチ学館	3.6	3,801
フルキャストホールディングス	2.4	7,848	グレイステクノロジー	1	1,146	ダイセキ	9.2	14,913
エン・ジャパン	6.4	15,904	ジャパリエレベーターSHD	2.9	8,586	ステップ	10.8	35,208
リソルホールディングス	11.4	58,368	フルテック	6.8	19,944		2.3	3,604
テクノロ・ホールディング	0.7	2,887	グリーンズ	0.9	1,255	合計	株数、金額	千株 千円
アトラ	12.9	96,492	ツガグループHLDGS	2.4	2,932		78,860.4	162,602,439
インターワークス	1.5	588	ソウルアウト	0.8	494		銘柄数<比率>	2,130銘柄 <98.7%>
アイ・アルジャパンHD	1	678	MS&CONSULTING	1	1,775			
Keeper 技研	2.6	10,946	日総工産	0.9	960			
ファーストロジック	2.3	3,148	キュービーネットHLDGS	4.3	4,656			
三機サービス	1.5	954	RPAホールディングス	3.9	9,742			
Gunosy	1.4	1,435	スプリックス	3.6	4,510			
デザインワン・ジャパン	4.5	7,461	アドバンテッジリスクマネ	2.2	2,772			
イー・ガーディアン	1.2	410	リログループ	3.2	3,168			
リブセンス	3.2	7,180	東祥	35.1	104,808			
ジャパンマテリアル	4.1	1,271	エイチ・アイ・エス	4	9,816			
ベクトル	19.8	29,898	ラックランド	10	30,700			
ウチヤマホールディングス	8	9,112	共立メンテナンス	1.3	3,185			
チャームコアソリューション	3.2	1,772	イチネホールディングス	10.6	55,120			
ライクキッズ	2.1	4,101	建設技術研究所	7.2	10,188			
キャリアリンク	1.5	1,326	スペース	4.4	8,932			
I B J	2.1	1,173	長大	4.1	5,399			
アサンテ	4.3	4,626	燦ホールディングス	2.4	2,834			
N・フィールド	2.6	5,270	スバル興業	2.8	3,774			
パリュウHR	0.4	3,093	東京テアトル	0.4	3,152			
M&Aキャピタルパートナー	1.3	4,556	タナベ経営	2.5	3,482			
ライドオンエクスプレスHD	4.6	19,780	ナガワ	1.2	1,534			
ERIホールディングス	2.4	4,660	よみうりランド	2	15,060			
アシスト	1.8	1,440	東京都競馬	1.4	6,356			
シグマクシス	1	2,688	常盤興産	4.2	14,595			
ウィルグループ	4.4	9,904	カナモト	2.6	4,334			
エスクローAJ	4.2	4,859	東京ドーム	10.5	33,232			
リクルートホールディングス	8.7	2,079	西尾レントオール	26.1	26,439			
エラン	460.1	1,830,277	アゴラ・ホスピタリティG	6.5	20,052			
	3.8	6,498		41.5	1,411			

合計 株数、金額 78,860.4 162,602,439  
銘柄数<比率> 2,130銘柄 <98.7%>

(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12月2日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	2,385	-

(注) 単位未満は切捨て。

## ■有価証券の貸付および借入状況

区分	2019年12月2日現在	
	貸付	借入
株式	株 5,424,600 (129,400)	株 (-)

(注1) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。  
(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ129,400株を貸付しています。

# トピックス・インデックス・マザーファンド 運用報告書 第31期（決算日 2019年9月19日）

（作成対象期間 2018年9月20日～2019年9月19日）

トピックス・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	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。）
株式組入制限	無制限

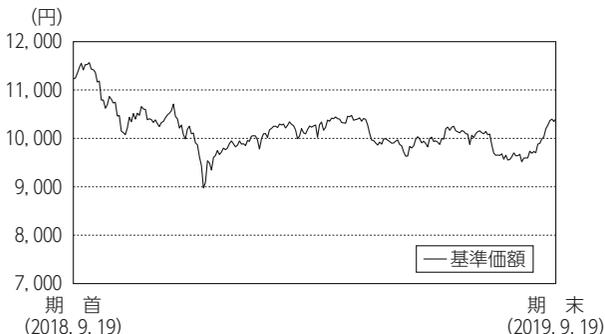
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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		TOPIX (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率 %	円	騰落率 %		
(期首)2018年9月19日	11,233	—	1,785.66	—	99.4	0.5
9月末	11,523	△2.6	1,817.25	1.8	98.7	1.3
10月末	10,435	△7.1	1,646.12	△7.8	98.5	1.6
11月末	10,573	△5.9	1,667.45	△6.6	98.7	1.3
12月末	9,490	△15.5	1,494.09	△16.3	99.3	0.9
2019年1月末	9,958	△11.4	1,567.49	△12.2	99.2	0.8
2月末	10,216	△9.1	1,607.66	△10.0	99.5	0.7
3月末	10,225	△9.0	1,591.64	△10.9	97.9	2.1
4月末	10,395	△7.5	1,617.93	△9.4	98.7	1.3
5月末	9,719	△13.5	1,512.28	△15.3	98.4	1.6
6月末	9,985	△11.1	1,551.14	△13.1	99.3	0.9
7月末	10,076	△10.3	1,565.14	△12.3	99.0	0.9
8月末	9,736	△13.3	1,511.86	△15.3	99.0	1.0
(期末)2019年9月19日	10,406	△7.4	1,615.66	△9.5	99.7	0.2

(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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 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：11,233円 期末：10,406円 騰落率：△7.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

### ◆投資環境について

#### ○国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、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、上昇しました。2018年10月には、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月は、株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中通商協議に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に開催された米中閣僚級協議などにより通商協議の進展期待が再び高まり、株価は反発しました。上昇一服後は一進一退で推移したものの、5月に入り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、また中国の通信機器大手メーカーに対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。下落一巡後は、世界景気の動向などに不透明感がある中で、6月末に開催された米中首脳会談で一定の成果が見られたことや米国の利下げ期待が支えとなり、株価は横ばい圏で推移しました。しかし8月に入ると、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され、株価は下落しました。9月以降は、米中通商協議の進展期待から、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

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

当作成期中、資金変動への対応、新規上場等のベンチマークの構成の変化への対応のため、随時、株式の売買を行いました。

#### ◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△9.5%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。

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

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

## ■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■売買および取引の状況

## (1)株 式

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 12,873.8 (△ 2,507.842)	千円 21,915,216 ( 3,997)	千株 7,289.458	千円 12,747,872

(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

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 25,515	百万円 25,723	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## (3)新株予約権証券

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証 券 ( 102,600)	千円 — ( —)	証 券 96,100 ( 6,500)	千円 336 ( —)

(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

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

買 付	当 期			売 付	当 期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
銘柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
武田薬品	355.2	1,567,077	4,411	トヨタ自動車	91	617,061	6,780
ソフトバンク	675.8	926,910	1,371	ソフトバンクグループ	60.8	403,569	6,637
トヨタ自動車	76.5	525,228	6,865	日本電信電話	37.6	187,248	4,980
ソニー	52.6	301,826	5,738	三井住友フィナンシャルG	45.3	185,878	4,103
三菱UFJフィナンシャルG	531.4	297,828	560	NTTドコモ	72.6	182,839	2,518
ソフトバンクグループ	39.4	252,160	6,400	三菱UFJフィナンシャルG	304	177,941	585
日本郵政	197.8	251,219	1,270	本田技研	55.9	168,744	3,018
キーエンス	3.7	231,266	62,504	任天堂	4.3	168,160	39,107
日本電信電話	45.8	225,511	4,923	リクルートホールディングス	50.9	156,507	3,074
三井住友フィナンシャルG	47.6	184,770	3,881	KDDI	55.9	156,503	2,799

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

## (1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>																				
極洋	3.8	2.8	8,173				前田建設	47.1	49.1	46,988			三機工業	14	15.3	20,241				
日本水産	75.4	84.9	53,571				佐田建設	—	4.5	1,813			日揮	56.5	60.4	87,519				
マルハニチロ	12.7	12.3	34,280				ナカノフドー建設	—	5.4	2,446			中外炉工業	3.3	2	2,958				
カネコ種苗	6.9	2.6	3,257				奥村組	10.8	11.5	34,086			ヤマト	—	6.3	4,384				
サカタのタネ	10	10.1	38,481				東鉄工業	8	8.4	27,258			太平電業	4.6	4.7	11,242				
ホクト	7.1	7.1	13,972				イチケン	—	1.3	2,141			高砂熱学	17.5	17	31,025				
ホクリヨウ	—	1.1	743				富士ピー・エス	—	2.9	1,447			三晃金属	—	0.8	1,983				
<b>鉱業 (0.3%)</b>							浅沼組	29	2.4	9,060			朝日工業社	—	1.5	4,404				
住石ホールディングス	—	18.5	2,479				戸田建設	75.2	81.3	52,032			明星工業	13.2	12.7	9,639				
日鉄鉱業	2.1	1.9	8,056				熊谷組	10.5	10	31,400			大気社	8.2	9.5	32,252				
三井松島 HLDGS	5.1	3.6	4,431				青木あすなる建設	—	3.6	4,345			ダイダ	4.7	4.7	10,067				
国際石油開発帝石	316.5	340.3	362,589				北野建設	21	1.5	3,502			日比谷総合設備	8	6.3	12,600				
石油資源開発	9.8	12.2	36,722				植木組	—	0.9	2,244			東芝プラントシステム	13.5	15.2	27,527				
K&O エナジーグループ	3.5	4.1	5,489				三井ホーム	11	—	—			OSJB HD	38.1	31	7,626				
<b>建設業 (2.9%)</b>							矢作建設	10.7	9.5	6,897			東洋エンジニア	11.6	8.3	5,121				
ヒノキヤグループ	—	2.1	4,040				ピーエス三菱	13.1	7.4	5,298			千代田化工建	43.4	—	—				
ショーボンドHD	6.1	12.1	48,037				日本ハウス HLDGS	17.5	13.4	6,324			レイズネクスト	13.4	12.5	15,600				
ミライト・ホールディングス	20.2	23.8	40,222				大東建託	23.4	24.9	359,929			<b>食料品 (4.0%)</b>							
タマホーム	7.5	4.1	5,940				新日本建設	9.2	8.3	6,606			日本製粉	19.2	19.8	34,511				
サンヨーホームズ	—	1.2	778				NIPPO	14.3	18.5	36,926			日清製粉G本社	71.8	70.8	144,998				
日本アクア	—	3.4	2,012				東亜道路	2	1.3	4,478			日東富士製粉	—	0.4	2,576				
ファーストコーポレーション	—	2.6	1,547				前田道路	18.4	20.8	50,232			昭和産業	5.4	5.7	17,869				
ベステラ	—	1.6	1,980				日本道路	1.9	1.9	12,464			鳥越製粉	—	5.6	4,838				
TATERU	10.3	—	—				東亜建設	5.8	6.1	8,100			中部飼料	8	7.6	9,416				
スペースバリューHD	—	10.4	5,158				日本国土開発	—	11.5	6,152			フィード・ワン	48.2	42.1	6,820				
ダイセキ環境ソリューション	—	1.6	1,128				若築建設	6.1	3.5	5,302			東洋精糖	9.9	0.9	960				
第一カッター興業	—	1	1,668				東洋建設	22.9	25.7	11,719			日本甜菜糖	—	3.6	6,609				
安藤・間	54	54.4	42,432				五洋建設	76.7	83.3	49,063			三井製糖	5	4.9	11,230				
東急建設	26.5	24.8	19,964				世紀東急	13.6	10.2	7,435			塩水港精糖	43.9	6.6	1,379				
コムシスホールディングス	24.9	30.1	89,818				福田組	2.4	2.3	9,844			日新製糖	4.6	2.9	5,829				
ミサワホーム	6.7	6.7	7,597				住友林業	40.5	49.6	71,126			森永製菓	13.7	15.8	79,316				
ピーアールホールディングス	—	9.3	3,552				日本基礎技術	22	7.2	2,397			中村屋	—	1.6	7,136				
高松コンストラクショング	4.2	5.3	13,382				日成ビルド工業	12.1	—	—			山崎グリコ	16.4	18.6	88,071				
東建コーポレーション	2.4	2.6	17,680				巴コーポレーション	14.9	8.7	3,462			名糖産業	—	3	3,960				
ソネック	—	0.8	710				大和ハウス	193	193.8	694,191			井村屋グループ	—	2.7	5,748				
ヤマウラ	9.3	3.3	2,930				ライト工業	14.3	13.5	19,291			不二家	3.8	3.5	7,245				
大成建設	65.4	69.7	290,300				積水ハウス	211.6	214.2	447,249			山崎製パン	48.9	47.1	91,750				
大林組	194	209.8	231,619				日特建設	10.9	6	3,918			一屋製パン	—	1.1	1,042				
清水建設	199	214.1	213,457				北陸電気工事	—	3.4	2,988			モロゾフ	1.9	1.1	5,450				
飛島建設	74.4	6	7,008				ユアテック	9.4	11.2	7,627			電田製菓	3.9	3.9	18,837				
長谷工コーポレーション	75.6	87.4	109,861				四電工	—	1	2,830			寿スピリッツ	6	6.6	46,596				
松井建設	11.8	7.7	5,559				中電工	7.5	9	21,762			カルビー	26.8	28.6	97,383				
銭高組	—	0.9	3,636				関電工	24.4	31.8	31,482			森永乳業	11.7	12.6	51,975				
鹿島建設	286	164	235,832				きんでん	41.2	46.5	76,632			六甲バター	5	4.2	7,539				
不動産トラ	63.7	4.8	5,788				東京エネシス	8.2	7.2	6,573			ヤクルト	34.3	46.4	295,568				
大末建設	—	2.5	2,340				トーエネック	1.9	2	6,890			明治ホールディングス	38.7	44.4	352,536				
鉄建建設	4.4	4.3	11,734				住友電設	5.3	4.8	10,228			雪印メグミルク	14.4	15.1	38,837				
西松建設	14.9	15.1	30,411				日本電設工業	9.8	11.9	27,548			プリマハム	42	8.8	19,412				
三井住友建設	47.8	50.5	28,532				協和エクシオ	25	27.4	72,829			日本ハム	24.6	26	114,660				
大豊建設	27	4.7	13,630				新日本空調	—	5.6	10,421			林兼産業	—	2	1,162				
							九電工	12.9	13.8	49,749			丸大食品	35	6.7	15,329				

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
S Foods	4.8	5.6	18,032	18,032	富士紡ホールディングス	3.9	3.2	9,385	9,385	住友化学	445	481.2	242,524	242,524
伊藤ハム米久 HLDGS	36.8	40.3	27,605	27,605	倉敷紡績	63	5.8	12,980	12,980	住友精化	2.6	3	10,020	10,020
サッポロホールディングス	20.8	21.4	56,474	56,474	シキボウ	6.8	3.2	2,956	2,956	日産化学	35.6	37.1	169,176	169,176
アサヒグループホールディングス	123.1	131.3	699,829	699,829	日本毛織	18.9	20	19,300	19,300	ラサ工業	3.7	2.2	2,673	2,673
キリンHD	266.2	265.9	606,517	606,517	ダイトウボウ	—	10.4	842	842	クレハ	5.4	5.7	36,822	36,822
宝ホールディングス	45.4	47	52,640	52,640	トーア紡コーポレーション	—	2.5	1,295	1,295	多木化学	—	1.8	9,036	9,036
オエノホールディングス	24.6	16.6	6,640	6,640	ダイドーリミテッド	—	7.2	1,958	1,958	テイカ	5.5	5	9,865	9,865
養命酒	—	1.9	3,691	3,691	帝国繊維	7.2	6.9	12,530	12,530	石原産業	12.3	11.8	10,985	10,985
コカ・コーラボトラーズ JHD	45	44	106,172	106,172	帝人	48.5	49.8	102,687	102,687	片倉コープアグリ	—	1.8	1,969	1,969
サントリー食品インター	39.2	41.9	198,396	198,396	東レ	442.2	474.6	397,572	397,572	日本書達	42	9.7	25,268	25,268
ダイドーグループHD	3.2	3.5	15,750	15,750	サカイオーベックス	3.4	1.5	2,542	2,542	東ソー	87.2	94.5	138,348	138,348
伊藤園	19.8	19	98,230	98,230	住江織物	2.8	1.8	5,328	5,328	トクヤマ	18.1	17.6	42,979	42,979
キーコーヒー	7	6.2	13,677	13,677	日本フエルト	—	3.5	1,648	1,648	セントラル硝子	12.7	13.4	31,114	31,114
ユニカフェ	—	1.6	1,582	1,582	イチカフ	—	0.9	1,276	1,276	東亜合成	34.2	38.4	45,504	45,504
ジャパンフーズ	—	0.9	1,089	1,089	日東製網	—	0.7	1,028	1,028	大阪ソーダ	6.9	6.8	18,713	18,713
日清オイリオグループ	7	8	28,000	28,000	アツギ	8.9	5.1	4,263	4,263	関東電化	16.1	14.6	11,373	11,373
不二製油グループ	16	15.3	46,512	46,512	ダイニック	8.3	2.5	1,847	1,847	デンカ	22.2	24	71,904	71,904
かどや製油	—	0.7	2,558	2,558	セーレン	14.4	15.1	19,041	19,041	信越化学	100.9	107.8	1,274,196	1,274,196
J-オイルミルズ	3.1	3.2	13,328	13,328	ソトー	12.8	2.4	2,380	2,380	日本カーバイド	3.6	2.1	2,620	2,620
キッコーマン	42.8	41.4	213,624	213,624	東海染工	6.3	0.8	923	923	堺化学	4.7	4.1	10,655	10,655
味の素	133.8	138.5	282,540	282,540	小松マターレ	11.5	10	8,190	8,190	第一稀元素化学工	—	6.6	5,425	5,425
キューピー	32.5	34.9	90,181	90,181	ワコールホールディングス	16.1	17.3	47,713	47,713	エア・ウォーター	49	50.1	96,642	96,642
ハウス食品G本社	22.4	23.4	97,461	97,461	ホギメディカル	8	7.6	23,560	23,560	大陽日酸	47.8	50.4	107,805	107,805
カゴメ	23.7	23.8	65,569	65,569	レナウン	—	17.9	1,986	1,986	日本化学工業	2.8	2.1	5,115	5,115
焼津水産化工	—	3.1	3,289	3,289	クラウドディア HLDGS	—	1.5	748	748	東邦アセチレン	—	0.9	1,186	1,186
アリアケジャパン	5.5	5.7	47,652	47,652	T S Iホールディングス	21.2	22.6	13,108	13,108	日本パーカラライジング	30.2	33.4	40,881	40,881
ビエトロ	—	0.8	1,303	1,303	マツコカコーポレーション	—	1.9	3,934	3,934	高圧ガス	11	9.7	8,177	8,177
Eバラ食品工業	—	1.5	3,165	3,165	ワールド	—	8	20,176	20,176	チタン工業	—	0.8	2,086	2,086
やまみ	—	0.3	600	600	三陽商会	4.4	3.2	4,729	4,729	四国化成	9.8	10.3	11,875	11,875
ニチレイ	28.2	32.6	81,630	81,630	ナイガイ	—	2.2	829	829	戸田工業	2.4	1.3	2,897	2,897
東洋水産	32.2	32.3	144,542	144,542	オンワードホールディングス	36.5	36.8	20,313	20,313	ステラ ケミファ	3.6	3.6	10,173	10,173
イートアンド	—	2.2	3,834	3,834	ルックホールディングス	—	2.1	2,257	2,257	保土谷化学	2.5	2.1	6,478	6,478
大冷	—	0.7	1,448	1,448	ゴールドウイン	3.7	5.5	97,900	97,900	日本触媒	9.6	10.3	66,435	66,435
ヨシムラ・フード・HLDGS	—	1.7	1,490	1,490	デサント	14.4	14.9	22,454	22,454	大日精化	4.8	5.1	16,728	16,728
日清食品HD	22.9	26.6	206,416	206,416	キング	—	3.3	1,877	1,877	カナカ	80	15.8	54,115	54,115
永谷園ホールディングス	9	3.4	7,408	7,408	ヤマトインターナショナル	—	3.7	1,487	1,487	三菱瓦斯化学	49.9	62.1	90,976	90,976
一正蒲鉾	—	2.4	2,635	2,635	<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>					三井化学	54.7	55.5	140,137	140,137
フジッコ	6.7	6.8	13,620	13,620	特種東海製紙	3.3	3.9	15,405	15,405	J S R	61.5	61.4	105,485	105,485
ロックフィールド	7.5	6.8	9,948	9,948	王子ホールディングス	258	275.2	142,278	142,278	東京応化工業	9.5	10.5	41,632	41,632
日本たばこ産業	338.2	361.9	831,646	831,646	日本製紙	25	29.4	53,566	53,566	大阪有機化学	7	5.6	6,014	6,014
ケンコーマヨネーズ	4.7	3.5	8,267	8,267	三菱製紙	14.1	10	4,910	4,910	三菱ケミカル HLDGS	407.7	408.7	330,679	330,679
わらべや日洋 HD	4.3	4.1	7,609	7,609	北越コーポレーション	31.7	40.5	22,356	22,356	K Hネオケム	9.2	10.8	25,326	25,326
なとり	—	3.5	5,687	5,687	中越パルプ	4.9	2.6	4,074	4,074	ダイセル	80.7	90.2	81,811	81,811
イフジ産業	—	1	733	733	巴川製紙	—	2	1,978	1,978	住友ベークライト	50	10.6	44,149	44,149
ピックスコーポレーション	—	1.5	3,882	3,882	大王製紙	23.1	29.9	40,514	40,514	積水化学	123.8	131.5	228,941	228,941
北の達人コーポ	19.8	24.6	17,367	17,367	阿波製紙	—	1.6	656	656	日本ゼオン	51	55.1	75,321	75,321
ユーグレナ	23.6	26.8	24,146	24,146	レンゴー	59.7	63	50,274	50,274	アイカ工業	17.1	18.4	60,444	60,444
ミヨシ油脂	—	2.4	2,704	2,704	トーモク	4.3	3.7	5,905	5,905	宇部興産	30.3	30.8	68,222	68,222
理研ビタミン	2.6	3	10,800	10,800	ザ・パック	4.4	4.6	15,663	15,663	積水樹脂	9.6	10.1	22,068	22,068
<b>繊維製品 (0.7%)</b>					<b>化学 (7.2%)</b>					タキロンシーアイ	15.1	13.1	8,685	8,685
片倉工業	8.1	8.9	11,525	11,525	クラレ	93.3	96.3	130,775	130,775	旭有機材	5	4.2	5,607	5,607
グンゼ	4.8	4.1	18,573	18,573	旭化成	382.6	435.1	479,697	479,697	日立化成	29	28.3	97,635	97,635
東洋紡	22.1	26	37,414	37,414	共和レザー	9.8	3.8	2,967	2,967	ニチパン	3.5	3.2	5,187	5,187
ユニチカ	19.4	18.1	5,900	5,900	昭和電工	38.5	43.5	130,152	130,152	リケンテクノス	16.1	16.7	7,999	7,999

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円	
大倉工業	3.4	2.9	4,747		長谷川香料	7.4	8.3	17,015		扶桑薬品	4	2.2	4,477	
積水化成	9.1	9.1	7,161		星光PMC	—	3.6	2,811		日本ケミファ	2.2	0.8	2,240	
群栄化学	2.5	1.6	3,891		小林製薬	16.5	17.5	147,000		ツムラ	20.8	19.4	58,103	
タイガースポリマー	—	3.1	1,773		荒川化学工業	6.2	5.6	8,573		日医工	14.3	16.5	20,460	
ミライアル	—	1.8	2,451		メック	5.2	4.3	6,243		キッセイ薬品工業	9.8	11	28,677	
ダイキアクシス	—	2.2	1,779		日本高純度化学	5.3	1.7	4,188		生化学工業	12.2	12.1	13,721	
ダイキョーニシカワ	11.9	12.9	10,307		タカラバイオ	15.8	16.4	38,687		栄研化学	9.9	11	18,777	
竹本容器	2.4	2.2	1,999		JCU	7.6	8.1	17,131		日水製薬	—	2.6	3,169	
森六ホールディングス	—	3.3	8,276		新田ゼラチン	12.7	4	2,708		鳥居薬品	3.4	3.9	11,376	
日本化薬	38.1	37.9	49,270		OATアグリオ	—	1	1,429		JCRファーマ	4.4	4.4	35,816	
カーリットホールディングス	8	6.5	3,796		デクセリアルズ	15.9	16.2	12,717		東和薬品	3	9	22,878	
日本精化	7.7	4.9	5,938		アース製薬	4.3	4.7	25,380		富士製薬工業	4.5	4.3	5,757	
扶桑化学工業	6.2	6.2	14,669		北興化学	12.8	6.4	3,168		沢井製薬	11.6	12.8	73,344	
トリケミカル	—	1.4	8,890		大成ラミック	—	2.1	6,132		ゼリア新薬工業	13	12.4	24,006	
ADEKA	25.2	30.1	41,507		クミアイ化学	25	25.9	24,449		第一三共	167.7	178.7	1,273,416	
日油	23.9	23	83,490		日本農薬	14.8	11.2	5,297		キョーリン製薬HD	15.2	13.8	25,405	
新日本理化	—	10.9	2,092		アキレス	5.4	4.3	7,378		大幸薬品	4.4	2.8	6,683	
ハリマ化成グループ	7.1	5	6,280		有沢製作所	11.6	9.9	10,147		ダイト	4.1	3.7	10,855	
花王	143.2	149.5	1,186,581		日東電工	43.9	43.1	231,188		大塚ホールディングス	111.4	119	564,893	
第一工業製薬	14	2.3	6,522		レック	3.7	6.7	6,686		大正製薬HD	13.2	13.2	104,412	
石原ケミカル	—	1.6	2,742		三光合成	—	7.2	2,556		ペプチドリーム	27.2	31.6	172,536	
日華化学	—	2.1	1,713		きもと	—	10.7	1,958		<b>石油・石炭製品 (0.6%)</b>				
ニイタカ	—	1	1,500		藤森工業	4.9	5.6	17,752		日本コークス工業	58.3	52.6	4,628	
三洋化成	3.7	4.1	20,705		前澤化成工業	—	4.3	5,147		昭和シエル石油	55.9	—	—	
有機合成薬品	—	4.8	1,123		未来工業	—	3.4	6,602		ニチレキ	8.6	8	8,984	
大日本塗料	8.8	6.9	7,638		ウェーブロックHLDGS	—	1.8	1,333		ユシロ化学	4.8	3.2	4,384	
日本ペイントHOLD	47.4	50.5	267,650		ジェイ エス ビー	3.8	3.7	6,774		ビービー・カストロール	2.9	2.2	3,025	
関西ペイント	64	68.8	163,812		エフピコ	4.9	6.9	45,954		富士石油	18.2	15.3	3,825	
神東塗料	—	5	825		天馬	5.2	4.2	8,530		MOR E S C O	5.2	2.3	3,121	
中国塗料	18.8	20.1	18,512		信越ポリマー	12.1	11.2	8,556		出光興産	49.3	72.1	233,604	
日本特殊塗料	4.9	4.6	5,165		東リ	24.6	15.6	4,024		JXTGホールディングス	932.5	1,033	515,570	
藤倉化成	15	8.2	4,469		ニフコ	20.8	25	66,225		コスモエネルギーHLDGS	17.3	18.1	40,272	
太陽ホールディングス	4.5	5.1	17,748		バルカー	5.2	5.1	11,704		<b>ゴム製品 (0.8%)</b>				
DIC	25.5	25.8	77,787		ユニ・チャーム	124.2	120.4	402,978		横浜ゴム	32.3	36.1	78,409	
サカタインクス	13.1	13.4	14,860		ショーエイコーポ	—	0.5	380		TOYO TIRE	29.8	35.9	50,762	
東洋インキSCホールディング	11.2	12.9	31,863		<b>医薬品 (5.6%)</b>					ブリヂストン	179.3	191.9	826,129	
T&K TOKA	6.4	4.7	4,591		協和キリン	72.7	62.8	132,696		住友ゴム	50.9	56.1	72,200	
富士フィルムHLDGS	121.1	129.7	622,430		武田薬品	215.2	545.3	2,048,692		藤倉コンポジット	12.1	5.5	2,376	
資生堂	116.6	124.1	1,082,400		アステラス製薬	574.7	549.4	836,186		オカモト	21	4.2	17,283	
ライオン	81.7	81.2	172,793		大日本住友製薬	44	46.3	85,701		フコク	—	2.7	1,895	
高砂香料	3.8	4.3	11,962		塩野義製薬	82.2	79.8	466,830		ニッタ	5.7	7	21,385	
マンダム	11.1	14.1	39,282		田辺三菱製薬	70.6	65.4	82,077		住友理工	9.8	12.1	10,769	
ミルボン	7.4	8.3	43,907		わかもと製薬	—	7.5	1,845		三ツ星ベルト	16	8.2	15,424	
ファンケル	14.5	27.8	77,367		あすか製薬	7.9	7.7	8,639		バンドー化学	11.3	11.9	10,567	
コーセー	10	10.6	200,764		日本新薬	15.5	16.3	147,026		<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>				
コタ	—	3.3	3,979		ピオフェルミン製薬	—	1.1	2,427		日東紡績	9	9.3	29,295	
シーズ・ホールディングス	7.4	—	—		中外製薬	61.3	65.1	522,102		AGC	58.2	61.7	202,993	
シーボン	—	0.8	1,931		科研製薬	10.4	10.7	54,356		日本板硝子	30	30	19,740	
ポーラ・オルビスHD	25.2	26.7	66,216		イーザイ	70.2	74.8	404,817		石塚硝子	—	1.1	2,137	
ノエビアホールディングス	3.7	6	34,800		ロート製薬	32.4	32.1	93,025		日本山村硝子	59	2.6	3,302	
アジパコスマージャパン	—	1.4	1,324		小野薬品	138.2	147.5	303,038		日本電気硝子	25.2	25.1	60,566	
エステー	4.7	4.5	7,618		久光製薬	17.3	18.5	87,967		オハラ	—	2.5	3,615	
アグロカネショウ	—	2	3,070		持田製薬	3.8	9.4	39,527		住友大阪セメント	110	12.6	59,661	
コニシ	10.8	11	16,500		参天製薬	110.4	116.3	221,318		太平洋セメント	36.7	39.5	115,142	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
日本ヒューム	10.3	6.2	4,433		エンビプロHD	—	2.3	1,518		日東精工	—	8.5	4,904	
日本コンクリート	25	13.4	3,792		シンニタン	17.3	9.6	4,492		三洋工業	—	0.8	1,519	
三谷セキサン	—	2.9	9,207		新家工業	—	1.4	2,051		岡部	13.4	12.5	10,650	
アジアパイルHD	10.8	8.9	4,672		<b>非鉄金属 (0.7%)</b>					ジーテクト	7	6.8	11,532	
東海カーボン	54.7	65.4	73,248		大紀アルミニウム	12.7	10.1	7,564		中国工業	—	1	534	
日本カーボン	3.1	3.2	12,176		日本軽金属HD	166.6	168.1	33,620		東プレ	10.5	11.5	19,550	
東洋炭素	4	3.7	8,776		三井金属	15.5	16.7	43,119		高周波熱錬	12.3	11.9	10,769	
ノリタケ	3.5	3.7	14,911		東邦亜鉛	3.5	3.4	6,864		東京製綱	5.4	3.8	3,636	
TOTO	45.3	48.1	199,855		三菱マテリアル	37.2	40.8	119,829		サンコール	—	3.5	1,620	
日本碍子	68.7	76.3	119,791		住友鉱山	73.9	84.6	289,670		モリテックスチル	—	4.8	1,694	
日本特殊陶業	49.4	52.7	110,090		DOWAホールディングス	14.2	14.4	53,064		パイオラックス	8.9	9.9	18,909	
ダントーホールディングス	—	4.9	558		古河機金	9.9	10.2	14,912		エイチワン	6.6	6.1	4,013	
MARUWA	2.2	2.2	14,564		エス・サイエンス	—	27.6	1,490		日本発条	56.4	61.6	51,497	
品川リフラクトリーズ	2.3	1.6	4,278		大阪チタニウム	7.1	7.2	12,758		中央発條	—	0.7	1,929	
黒崎播磨	1.4	1.2	6,720		東邦チタニウム	12.1	11.1	9,168		アドパネクス	—	0.8	1,304	
ヨータイ	—	5.5	3,366		UACJ	8.7	9.4	16,675		立川ブラインド	4.8	2.7	3,753	
イソライト	—	3.2	1,452		CKサンエツ	—	1.2	3,381		三益半導体	5.3	5.4	10,216	
東京窯業	—	8	2,392		古河電工	19.1	17.8	44,891		<b>機械 (5.0%)</b>				
ニッカトー	4.6	2.8	1,934		住友電工	213.7	230.7	322,403		日本ドライケミカル	—	1.7	1,946	
フジミンコボレーテッド	5.7	5.6	14,554		フジクラ	67.3	74.8	29,471		日本製綱所	19.4	18.8	39,235	
クニミネ工業	—	2.8	2,562		昭和電線 HLDGS	11.2	7.2	6,328		三浦工業	25.3	26.7	81,969	
エーアンドエーマテリアル	—	1.2	1,224		東京特殊電線	—	0.8	1,591		タクマ	19.8	22.5	28,237	
ニチアス	33	17.1	33,020		タツタ電線	13.8	12.2	5,758		ツガミ	17	13.9	12,649	
ニチハ	9	8.7	26,361		カナレ電気	—	1.1	2,094		オークマ	6.5	7.9	46,215	
<b>鉄鋼 (0.8%)</b>					平河ヒューテック	—	2.6	2,893		東芝機械	34	7	16,121	
日本製鉄	256.5	286.9	437,379		リョービ	7.5	7.6	13,436		アマダホールディングス	85.2	92.7	108,829	
神戸製鋼所	104	113.2	66,222		アールステイ	9.6	7.6	4,400		アイダエンジニア	14.1	16.7	14,245	
中山製鋼所	9	8.5	3,935		アサヒHD	10.5	11.6	27,387		滝澤鉄工所	4.3	1.9	2,498	
合同製鐵	3.9	3	6,711		<b>金属製品 (0.6%)</b>				FUJII	17.4	24.7	38,680		
JFEホールディングス	155.5	166.8	219,925		稲葉製作所	—	3.5	5,106		牧野フライス	29	7.2	33,660	
日新製鋼	16.2	—	—		宮地エンジニアリングG	2.8	1.9	3,007		オーエスジー	27.8	28.5	64,296	
東京製鐵	31.6	33.1	28,234		トーカロ	17.1	16	14,656		ダイジェット	—	0.7	1,047	
共英製鋼	6.8	7	14,140		アルファCO	3.4	2.2	2,600		旭ダイヤモンド	19.1	16.2	10,465	
大和工業	12.2	13.1	37,138		SUMCO	64.1	74	106,190		DMG森精機	35.6	39.1	61,543	
東京製鋼	5	2.5	3,350		川田テクノロジーズ	1.4	1.4	9,576		ソディック	13.2	14.5	11,310	
大阪製鐵	3.9	4.1	5,580		RS TECHNOLOGIES	—	1.7	6,086		ディスコ	7.9	8.4	182,280	
淀川製鋼所	7.1	8.3	16,649		信和	—	3.3	3,313		日東工器	4	3.4	7,544	
丸一鋼管	20.5	21.9	62,196		東洋製鐵グループHD	36.6	39.3	66,770		日進工具	—	1.8	3,564	
モリ工業	—	1.9	3,638		ホッカンホールディングス	20	3.1	4,733		パンチ工業	7.4	4.3	2,150	
大同特殊鋼	9.8	10.1	42,672		コロナ	—	3.4	3,583		富士ダイス	—	2.7	1,598	
日本高周波	8	2.2	954		横河ブリッジ HLDGS	11.3	11.5	18,768		豊和工業	4.9	3.4	2,645	
日本冶金工	54.3	51.2	11,315		駒井ハルテック	4.3	1.2	1,964		OKK	5.6	2.5	1,742	
山陽特殊製鋼	6.9	7.8	11,684		高田機工	—	0.6	1,504		石川製作所	2.4	1.5	2,134	
愛知製鋼	2.7	3.5	11,060		三和ホールディングス	55.7	63.8	81,089		東洋機械金属	9.7	4.4	2,521	
日立金属	61.4	66.5	81,396		文化シャッター	18.6	18.2	16,762		津田駒工業	—	1.2	1,593	
日本金属	2.8	1.5	1,239		三協立山	8.4	8.6	10,681		エンシュウ	—	1.6	1,833	
大太平洋金属	4	4.2	9,445		アルインコ	8.7	4.9	4,610		島精機製作所	7.4	8.5	21,573	
新日本電工	39.6	40	6,760		東洋シャッター	—	1.5	1,047		オプトラン	5.9	6.9	22,114	
栗山鉄工所	4.3	3.1	4,724		LIXILグループ	84.8	91.2	172,732		NCホールディングス	—	2	946	
虹技	—	0.9	1,183		日本ファイルコン	13.5	4.7	2,368		イワキポンプ	—	2.6	2,589	
日本鑄鉄管	—	0.6	634		ノーリツ	12.2	12.8	16,793		フリュー	—	5	4,790	
三菱製鋼	5.2	4.6	5,405		長府製作所	5.9	6.3	15,756		ヤマシロフィルタ	10.4	10.8	8,434	
日亜鋼業	—	9	2,754		リンナイ	10.2	11	80,630		日阪製作所	10.1	7.6	6,802	
日本精線	1.7	0.9	2,313		ダイニチ工業	—	3.3	2,112		やまびこ	11.4	12	13,872	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
平田機工	2.3	2.9	20,126	20,126	大同工業	—	3	2,499	2,499	イビデン	34.6	38.3	80,544	80,544
ペガサスミシン製造	—	5.8	2,900	2,900	木村化工機	—	5.2	2,100	2,100	コニカミノルタ	135.3	136.7	108,539	108,539
マルマエ	—	2.5	2,152	2,152	アネスト岩田	11.1	9.7	9,457	9,457	ブラザー工業	70.1	81.5	165,282	165,282
タツモ	—	2.9	3,187	3,187	ダイフク	30	34.4	194,360	194,360	ミネベアミツミ	108.3	115.9	213,024	213,024
ナプテスコ	31.5	36.4	123,578	123,578	サムコ	—	1.7	1,530	1,530	日立	1,399	281.1	1,142,671	1,142,671
三井海洋開発	6.3	6.6	17,344	17,344	加藤製作所	3.4	3.2	6,118	6,118	三菱電機	582.7	624.6	913,477	913,477
レオン自動機	6.2	6.1	9,888	9,888	油研工業	3.1	1	1,588	1,588	富士電機	177	40.5	136,687	136,687
S M C	18.4	18.3	832,284	832,284	タダノ	27.7	30.2	32,012	32,012	東洋電機製造	4.3	2.5	3,992	3,992
ヤマハモーターロボHLDGS	—	4.7	1,941	1,941	フジテック	17.4	22.7	31,144	31,144	安川電機	68.2	72.4	281,998	281,998
ホンソカワミクロン	2.3	2.2	8,492	8,492	C K D	16.7	17.4	21,924	21,924	シンフォニアテクノロジー	41	8.7	10,657	10,657
ユニオンツール	2.9	2.3	7,532	7,532	キトー	5.2	4.7	7,322	7,322	明電舎	49	12.4	23,237	23,237
オイレス工業	7.8	8.7	14,415	14,415	平和	18	17.4	38,523	38,523	オリジン	3.6	1.7	2,378	2,378
日精エーエスピー	1.9	2.1	6,972	6,972	理想科学工業	6.2	5.5	9,229	9,229	山洋電気	2.9	3	14,040	14,040
サトーホールディングス	8.1	7.5	21,930	21,930	S A N K Y O	14	15.6	59,124	59,124	デンヨー	5.9	5.7	10,453	10,453
技研製作所	4.9	5.4	18,063	18,063	日本金銭機械	6.5	6.9	6,879	6,879	東芝テック	41	7.8	24,999	24,999
日本エアーテック	—	1.9	1,128	1,128	マースグループHLDGS	3.8	4	7,848	7,848	芝浦メカトロニクス	—	1.1	3,293	3,293
カワタ	—	1.7	1,635	1,635	福島工業	3.8	3.9	12,694	12,694	マブチモーター	15.5	17.3	70,670	70,670
日精樹脂工業	6.8	5.2	5,220	5,220	オーイズミ	—	2.6	1,183	1,183	日本電産	70.4	75.2	1,152,816	1,152,816
オカダアイオン	—	2.1	2,591	2,591	ダイコク電機	3.8	2.9	4,524	4,524	ユーエムシーエレクトロニクス	—	3.4	2,461	2,461
ワイエイシールディングス	—	2.5	1,732	1,732	竹内製作所	9.8	10.5	17,440	17,440	トックス・セミコンダクター	—	2.8	3,603	3,603
小松製作所	282.1	282.8	701,909	701,909	アmano	18.1	17.9	58,801	58,801	東光高岳	4.2	3.2	3,712	3,712
住友重機械	32.8	35.7	117,810	117,810	J U K I	9.2	8.7	7,882	7,882	ダブル・スコープ	9.6	8.6	5,357	5,357
日立建機	27.2	25	66,025	66,025	サンデンホールディングス	8.3	7.7	4,658	4,658	宮越ホールディングス	—	2.3	2,594	2,594
日工	—	1.7	5,831	5,831	蛇の目ミシン	—	5.8	2,360	2,360	ダイヘン	33	6.8	21,590	21,590
巴工業	4.3	2.7	6,604	6,604	マックス	9	9.5	17,480	17,480	ヤーマン	9.2	9.1	6,233	6,233
井関農機	6.1	6.3	9,418	9,418	グローリー	16.8	17.4	54,375	54,375	J V Cケンウッド	49.1	47.8	14,770	14,770
T O W A	5.9	5.4	4,438	4,438	新晃工業	6.9	5.8	10,614	10,614	ミマキエンジニアリング	—	5.6	2,990	2,990
丸山製作所	3.8	1.3	1,566	1,566	大和冷機工業	9	9	10,413	10,413	精工	3.6	2.3	5,759	5,759
北川鉄工所	3.9	2.8	5,572	5,572	セガサマーホールディングス	57.5	61.9	95,635	95,635	日新電機	13.4	14.6	18,556	18,556
ローツェ	3.4	2.7	6,671	6,671	日本ピストンリング	4.5	2.3	3,070	3,070	大崎電気	14.4	12.4	8,134	8,134
タカキタ	—	2.2	1,236	1,236	リケン	2.8	2.9	11,455	11,455	オムロン	61.5	66.4	387,112	387,112
クボタ	312.7	334.7	568,990	568,990	T P R	6.4	8.4	14,868	14,868	日東工業	10.6	10	21,200	21,200
荏原実業	—	1.6	3,257	3,257	ツバキ・ナカシマ	9.2	12.8	21,350	21,350	I D E C	8.1	8.4	17,110	17,110
三菱化工機	4.3	2.2	3,931	3,931	ホシザキ	17.2	18.3	152,256	152,256	正興電機製作所	—	1.4	1,107	1,107
月島機械	11.7	12.4	17,670	17,670	大豊工業	5.9	5.1	3,621	3,621	不二電機工業	—	0.7	858	858
帝国電機製作所	6.5	4.4	5,354	5,354	日本精工	118.3	128.4	121,851	121,851	ジーエス・ユアサコーポ	104	22.5	43,065	43,065
東京機械	—	2.4	888	888	N T N	128	134.6	42,533	42,533	サクサホールディングス	—	1.6	2,968	2,968
新東工業	13.3	14.8	14,430	14,430	ジェイテクト	60.2	59.9	77,390	77,390	メルコホールディングス	3.1	2.6	7,173	7,173
渋谷工業	5.6	5.4	15,222	15,222	不二越	5.5	5.8	27,492	27,492	テクノメディカ	—	1.4	3,148	3,148
アイチコーポレーション	9.9	10.8	7,830	7,830	日本トムソン	21	18.6	8,872	8,872	日本電気	74.6	80.9	381,039	381,039
小森コーポレーション	13.7	15.8	18,264	18,264	T H K	36.5	36.3	104,181	104,181	富士通	601	60.2	531,024	531,024
鶴見製作所	5.5	4.9	10,339	10,339	ユーシン精機	6.5	4.8	4,881	4,881	沖電気	22.3	27.1	40,514	40,514
住友精密	24	1	3,070	3,070	前澤給装工業	—	2.4	4,800	4,800	岩崎通信機	—	2.9	2,366	2,366
日本ギア工業	—	1.7	834	834	イーグル工業	6.7	7.7	7,807	7,807	電気興業	4.1	3.3	10,395	10,395
酒井重工業	1.6	1.2	3,444	3,444	前澤工業	—	4.2	1,507	1,507	サンケン電気	36	7.3	15,921	15,921
荏原製作所	26	27.7	78,584	78,584	日本ピラー工業	7.3	6.3	8,019	8,019	ナカヨ	—	1.2	1,951	1,951
石井鉄工所	—	0.9	1,849	1,849	キッツ	25.3	25.4	18,694	18,694	アイホン	5.7	3.5	5,659	5,659
西島製作所	7.4	6.4	6,444	6,444	マキタ	76	76	248,900	248,900	ルネサスエレクトロニクス	61.9	297.4	197,176	197,176
北越工業	8.4	6.4	8,096	8,096	日立造船	42	49.6	17,508	17,508	セイコーエプソン	85.6	77.6	120,900	120,900
ダイキン工業	80	85.3	1,234,717	1,234,717	三菱重工業	96.8	104.7	459,318	459,318	ワコム	47.6	45.3	16,489	16,489
オルガノ	2.8	2.2	10,153	10,153	I H I	44.8	48	115,296	115,296	アルバック	13.5	12.5	56,187	56,187
トーヨーカネツ	3	2.4	4,646	4,646	スター精密	10.2	9.8	15,170	15,170	アクセル	—	2.6	1,630	1,630
栗田工業	31	33.8	98,527	98,527	<b>電気機器 (13.9%)</b>					E I Z O	5.5	5.7	21,546	21,546
椿本チエイン	33	8.2	28,331	28,331	日清紡ホールディングス	36.9	41.7	36,612	36,612	ジャパンディスプレイ	124.6	61.7	4,010	4,010

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円
日本信号	16.2	15.9	19,588		コーセル	8.8	7.6	8,002		サノヤホールディングス	—	8.3	1,560	
京三製作所	16.7	13.4	5,252		イリソ電子工業	4.9	5.7	30,210		日本車輛	27	2.3	5,754	
能美防災	8.6	8.2	17,744		オプテックスグループ	10.9	10.3	16,799		三菱ロジスネクスト	7.9	10.3	10,629	
ホーチキ	5.4	4	6,132		千代田インテグレ	3.2	2.9	6,214		近畿車輛	—	1	1,308	
星和電機	—	3.3	1,692		アイ・オー・データ	—	2.3	2,051		日産自動車	688.4	736.8	525,854	
エレコム	5.8	5.9	25,281		レーザーテック	12.6	12.8	84,224		いすゞ自動車	169.6	197.5	246,183	
パナソニック	665.8	714.1	637,405		スタンレー電気	44.3	44.1	125,199		トヨタ自動車	710.4	695.9	5,124,607	
シャープ	58	62.1	77,252		岩崎電気	4.7	2.4	3,024		日野自動車	82.4	78	73,242	
アンリツ	43.3	40.2	86,912		ウシオ電機	32.3	36.3	55,212		三菱自動車工業	215.7	231.5	114,824	
富士通ゼネラル	18.2	19.1	34,208		岡谷電機	—	4.5	1,768		エフテック	6	4.4	3,119	
ソニー	391.7	419.2	2,672,400		ヘリオステクノH	8.3	5.8	3,277		レシップホールディングス	—	2.5	1,982	
TDK	30.7	32.7	312,285		エノモト	—	1.7	1,621		GMB	—	1.2	944	
帝国通信工業	6.9	2.7	3,088		日本セラミック	6.1	6.3	17,545		ファルテック	—	1.1	810	
タムラ製作所	24.7	24.1	14,050		遠藤照明	—	3.2	2,147		武蔵精密工業	6.6	15.2	21,690	
アルプスアルパイン	50.3	65.1	134,301		古河電池	7.5	4.5	2,758		日産車体	22.2	12.2	11,529	
池上通信機	48	2	2,196		双信電機	—	3	1,317		新明和工業	25.6	26.1	34,530	
パイオニア	118.6	—	—		山一電機	5.2	4.5	5,584		極東開発工業	11.5	12.4	16,516	
日本電波工業	12.8	5.7	2,559		図研	4.8	4.1	7,662		日信工業	11.6	11.4	17,122	
鈴木	—	3.3	2,154		日本電子	23	12.3	31,082		トピー工業	4.9	5.2	10,301	
日本トリム	1.7	1.2	5,622		カシオ	46.9	55.4	88,806		ティラド	2.6	2.3	4,245	
ローランドディー・ジー	3.6	3.4	6,895		ファナック	55.5	59.3	1,212,388		曙ブレーキ	34.9	—	—	
フオスター電機	7.7	7.1	13,312		日本シイエムケイ	11.7	15.9	9,428		タチエス	10.4	10.3	13,328	
クラリオン	35	—	—		エンプラス	2.9	2.8	9,786		NOK	28.7	33.6	56,078	
S/MK	20	1.7	4,807		大真空	4.1	2.3	2,357		フタバ産業	18.7	17.4	13,224	
ヨコオ	5.2	4.5	13,171		ローム	26.2	29.9	256,841		K Y B	6	6.5	20,962	
ティアック	—	4.5	864		浜松ホトニクス	41.7	44.8	177,184		大同メタル工業	9.4	10.2	6,660	
ホシデン	15.1	18.3	19,947		三井ハイテック	8.5	6.9	11,605		プレス工業	33.1	30.9	14,708	
ヒロセ電機	9.4	8.9	118,192		新光電気工業	22.1	21	20,328		ミクニ	—	7.9	2,528	
日本航空電子	15	14.3	23,266		京セラ	95.7	95.2	645,932		太平洋工業	12.9	13.1	20,514	
T O A	8.5	6.7	8,770		太陽誘電	28.8	27.8	69,249		ケーケン	13.3	14.3	22,908	
マクセルホールディングス	11.5	13.5	20,965		村田製作所	61.3	196.6	992,043		河西工業	8.1	7.7	6,460	
古野電気	8.3	8	7,784		ユージン	15.5	—	—		アイシン精機	48.2	51.4	182,727	
ユニテックホールディングス	23	1.8	3,430		双葉電子工業	9.2	9.9	13,612		マツダ	179.4	196	192,334	
アルパイン	13.9	—	—		北陸電気工業	5.4	2.3	2,357		今仙電機製作所	8.3	5.7	5,118	
スミダコーポレーション	6	4.8	5,040		ニチコン	18.9	19.7	19,542		本田技研	524.5	526.8	1,520,081	
アイコム	3.8	3.4	7,517		日本ケミコン	5	4.4	7,066		スズキ	116.2	114.3	492,061	
リオン	3.7	2.9	6,672		K O A	8.5	9.4	12,737		SUBARU	181	193.9	593,915	
本多通信工業	7.3	5.3	2,782		市光工業	10.4	9.4	7,830		安永	3.5	3	3,984	
船井電機	10	6.3	3,717		小糸製作所	35.2	37.4	203,082		ヤマハ発動機	82	81.4	157,590	
横河電機	58.2	62.5	125,562		ミツバ	11.4	11.5	7,440		ショーワ	15.9	14.7	22,755	
新電元工業	2.2	2.2	7,975		SCREENホールディングス	11.2	10.9	71,286		T B K	20.8	7.4	3,093	
アズビル	17.3	39.4	114,732		キャノン電子	4.6	6.5	11,914		エクセディ	6.7	8.5	18,096	
東亜ディーケーケー	—	3.1	2,669		キャノン	312.6	336.4	985,147		豊田合成	20.8	20.2	44,561	
日本光電工業	24.4	27.5	86,350		リコー	175.8	188.2	195,163		愛三工業	11.1	9.8	8,055	
チノー	—	2.2	3,042		象印マホービン	11.5	18.3	25,912		盟和産業	—	1	1,104	
共和電業	20.1	6.5	2,743		MUTOHホールディングス	—	0.9	1,480		日本プラスト	—	4.9	3,449	
日本電子材料	—	2.5	1,290		東京エレクトロン	39.1	41.6	864,448		ヨロズ	6.9	5.9	7,929	
堀場製作所	11.7	12.4	77,748		輸送用機器 (7.9%)	—	—	—		エフ・シー・シー	9.8	11.2	24,124	
アドバンテスト	33.1	42.6	200,646		トヨタ紡織	16.6	21.8	33,223		シマノ	23.6	23.4	381,420	
小野測器	—	2.6	1,375		芦森工業	—	1.3	1,847		テイ・エス テック	13.5	14.5	47,922	
エスベック	6.1	5.5	10,538		ユニプレス	10.9	12.1	21,308		ジャムコ	3.2	3.1	4,836	
キーエンス	28.7	30.7	2,053,523		豊田自動織機	46.6	50.6	320,804		精密機器 (2.2%)	—	—	—	
日置電機	3.5	3.3	11,797		モリタホールディングス	9.7	10.9	19,532		テルモ	89.9	176.7	585,760	
シスメックス	45.6	48.7	357,068		三桜工業	11.7	8	4,800		クリエートメディック	—	2.1	1,990	
日本マイクロニクス	11.2	10.9	9,537		デンソー	129.6	137.5	667,425		日機装	19.3	18.7	21,561	
メガチップス	5.2	4.9	8,491		東海理化電機	14.8	16.3	30,839		島津製作所	70.2	80.4	227,532	
OBARA GROUP	3.3	3.2	11,904		三井 E&SHD	21.1	21.7	20,463		J M S	—	5.7	3,665	
澤藤電機	—	0.8	1,368		川崎重工業	44.2	48.7	112,691		クボテック	—	1.3	565	
原田工業	—	2.5	2,087		名村造船所	19.2	18.9	5,726		長野計器	7.5	4.9	3,567	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ブイ・テクノロジー	1.4	2.9	15,863		アシックス	57.6	51.6	88,029		ハマキョウレックス	4.6	4.8	17,664	
東京計器	5.2	4	3,632		ツツミ	—	2	4,200		サカイ引越センター	3.4	3.3	20,988	
愛知時計	—	0.8	3,264		小松ウオール工業	—	1.9	3,733		近鉄グループHLDGS	54.2	59.2	342,768	
インターアクション	—	3.4	7,112		ヤマハ	38.6	37.2	178,932		阪急阪神HLDGS	73.2	78.9	336,114	
オーバル	—	6.1	1,409		河合楽器	2.6	1.9	5,399		南海電鉄	26.2	26.5	77,300	
東京精密	10.2	11.3	36,329		クリナップ	9.7	5.8	3,248		京阪ホールディングス	24.6	26.3	127,818	
マニー	7.4	24.9	65,188		ビジョン	35.5	37.7	166,257		神戸電鉄	—	1.5	6,067	
ニコン	101.1	108.8	151,123		兼松サステック	—	0.4	724		名古屋鉄道	44.1	48.6	162,324	
トプコン	30.8	33.6	48,484		キングジム	9.5	5.2	4,518		山陽電鉄	5.1	4.6	10,695	
オリンパス	86.7	372.2	522,941		リンテック	13.2	14.8	31,642		日本通運	21.5	22.8	132,012	
理研計器	6.1	5.5	11,654		イトーキ	15.4	11.7	5,276		ヤマトホールディングス	97.7	103.8	197,116	
タムロン	5.9	5	11,340		任天堂	36.1	35.7	1,515,822		山九	14.2	16.4	91,184	
HOYA	117.7	125.7	1,112,445		三菱鉛筆	9.3	10.3	18,055		丸運	—	3.2	832	
シード	—	2.7	2,513		タカラスタンダード	12	12.9	23,632		丸全昭和運輸	22	4.8	15,432	
ノーリツ鋼機	6.7	4.9	8,854		ココロ	27.9	29.9	44,102		セコウグループHLDGS	34.3	32.6	27,873	
イー・アンド・ディ	8.2	5.7	4,012		ナカバヤシ	12.6	6.1	3,214		トナミホールディングス	1.7	1.4	7,322	
朝日インテック	—	53	145,909		グロープライド	3.5	3	8,766		ニッコンホールディングス	19.7	22.4	57,433	
シチズン時計	66.7	68.5	37,195		オカムラ	20.9	21.8	24,198		日石輸送	—	0.7	2,008	
リズム時計	5	2.1	2,272		美津濃	6.1	6.2	17,428		福山通運	8.6	7.6	30,134	
大研医器	—	5	2,675		<b>電気・ガス業 (1.7%)</b>					セイノーホールディングス	41.8	44.3	62,595	
メニコン	8.6	8.6	33,583		東京電力HD	467.3	498.4	274,618		エスライン	—	1.8	1,551	
シンシア	—	0.7	446		中部電力	179.5	191	316,487		神奈川中央交通	—	1.5	5,917	
松風	—	3	4,590		関西電力	239.2	254.8	353,917		日立物流	12.3	13	42,445	
セイコーHD	9.4	9.7	23,086		中国電力	78.9	86.3	123,926		丸和運輸機関	3.4	3.1	16,554	
ニプロ	40.4	43.3	54,731		北陸電力	56.7	61.4	45,743		C&Fロジホールディングス	—	6	7,566	
<b>その他製品 (2.3%)</b>					東北電力	136.4	146.4	164,553		九州旅客鉄道	46.1	49.6	167,896	
中本パックス	—	1.7	2,451		四国電力	52.6	56.3	61,367		SGホールディングス	52.9	55.9	153,780	
スノーピーク	—	2.8	3,654		九州電力	129	128.8	142,195		<b>海運業 (0.2%)</b>				
パラマウントベッドHD	6	7.2	29,268		北海道電力	58.4	58.5	34,047		日本郵船	45.2	49.5	92,367	
トランザクション	—	4	3,996		沖縄電力	12.4	11.6	20,358		商船三井	34.2	35.1	102,070	
S H O - B I	14	1.8	694		電源開発	46	49.7	130,661		川崎汽船	24.9	18.3	24,174	
ニホンフラッシュ	3.6	2.7	6,655		エフオン	—	3	2,163		NSユナイテッド海運	2.9	3.3	7,603	
前田工織	8.1	6.9	9,949		イーレックス	10.8	10.9	12,131		明治海運	—	6.3	1,965	
永大産業	—	8.3	2,888		レノバ	—	10.3	9,239		飯野海運	30.1	28.1	9,806	
アートネイチャー	10.7	6.6	4,402		東京瓦斯	123.2	120.1	339,582		共栄タンカー	—	0.5	693	
パンダイナムコHLDGS	60.5	64.6	412,148		大阪瓦斯	112	121.1	252,251		乾汽船	—	5.3	5,851	
アイフィスジャパン	—	1.5	1,105		東邦瓦斯	29.1	31	133,765		<b>空運業 (0.5%)</b>				
共立印刷	—	10.4	1,674		北海道瓦斯	34	3.3	5,148		日本航空	101.3	108.2	368,637	
S H O E I	3.2	3	14,460		広島ガス	—	12.8	4,377		ANAホールディングス	107.4	108	402,948	
フランスベッドHLDGS	—	8.8	9,398		西部瓦斯	7.2	7	17,080		パスコ	—	1.1	991	
パイロットコーポレーション	10.1	10.9	43,382		静岡ガス	20.2	17.7	16,496		<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
萩原工業	5.4	3.5	5,334		メタウォーター	3.4	3	11,250		トランコム	1.8	1.7	10,506	
トップパン・フォームズ	12.4	13.4	13,574		<b>陸運業 (4.8%)</b>					日新	5.2	5.1	8,078	
フジールインターナショナル	13	14	39,858		SBSホールディングス	—	5.4	8,656		三菱倉庫	18.9	20.5	56,313	
タカラトミー	25.6	26.2	31,544		東武鉄道	61.5	65.9	233,945		三井倉庫 HOLD	38	7.3	12,468	
廣済堂	—	5.8	4,158		相鉄ホールディングス	18.3	21.5	63,683		住友倉庫	37	21.7	31,573	
エステールホールディングス	—	1.6	1,008		東急	158.9	169.7	354,333		渋谷倉庫	5.7	3.2	6,313	
アーク	—	23.8	2,237		京浜急行	79.8	85.6	184,382		東陽倉庫	33.2	10.7	3,573	
タカノ	—	2.5	1,985		小田急電鉄	87.5	100.1	261,261		日本トランスシティ	18.4	13	6,487	
プロネクサス	—	5.4	6,301		京王電鉄	32.9	34.9	242,206		ケイヒン	—	1.1	1,375	
ホクシン	—	3.7	555		京成電鉄	41.2	46.8	204,516		中央倉庫	—	3.6	3,956	
ウッドワン	—	2.1	2,209		富士急行	8.6	8.5	40,800		川西倉庫	—	1.2	1,310	
大建工業	5.4	4.7	9,696		新京成電鉄	—	1.6	3,408		安田倉庫	—	4.8	4,550	
凸版印刷	157	92.8	177,155		東日本旅客鉄道	104.2	109.9	1,159,445		フェイス	—	1.1	795	
大日本印刷	75.3	88	244,112		西日本旅客鉄道	52.4	55.6	524,808		東洋埠頭	8	1.8	2,462	
共同印刷	3.3	1.9	5,302		東海旅客鉄道	52.5	55.9	1,257,750		宇徳	—	5	2,495	
N I S S H A	12.4	12.9	13,416		西武ホールディングス	74.4	77.4	148,143		上組	32.9	36.4	91,946	
光村印刷	—	0.5	899		鴻池運輸	8.6	9.9	16,760		サンリツ	—	1.4	910	
宝印刷	7.2	3	5,130		西日本鉄道	16	17.4	43,065		キムラユニティ	—	1.6	1,664	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
キユーソー流通システム	2.6	1.5	2,851		プロシップ	—	1.8	2,133		野村総合研究所	37	116.9	247,126	
近鉄エクスプレス	10.3	11.2	17,281		ガンホー・オンライン・エンター	138	14.8	35,283		サイバネットシステム	—	4.4	2,807	
東海運	—	3.4	972		GMOベイメントゲートウェイ	5	10.1	74,841		C Eホールディングス	—	1.8	1,773	
エアィティイー	—	3.8	3,739		ザッパラス	—	3	1,065		日本システム技術	—	1	1,240	
内外トランスライン	6.3	2.1	2,799		システムリサーチ	—	0.8	3,168		インテジホールディングス	9.6	7.7	7,361	
日本コンセプト	—	1.9	2,458		インターネットインシアティブ	10.6	10	25,380		東邦システムサイエンス	—	1.8	1,953	
情報・通信業 (8.6%)					さくらインターネット	13.9	7.3	4,511		ソースネクスト	—	23.8	10,852	
NEC ネットエスアイ	6.1	6.8	20,434		ヴィンクス	—	1.7	2,045		インフォコム	—	6.7	16,817	
クロスキャット	—	1.6	1,644		GMOクラウド	—	1.1	2,931		F I G	—	6.4	2,003	
システナ	19.9	21.9	34,492		SRA ホールディングス	3.7	3.3	8,316		アルテリア・ネットワークス	—	6.8	9,445	
デジタルアーツ	3.2	3.3	22,902		MINORIソリューションズ	—	1.2	2,287		ヒト・コミュニケーションズHD	—	1.4	2,436	
日鉄ソリューションズ	9.5	9.2	34,086		システムインテグレータ	5.8	1.7	1,128		フォーカスシステムズ	—	4.2	3,637	
キューブシステム	9.2	3.3	2,692		朝日ネット	23	4.9	3,332		クレスコ	2.1	1.9	6,678	
エイジア	—	1.2	1,462		e B A S E	—	3.7	3,681		フジ・メディア・HD	59.3	63.6	92,283	
コア	4.8	2.6	3,476		アバント	—	2.2	4,459		オービック	18.5	21.3	261,990	
ソリトンシステムズ	—	2.7	2,654		アドソル日進	—	2.2	4,851		ジャストシステム	10	8.7	34,104	
ソフトクリエイトHD	5.7	2.7	4,708		フリービット	—	3.7	3,226		T D Cソフト	—	5.4	4,222	
T I S	19.5	20.4	126,684		コムチュア	3.9	3.4	13,957		ヤフー	423.2	399.9	125,568	
ネオス	—	2.5	1,930		サイバーコム	—	1.1	1,962		トレンドマイクロ	30.9	27.3	143,598	
電算システム	6.3	2.3	6,796		アステリア	—	4.1	2,607		IDホールディングス	—	2.4	2,985	
グリー	33.4	42.5	21,335		アイル	—	1	2,496		日本オラクル	9.7	12.4	120,156	
コーエーテックモHD	9.6	12.5	28,862		マークラインズ	—	3.1	5,871		アルファシステムズ	—	1.9	5,390	
三菱総合研究所	2.8	2.6	9,659		メディカル・データ・ビジ	—	4.7	5,856		フューチャー	9.7	7.4	13,845	
ボルテージ	—	1.2	597		g u m i	9.5	7.9	5,293		CAC HOLDINGS	8.8	4	5,252	
電算	—	0.7	1,428		ショーケース	—	1.3	947		ソフトバンク・テクノ	—	2.6	5,460	
AGS	—	3.5	2,415		モバイルファクトリー	—	1.4	2,238		トーセ	—	1.7	1,416	
ファインデックス	—	5.2	4,940		テラスカイ	—	1	1,807		オービックビジネスC	3.2	6.3	28,444	
ブレインパッド	—	1.2	8,016		デジタル・インフォメーション	—	2.7	4,152		伊藤忠テクノソリューションズ	26.8	27.9	82,053	
K L a b	10.9	11.8	12,944		PCIホールディングス	—	1.3	2,730		アイティフォー	10.3	7.5	6,465	
ポルトウイン・ビットクル	5	8.2	8,405		パイプHD	—	1	1,330		東計電算	—	0.9	2,736	
イブツクインシアティブ	—	1	1,826		アイビシー	—	1.1	1,179		エクスネット	—	1.1	1,090	
ネクソン	146.2	173.9	251,285		ネオジャパン	—	1.2	1,160		大塚商会	31.6	33.2	139,606	
アイスタイル	16.3	15.8	10,649		P R T I M E S	—	0.5	1,364		サイボウズ	15.4	7.2	7,545	
エムアップ	—	2.1	4,733		ランドコンピュータ	—	0.9	984		ソフトブレイン	—	3.6	2,559	
エイチーム	5.2	4.3	4,588		ダブルスタンダード	—	0.5	2,462		電通国際情報S	4.1	3.8	13,224	
エニグモ	—	4.4	4,426		オープンドア	—	3	6,705		デジタルガレージ	10.7	12	40,380	
テクノスジャパン	10	5.2	2,698		マイネット	—	2	982		イーエムシステムズ	6.5	5	9,935	
e n i s h	—	2.7	2,340		アカツキ	1.8	2.2	16,786		ウェザーニューズ	3.3	2.1	7,140	
コロブラ	16.5	20.1	17,708		ベネフィットジャパン	—	0.4	639		C I J	13.2	4.6	3,831	
オルトプラス	—	4.1	1,070		UBICOMホールディングス	—	1.1	1,640		東洋ビジネスエンジ	—	0.6	1,634	
ブロードリーフ	31.2	30.4	18,088		LINE	18.2	14.1	56,541		日本エンタープライズ	—	6.1	1,079	
クロス・マーケティングG	—	2.6	925		カナミックネットワーク	—	3.7	2,109		WOWOW	3.2	2.9	7,772	
デジタルハーツHLDGS	5.1	2.8	2,704		ノムラシステムコーポレーション	—	1.4	670		スカラ	—	4.3	4,368	
システム情報	—	3.1	3,158		チェンジ	—	1.2	2,341		インテリジェントウェイブ	—	2.3	1,876	
メディアドゥHLDGS	3	2.2	7,788		シンクロ・フード	—	2.6	1,352		IMAGICA GROUP	—	5.1	2,616	
じげん	—	8.7	5,106		オークネット	—	3.4	4,668		ネットワンシステムズ	24.4	21.7	62,018	
ブイキューブ	—	3.3	1,425		セグエグループ	—	0.2	275		システムソフト	—	14.5	1,580	
エンカレッジ・テクノロジ	—	0.8	600		イトレッド	—	0.7	1,145		アルゴグラフィックス	3.3	5.2	13,717	
サイバーリンクス	—	0.9	990		AOI TYO HOLDINGS	7.9	6.2	3,949		マーベラス	10	9.4	7,501	
ディー・エル・イー	—	4.3	769		マクロミル	8.2	10.9	10,017		エイバックス	11	10.5	13,807	
フィックスターズ	—	6.5	9,386		ビーグリー	—	1.3	1,201		日本ユニシス	17	19.1	66,181	
CARTA HOLDINGS	—	3	3,090		オロ	—	1.6	4,324		兼松エレクトロニクス	3.9	3.3	10,230	
オプティム	—	2.7	7,630		テモナ	—	0.8	448		東京放送HD	31.3	40.7	73,219	
セレス	—	2	2,594		ニーズウェル	—	0.4	298		日本テレビHLDGS	52	56.3	80,790	
ティアーガイア	6.1	4.4	9,803		サインポスト	—	0.9	2,079		朝日放送グループHD	—	6	4,440	
セック	—	1	3,105		ソルクシーズ	—	2.6	2,540		テレビ朝日HD	15.3	16.9	30,132	
日本アジアグループ	—	6.5	2,145		フェイス	—	2.4	1,881		スカパーJSATHD	44.2	40.5	18,022	
豆蔵ホールディングス	7.9	4.2	6,917		プロトコーポレーション	—	5.5	6,501		テレビ東京HD	5.4	5	11,305	
テクマトリックス	—	4.3	9,601		ハイマックス	—	0.7	1,295		日本BS放送	5.9	2	2,150	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ビジョン	—	1.9	9,215	9,215	ラサ商事	—	3.3	2,801	2,801	マルカ	3.9	2.2	4,492	4,492
スマートバリュー	—	1.8	1,285	1,285	ラクーンホールディングス	—	3	1,884	1,884	I DOM	21	20.8	9,484	9,484
USEN-NEXT HLDGS	—	2.3	1,867	1,867	アルコニック	7.4	6.5	7,988	7,988	日本エム・ディ・エム	—	3.6	6,159	6,159
ワイヤレスゲート	6.6	2.7	1,773	1,773	神戸物産	4.5	10.6	53,000	53,000	進和	4.4	3.6	7,941	7,941
コネクシオ	4.7	4.4	6,261	6,261	あいホールディングス	9.6	8.8	15,840	15,840	エスケイジャパン	—	1.5	615	615
日本通信	65.2	53.8	11,029	11,029	ディーブイエックス	5.7	2.4	2,080	2,080	ダイトロン	4.1	2.6	3,424	3,424
クロップス	—	1.1	669	669	ダイワボウHD	5.1	5.6	24,332	24,332	シークス	7.4	7.8	11,723	11,723
日本電信電話	411	419.2	2,209,603	2,209,603	マクニカ・富士エレHLDGS	11	17.1	24,931	24,931	田中商事	—	2.1	1,360	1,360
KDDI	505.4	502.4	1,440,380	1,440,380	ラクト・ジャパン	—	2.3	8,636	8,636	オーハシテクニカ	—	3.5	4,928	4,928
ソフトバンク	—	649.9	994,347	994,347	バイタルK S K HD	10.7	11.5	12,489	12,489	白銅	—	2	2,768	2,768
光通信	7	7.2	175,896	175,896	八洲電機	—	4.9	4,444	4,444	伊藤忠	422.7	430.1	990,090	990,090
NTTドコモ	411.6	388	1,082,132	1,082,132	メディアスホールディングス	—	3.5	2,537	2,537	丸紅	472.9	606.5	456,815	456,815
エムティーアイ	12.4	6	4,404	4,404	レスターホールディングス	4.1	6.8	11,954	11,954	高島	4.2	1	1,606	1,606
GMOインターネット	22.1	24.2	44,019	44,019	ジューテックHD	—	1.4	1,372	1,372	長瀬産業	32.3	34.5	54,303	54,303
ファイバーゲート	—	1.2	1,749	1,749	大光	—	2.6	1,762	1,762	蝶理	4.3	3.9	6,735	6,735
アйдマーケティングコミュニ	—	1.3	728	728	OCHIホールディングス	—	1.8	2,295	2,295	豊田通商	62.8	68.7	250,411	250,411
KADOKAWA	17.4	17.9	27,780	27,780	TOKAIホールディングス	31.6	32.5	33,540	33,540	三共生興	—	10.5	5,523	5,523
学研ホールディングス	—	2.1	11,550	11,550	黒谷	—	1.4	609	609	兼松	24.5	24.6	30,430	30,430
ゼンリン	11	12.3	23,222	23,222	Cominix	—	1.1	900	900	ツカモトコーポレーション	6.1	1.1	1,168	1,168
昭文社	—	2.7	1,058	1,058	三洋貿易	3.9	3.1	7,114	7,114	三井物産	474	506.7	931,567	931,567
インプレスホールディングス	—	4.9	705	705	ビューティガレージ	—	1	1,930	1,930	日本紙パルプ	2.7	3.5	13,877	13,877
アイネット	—	3.5	4,837	4,837	ウイン・パートナーズ	5.4	4	4,708	4,708	日立ハイテクノロジーズ	19.8	18.7	117,249	117,249
松竹	3.8	4.1	55,555	55,555	ミタチ産業	—	1.8	1,225	1,225	カメイ	7.2	8	9,048	9,048
東宝	37.8	40.3	189,611	189,611	シッパヘルスケアHD	11.6	12.8	60,160	60,160	東都水産	—	0.9	2,367	2,367
東映	2.2	2.6	39,806	39,806	明治電機工業	—	1.9	2,597	2,597	OUGホールディングス	—	1	2,780	2,780
NTTデータ	181.1	163.2	232,396	232,396	デリカフーズHLDGS	—	2.2	1,610	1,610	スターゼン	2.6	2.3	10,051	10,051
ビー・シー・エー	—	0.8	3,076	3,076	スターティアホールディングス	—	1.2	643	643	山善	22.1	24	23,448	23,448
ビジネスB太田昭和	—	1.1	2,788	2,788	コメダホールディングス	11.8	14.3	29,129	29,129	椿本興業	—	1.4	5,159	5,159
DT S	6.3	13.7	31,551	31,551	富士興産	—	2.4	1,730	1,730	住友商事	361.5	363.8	638,650	638,650
スクウェア・エニックス・HD	27	28.5	130,957	130,957	協栄産業	—	0.7	945	945	内田洋行	3.3	2.6	9,971	9,971
シーイーシー	8	6.6	13,695	13,695	小野建	6	5.5	7,573	7,573	三菱商事	404.1	431.6	1,201,142	1,201,142
カプコン	25.4	26.3	73,192	73,192	南陽	—	1.3	2,086	2,086	第一実業	3.2	2.8	8,414	8,414
アイ・エス・ビー	—	1.2	1,773	1,773	佐鳥電機	7.5	4.5	3,532	3,532	キャノンマーケティングJPN	16.6	17.6	40,145	40,145
ジャストテック	8.1	3.6	4,125	4,125	エコートレーディング	—	1.5	793	793	西華産業	4.2	3.5	4,770	4,770
S C S K	13.7	16.2	84,888	84,888	伯東	4.3	4.2	5,027	5,027	佐藤商事	—	5.5	4,768	4,768
日本システムウエア	—	2	4,968	4,968	コンドーテック	10.4	4.7	4,418	4,418	菱洋エレクトロ	6	6.2	11,643	11,643
アイネス	11.1	7.8	8,876	8,876	中山福	—	3.5	1,890	1,890	東京産業	—	6.1	3,117	3,117
T K C	5.3	5.2	24,336	24,336	ナガイレーベン	8.4	8.9	20,434	20,434	ユアサ商事	5.4	6.3	19,939	19,939
富士ソフト	9.3	7.9	36,656	36,656	三菱食品	5.8	6.7	18,371	18,371	神鋼商事	2	1.4	3,388	3,388
NSD	9.9	10.1	31,916	31,916	松田産業	5.5	4.5	6,682	6,682	小林産業	—	3.7	1,054	1,054
コナミホールディングス	23.1	25	125,500	125,500	第一興商	8.4	9.1	45,500	45,500	阪和興業	10.5	10.7	33,116	33,116
福井コンピュータHLDGS	—	2	4,806	4,806	メディアパルHD	56.2	66.3	163,694	163,694	正栄食品	3.4	4	13,260	13,260
JBCCホールディングス	9.6	4.8	7,497	7,497	S P K	—	1.3	3,273	3,273	カナデン	7.1	5.6	7,627	7,627
ミロク情報サービス	5.7	6.1	18,239	18,239	萩原電気HLDGS	2.9	2.3	6,189	6,189	菱電商事	5.3	4.9	8,080	8,080
ソフトバンクグループ	259.9	486.3	2,244,760	2,244,760	アズワン	4.7	4.4	39,468	39,468	フルサト工業	—	3.4	4,991	4,991
卸売業 (4.9%)					スズデン	—	2.1	2,950	2,950	岩谷産業	12.5	13.6	48,892	48,892
ハウスイ	—	0.5	416	416	尾家産業	—	2	2,736	2,736	すてきなグループ	8.1	2.5	1,852	1,852
高千穂交易	—	2.4	2,692	2,692	シモジマ	—	3.8	4,320	4,320	昭光通商	—	2.1	1,327	1,327
伊藤忠食品	—	1.5	6,615	6,615	ドウシシャ	6.5	5.8	10,324	10,324	ニチモウ	—	1	1,823	1,823
エレマテック	2.9	5.7	5,962	5,962	小津産業	5.5	1.4	2,602	2,602	極東貿易	19	1.9	3,473	3,473
JALUX	2.5	1.7	4,117	4,117	高速	—	3.7	4,902	4,902	イフキ	13.3	8.1	4,001	4,001
あらた	3.1	4.5	17,662	17,662	たけびし	—	2.1	2,866	2,866	三菱石油	14.6	16.5	18,414	18,414
トーメンデバイス	—	0.9	2,200	2,200	リックス	—	1.4	2,161	2,161	稲畑産業	13.7	14.8	19,920	19,920
東京エレクトロデバイス	3.6	2.2	4,620	4,620	丸文	7	5.4	3,072	3,072	G S I クレオス	—	1.6	1,665	1,665
フィールズ	5.7	5.4	2,829	2,829	ハビネット	5.3	5.1	6,665	6,665	明和産業	—	5.7	3,562	3,562
双日	340.9	340	119,000	119,000	橋本総業HLDGS	—	1.2	1,920	1,920	クワザワ	—	2.2	1,179	1,179
アルフレッサホールディングス	63.4	68.3	172,252	172,252	日本ライフライン	16.8	18.2	33,979	33,979	ワキタ	12.9	13.1	14,658	14,658
横浜冷凍	16.4	17.3	18,095	18,095	タカショー	—	3	1,374	1,374	東邦ホールディングス	15.7	18.2	46,956	46,956
神栄	—	0.8	604	604	エクセル	3.5	2.3	2,879	2,879	サンゲツ	16.7	18.1	37,503	37,503

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ミツウロコグループ	8.7	8.2	8,347	8,347	バルグループ HLDGS	3.4	3.1	10,354	10,354	葉王堂	2.8	—	—	—
シナネンホールディングス	2.4	2.5	4,337	4,337	エディオン	22.6	26.1	26,961	26,961	グリエイト・レストランツ・ホール	16.5	16.6	29,564	29,564
伊藤忠エネクス	10.4	13.5	11,502	11,502	サーラコーポレーション	13.7	12.5	7,737	7,737	ツルハホールディングス	12.6	13.4	156,780	156,780
サンリオ	16	19	40,660	40,660	ウツツ	7.2	2.8	1,747	1,747	サンマルクホールディングス	4.1	4.9	12,068	12,068
サンワテクノス	5.4	3.7	3,059	3,059	ハローズ	3.6	2.3	5,285	5,285	フェリシモ	—	1.4	1,432	1,432
リョーサン	6.2	6.8	18,734	18,734	フジオフードシステム	—	2.6	7,397	7,397	トリドールホールディングス	7.6	7.6	19,782	19,782
新光商事	7.3	5.8	10,904	10,904	あみやき亭	2.2	1.3	4,524	4,524	TOKYO BASE	7.2	5.6	4,877	4,877
トーホー	4.5	2.8	5,104	5,104	ひらまつ	16.2	12.4	4,439	4,439	ウイルプラス HLDGS	—	0.9	687	687
三信電気	5.9	4.2	6,531	6,531	大黒天物産	1.9	1.5	5,130	5,130	ジャパンミート	—	3.1	7,068	7,068
東陽テクニカ	11.5	7.1	7,753	7,753	ハニースホールディングス	10	5.4	7,862	7,862	サツドラホールディングス	—	0.9	1,594	1,594
モスフード サービス	7.2	8.1	20,379	20,379	ファーマライズ HD	—	1.4	800	800	デファクトスタンダード	—	0.5	157	157
加賀電子	5.2	6.1	12,480	12,480	アルペン	4.4	4.7	8,022	8,022	アレンザホールディングス	6.2	3.3	2,623	2,623
ソーダニツカ	—	6.4	3,628	3,628	ハブ	—	2	2,542	2,542	串カツ田中 HLDGS	—	0.9	1,923	1,923
立花エレクトック	—	4.5	7,623	7,623	クオールホールディングス	6.9	9.1	13,686	13,686	パロックジャパン	—	5	5,030	5,030
フォーバル	—	2.7	2,548	2,548	ジンスホールディングス	4.1	3.3	21,417	21,417	クスリのアオキ HLDGS	4.7	6.1	50,203	50,203
PALTA C	8.3	11.1	60,606	60,606	ビックカメラ	31.7	36.5	40,770	40,770	カの源 HD	—	2.3	1,920	1,920
三谷産業	—	7.2	2,095	2,095	DCM ホールディングス	27.6	33.2	35,391	35,391	スシローグローバル HLDGS	6.7	6.8	48,076	48,076
太平洋興発	—	2.4	1,864	1,864	ペッパーフードサービス	4.8	4.9	7,697	7,697	L I X I L ビバ	7.7	5.2	8,751	8,751
西本 WISMETTAC HD	—	1.1	3,910	3,910	MonotaRO	18.7	43.7	128,652	128,652	メディカシステムネットワーク	—	6.6	3,544	3,544
ヤマタヘルスケア HLDGS	8.1	0.5	627	627	東京一番フーズ	—	1.6	1,001	1,001	総合メディカル	5.5	—	—	—
国際紙バルブ商事	—	14.4	4,521	4,521	DD ホールディングス	—	2.7	4,050	4,050	はるやま HLDGS	—	2.9	2,392	2,392
ヤマタネ	5.9	3.1	4,309	4,309	きちりホールディングス	—	1.6	1,214	1,214	ノジマ	10.6	10.9	19,445	19,445
丸紅建材リース	—	0.6	1,032	1,032	アークランドサービス HD	4.8	4.5	8,869	8,869	カップ・グリエイト	—	8.7	12,858	12,858
日鉄物産	4.3	4.4	19,118	19,118	J. フロントリテイリング	67.4	78.7	100,578	100,578	ライトオン	7.8	4.7	3,214	3,214
泉州電業	—	1.9	5,242	5,242	ドトール・日レス HD	9.4	10.8	23,263	23,263	ジーンズメイト	—	1.9	596	596
トラスコ中山	12.5	12.8	32,512	32,512	マツモトキヨシ HLDGS	24	25.4	102,235	102,235	良品計画	7.7	87.2	181,986	181,986
オートバックスセブン	20.7	24.5	44,859	44,859	ブロンコビリー	3.8	3.2	7,516	7,516	三城ホールディングス	—	7.7	2,363	2,363
モリト	—	4.5	3,586	3,586	ZOZO	57.1	66.5	166,250	166,250	アドヴァン	7.4	9.4	11,214	11,214
加藤産業	9	9.6	32,688	32,688	トレジャー・ファクトリー	—	1.8	2,448	2,448	アルビス	2.5	2.3	5,618	5,618
北恵	—	1.2	1,160	1,160	物語コーポレーション	1.9	1.5	15,405	15,405	コナカ	—	7.3	3,190	3,190
イノテック	6.5	3.7	3,270	3,270	ココカラファイン	6.1	6.9	41,262	41,262	ハウス ローゼ	—	0.8	1,304	1,304
イエローハット	5.4	11.6	19,058	19,058	三越伊勢丹 HD	107.5	115.2	99,072	99,072	G-7ホールディングス	—	1.8	5,670	5,670
JK ホールディングス	—	5.6	2,872	2,872	Hamee	—	1.9	1,888	1,888	イオン北海道	—	6	4,512	4,512
日伝	4.5	5.1	10,628	10,628	ウエルシア HD	15.7	16.3	88,998	88,998	ゴジマ	13.1	10.6	5,066	5,066
北沢産業	17.1	4.6	1,209	1,209	グリエイト S DH	8.7	9.1	22,904	22,904	ヒマラヤ	—	2.2	1,793	1,793
杉本商事	—	3.3	6,893	6,893	丸善 CHI HD	—	7.2	2,757	2,757	コーナン商事	8.8	8.1	19,715	19,715
因幡電機産業	7.1	8.7	42,717	42,717	ミサワ	—	1.1	556	556	エコス	—	2.3	3,797	3,797
バイテックホールディングス	3.4	—	—	—	ディーライフ	—	0.8	676	676	ワタミ	8.2	8.1	11,834	11,834
東テック	—	2	4,136	4,136	エー・ピーカンパニー	—	1.1	588	588	マルシェ	—	1.5	1,170	1,170
ミスミグループ本社	67.1	77.1	198,609	198,609	チムニー	—	1.9	4,755	4,755	パンパシフィック HD	37.6	147.4	258,392	258,392
アルテック	—	4.5	922	922	シュッピン	—	4.2	4,468	4,468	西松屋チェーン	12.9	13.6	13,069	13,069
タキヒヨー	—	1.9	3,421	3,421	ネクステージ	—	8.8	9,952	9,952	ゼンショーホールディングス	30.5	29.9	74,779	74,779
蔵王産業	—	1	1,418	1,418	ジョイフル本田	16.5	18	25,550	25,550	幸楽苑ホールディングス	5.9	3.9	9,523	9,523
スズケン	26	28	166,880	166,880	鳥貴族	2.9	2	4,584	4,584	ハークスレイ	—	1.3	1,358	1,358
ジェコス	6	4.2	3,708	3,708	キリン堂ホールディングス	—	2.4	5,042	5,042	サイゼリヤ	9.4	10.2	27,703	27,703
グローセル	—	5.6	2,408	2,408	ホットランド	5.8	3.7	4,266	4,266	V T ホールディングス	21.2	27.8	12,760	12,760
<b>小売業 (4.8%)</b>					すかいらく HD	53	69	132,135	132,135	魚力	—	1.7	2,720	2,720
ローソン	14.3	15.6	89,232	89,232	SFP ホールディングス	—	2.6	5,642	5,642	ポプラ	10.4	1.6	795	795
サンエー	4.4	4.6	22,287	22,287	綿半ホールディングス	3.1	2.3	4,728	4,728	フジ・コーポレーション	—	1.6	3,472	3,472
カワチ薬品	4.8	4.8	10,348	10,348	ヨシックス	—	1	3,125	3,125	ユナイテッドアローズ	7.4	7.1	21,513	21,513
エービーシー・マート	10.4	9.6	65,760	65,760	ユナイテッド・スーパーマーケット	20.2	17.8	17,675	17,675	ハイデイ日高	8	8.9	19,232	19,232
ハードオフコーポレーション	8.3	2.4	1,725	1,725	ゴルフダイジェスト・オン	—	2.5	1,730	1,730	京都きもの友禅	—	4	1,368	1,368
アスクル	5.1	6.4	17,990	17,990	B E E N O S	—	2.2	2,721	2,721	コロワイド	19.8	20.5	44,259	44,259
ゲオホールディングス	10.9	9.4	12,502	12,502	あさひ	6.4	5.1	6,349	6,349	ピーシーデポコーポ	11.2	8.2	4,034	4,034
アダストリア	9.3	8.5	20,298	20,298	日本調剤	2.3	2.2	8,547	8,547	壺番屋	4.3	4.3	21,629	21,629
ジーフット	—	3.8	2,386	2,386	コスモス薬品	3	2.7	58,320	58,320	トップカルチャー	—	2.2	781	781
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	—	0.8	544	544	トーエール	—	3	2,130	2,130	P L A N T	—	1.6	1,177	1,177
くら寿司	3.6	3.2	14,512	14,512	オンリー	—	1	813	813	スギホールディングス	12.5	13.5	78,300	78,300
キャンドウ	—	2.9	4,843	4,843	セブン&アイ・HLDGS	241.3	257.8	1,077,088	1,077,088	葉王堂ホールディングス	—	2.7	7,155	7,155

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ヴィア・ホールディングス	13.4	7.6	5,221	千円	ブレナス	6.3	6.9	12,523	千円	南都銀行	6	9.6	23,913	千円
スクロール	16.6	9.5	3,230		ミニストップ	4.3	4.6	6,536		百五銀行	50.7	55.6	19,626	
コンディールホールディングス	6	6.8	17,938		アークス	10.6	11.5	26,220		京都銀行	21.6	22.1	95,914	
ファミリーマート	18.7	68.8	185,828		パローホールディングス	13.2	13.3	24,937		紀陽銀行	20.6	21.8	35,010	
木曽路	7.4	7.6	21,120		藤久	—	0.5	371		ほくほくフィナンシャルG	34.9	41.1	43,155	
SRSホールディングス	—	7.3	7,774		ペルル	2.8	3	15,900		広島銀行	77.8	91	49,686	
千趣会	14.4	11.2	3,472		大庄	—	3.3	5,316		山陰合同銀行	32.9	36.6	24,339	
タカキュー	35.6	4.8	840		ファーストリテイリング	7.7	8.2	534,804		中国銀行	35.2	53.1	53,365	
ケーヨー	12.9	11.4	5,825		サンドラッグ	21.4	23.2	79,576		鳥取銀行	—	2.1	3,049	
上新電機	7	7.3	15,841		サックスパーホールディング	7.1	5.2	4,752		伊予銀行	75.8	81.6	46,430	
日本瓦斯	11.1	9.7	28,818		ヤマザワ	—	1.3	2,135		百十四銀行	57	6.6	14,546	
ロイヤルホールディングス	10.4	10.8	29,052		やまや	—	1	2,325		四国銀行	9.3	8.8	8,905	
東天紅	—	0.5	614		ペルーナ	14.5	15.1	10,887		阿波銀行	43	9.4	22,221	
いなげや	6.7	6.9	11,240		<b>銀行業 (5.9%)</b>					大分銀行	3.3	3.8	11,476	
島忠	13	13	34,437		島根銀行	—	1.4	953		宮崎銀行	4.1	4.1	10,233	
チヨダ	6.9	6.5	11,141		じもとホールディングス	67.9	42.1	4,252		佐賀銀行	4.2	3.8	5,905	
ライフコーポレーション	4	4.7	10,556		めぶきフィナンシャルG	294	319.6	85,652		十八銀行	42	—	—	
リンガーハット	7.9	7.6	19,106		東京きらぼしFG	7.8	8.4	12,020		沖繩銀行	5.4	5.6	19,152	
MrMaxHD	10.7	8.4	3,838		九州フィナンシャルG	90.1	101.2	45,135		琉球銀行	13.4	14.2	16,287	
テニアライド	—	5.6	2,536		ゆうちょ銀行	161.8	174.3	187,023		セブン銀行	214	205.9	61,358	
AOKIホールディングス	11.1	12.3	13,616		富山第一銀行	21.3	14.8	4,736		みずほフィナンシャルG	7,834.1	8,369.9	1,410,328	
オークワ	10	8.8	10,859		コンコルディア・フィナンシャル	344.9	386.4	162,288		高知銀行	11.9	2.3	1,842	
コメリ	8.2	9.5	21,413		西日本フィナンシャルHD	35.1	38.9	28,513		山口フィナンシャルG	68.7	76.8	58,752	
青山商事	10.2	10.8	21,546		関西みらいFG	26.5	28.8	21,225		長野銀行	—	2	3,348	
しまむら	6.8	7.2	61,632		33FG	5	5.3	9,460		名古屋銀行	4.3	5	15,800	
はせがわ	—	3.1	1,261		第四北越フィナンシャルG	—	10.7	28,847		北洋銀行	82.7	93.2	21,529	
高島屋	43.9	48.3	61,872		新生銀行	46.3	45.3	70,985		愛知銀行	2	2.2	8,074	
松屋	12.8	12.4	10,403		あおぞら銀行	34.1	34.5	94,392		中京銀行	3.2	2.5	5,650	
Eイチ・ツアー・オリテイリング	25.9	31.6	39,278		三菱UFJフィナンシャルG	4,012.9	4,240.3	2,396,193		大光銀行	5	2.1	3,578	
近鉄百貨店	—	2.3	7,360		リそなホールディングス	634.4	676	322,452		愛媛銀行	9.2	8.6	9,718	
パルコ	—	5.9	7,658		三井住友トラストHD	113	121.1	486,337		トマト銀行	9.4	2.4	2,613	
丸井グループ	53.7	52.1	121,028		三井住友フィナンシャルG	431.8	434.1	1,643,502		京葉銀行	40	26.1	16,860	
アクシアルリテイリング	5	5.1	21,369		第四銀行	6.5	—	—		栃木銀行	32.2	32.3	6,266	
井筒屋	—	3.3	749		北越銀行	5.9	—	—		北日本銀行	4.3	1.9	3,496	
イオン	223.1	236.7	471,861		千葉銀行	202.6	211.9	119,723		東和銀行	12.1	10.9	9,014	
イズミ	10.5	12.5	54,687		群馬銀行	107.2	123.3	44,264		福島銀行	18	5.4	1,215	
平和堂	11.7	12.5	25,975		武蔵野銀行	8.1	9.2	17,434		大東銀行	10.8	3	1,770	
フジ	7.2	7.4	14,296		千葉興業銀行	23.7	17.1	5,232		トモニホールディングス	46.4	47.5	16,530	
ヤオコー	6.7	7	34,650		筑波銀行	39.2	25.9	4,817		フィデアホール	71.5	60.4	7,127	
ゼビオホールディングス	7	7.4	8,998		七十七銀行	16.8	19.3	32,173		池田泉州HD	57.2	65.9	12,982	
ケーズホールディングス	51.2	64	75,392		青森銀行	4.6	4.8	13,003		<b>証券・商品先物取引業 (0.8%)</b>				
OLYMPICグループ	—	3.6	2,235		秋田銀行	4	4	8,492		FPG	20.9	19.4	22,271	
日産東京販売HD	—	9	2,592		山形銀行	6.5	6.9	10,419		マキアインベストメント	—	2.6	1,934	
GENKY DRUGSTORES	2.5	3	6,843		岩手銀行	4	4.3	10,965		SBIホールディングス	66.1	73.4	183,426	
総合メディカルHD	—	5.4	9,666		東邦銀行	49.8	55.3	14,488		日本アジア投資	—	5.2	1,575	
ブックオフGHD	—	3.2	3,980		東北銀行	10.4	3.2	3,392		ジャフコ	8.3	10.1	41,511	
アインホールディングス	7.8	8.3	51,543		みちのく銀行	—	4	6,608		大和証券G本社	489	494.3	251,351	
元氣寿司	2.4	1.7	4,936		ふくおかフィナンシャルG	236	54.3	115,278		野村ホールディングス	983.7	1,084	514,574	
ヤマダ電機	193.6	187.6	97,927		静岡銀行	140.3	152.5	127,337		岡三証券グループ	46	52.6	20,251	
アークランドサカモト	10	10.4	13,457		十六銀行	6.8	8.3	19,413		丸三証券	20.5	18.4	9,715	
ニトリホールディングス	23	26.6	423,871		スルガ銀行	59.6	60.5	26,741		東洋証券	38	22.4	4,099	
グルメ軒屋	—	4.4	5,288		八十二銀行	94.3	148.8	65,472		東海東京HD	62.5	71	22,720	
愛眼	—	5	1,260		山梨中央銀行	37	7.5	8,085		光世証券	—	1.5	912	
ケーヨーホールディングス	—	3.1	2,693		大垣共立銀行	8.1	13	31,369		水戸証券	25.6	18	3,834	
吉野家ホールディングス	20.2	21.5	48,353		福井銀行	5.4	5.3	7,944		いちよし証券	13.7	12.3	8,646	
松屋フーズHLDGS	3	3	11,745		北國銀行	6.4	6.4	16,480		松井証券	29.2	30.2	28,478	
サガミホールディングス	10.6	8.3	11,570		清水銀行	4.1	2.6	4,950		だいちこう証券ビジ	—	2.5	1,377	
関西スーパーマーケット	5.8	4.6	5,216		富山銀行	—	1.2	2,914		マネックスG	63.4	56.9	18,777	
王将フードサービス	4.5	4.5	32,265		滋賀銀行	46	12.4	30,913		カブドットコム証券	39.4	—	—	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
極東証券	8.2	8.3	7,586		フージャースHD	17.4	13.4	8,549		中広	—	0.5	302	
岩井コスモホールディング	8	6.2	7,142		オープンハウス	10	8.9	47,615		アイティメディア	—	1.1	752	
藍澤證券	14	11	8,239		東急不動産HD	138	165.8	113,075		タケエイ	9.1	6.2	6,119	
マネーパートナーズGP	—	7.3	1,978		飯田GHD	47.3	51.3	93,622		E・Jホールディングス	—	0.7	884	
スパークス・グループ	—	24.4	6,124		イーランド	—	0.9	634		トラスト・テック	3.2	6.6	8,441	
小林洋行	—	1.9	467		ビーロット	—	1.4	2,448		コソダカホールディングス	16.2	14.4	23,097	
<b>保険業 (2.3%)</b>					ファーストブラザーズ	—	1.4	1,540		アルトナー	—	1.4	1,047	
かんぼ生命保険	21.5	21.9	36,463		ハウスドゥ	—	3.4	5,239		パソナグループ	6.2	7.3	11,446	
SOMPOホールディングス	113	108.6	503,795		シアールイー	—	1.5	1,522		CDS	7	1.5	1,984	
アニコムホールディングス	4.4	5.1	20,680		プロパティエージェン	—	0.8	943		リングアンドモチベシ	12.2	13.2	8,025	
MS&AD	149.6	161	579,600		ケイアスター不動産	—	1.7	3,507		GCA	9.6	7.1	5,339	
SONY F H	47.7	50.6	120,832		アグレ都市デザイン	—	1	443		エス・エム・エス	22.9	22	60,060	
第一生命HLDGS	325.6	348.6	567,520		ジェイ・エス・ビー	—	0.7	3,167		サニーサイドアップ	—	1.3	1,211	
東京海上HD	216.9	220.3	1,299,549		テンポイノベーション	—	0.7	1,162		パソルホールディングス	52.5	59.7	136,235	
T&Dホールディングス	176.7	190.6	219,666		グローバルリンクマネジ	—	0.9	531		リニカル	4.8	3.4	3,423	
アドバンスクリエイト	4.6	1.4	2,755		パーク24	34	33.1	78,711		クックパッド	21.9	19.1	6,073	
<b>その他金融業 (1.2%)</b>					パラカ	2.9	1.6	3,592		エスクリ	—	1.6	1,318	
全国保証	16.4	17.4	73,515		三井不動産	288.2	326.8	895,595		アイ・ケイ・ケイ	—	2.9	2,038	
ジェイリース	—	1.7	538		三菱地所	429.3	431.6	900,317		学情	—	2.1	2,946	
イントラスト	—	1.7	1,098		平和不動産	10.6	11.3	27,911		スタジオアリス	3.9	3	6,030	
日本モーゲージサービス	—	1.1	1,241		東京建物	61.3	67.4	100,763		シミツホールディングス	4.3	3.3	5,989	
C a s a	—	2.8	3,446		ダイビル	14.7	18.2	20,711		N J S	—	1.3	2,237	
アルヒ	7.3	5.6	12,146		京阪神ビルディング	12.3	10.8	13,888		総合警備保障	22.6	23.7	132,720	
プレミアグループ	—	3.5	6,664		住友不動産	139	138.5	573,390		アイロムグループ	43.3	44.7	119,393	
クレディセゾン	42.6	43.2	59,702		テオ	9	—	—		—	2.3	3,742		
芙蓉総合リース	6.6	7	47,250		テオオーシー	20.6	14.1	12,055		セントケア・ホールディ	—	4.4	2,406	
興銀リース	10.8	11.6	33,698		東京楽天地	—	0.9	5,193		サイネックス	—	0.9	576	
東京センチュリー	12.1	12.4	64,232		レオパレス21	69.3	—	—		ルネサンス	—	3.3	5,454	
日本証券金融	24.5	27.2	14,171		スターツコーポレーシ	7.8	8.3	21,646		ディップ	8.5	9.6	24,585	
アイフル	101.7	94.3	22,820		フジ住宅	11.7	7.9	5,545		オプトホールディング	4.4	3.3	5,194	
リコーリース	4.2	4.8	17,544		空港施設	12.2	7.2	3,909		新日本科学	—	8.1	5,759	
イオンフィナンシャルサー	39.8	39.4	66,704		明和地所	—	3.4	1,856		ツクイ	15.6	14.1	6,429	
アコム	118.6	124.1	51,625		ゴールドクレスト	4.7	4.8	10,828		キャリアデザインセン	—	1.5	2,091	
ジャックス	6.9	6.8	15,680		日本エスリード	4.1	2.3	3,824		ベネフィット・ワン	—	16.4	31,422	
オリコ	114.4	167.3	23,422		日神不動産	11.8	8.9	3,987		エムスリー	59.8	125.7	317,643	
日立キャピタル	15.7	14.5	33,640		日本エスコン	13.3	11.1	8,780		ツカガ・グローバルH	—	3.8	2,261	
アプラスフィナンシャル	56.3	29.8	2,115		タカラレーベン	29.8	28.2	11,731		プラス	—	0.6	396	
オリックス	384.8	410.8	711,916		サンヨーハウジ 名古屋	10.1	3.5	3,094		アウトソーシング	25.3	34.2	35,123	
三菱UFJ F リース	144.9	138.9	90,423		イオンモール	36.3	30.9	54,507		ウエルネット	9.7	5.7	4,075	
九州リースサービス	—	3	1,815		毎日コムネット	—	1.3	984		ワールドホールディン	2	1.9	3,108	
日本取引所グループ	165.5	166.4	302,016		ファースト住建	—	2.6	3,463		ディー・エヌ・エー	30.5	32.2	63,208	
イー・ギャランティ	9.8	5.8	7,685		ランド	—	255.5	2,044		博報堂D Y HLDGS	78	82.9	135,873	
アサックス	—	2.6	1,583		カチタス	8.3	6.9	30,946		ぐるなび	11	8.5	6,162	
NECキャピタルソリューション	4	2.5	5,495		トーセイ	10.2	8.5	11,041		タカミヤ	—	6.3	4,126	
<b>不動産業 (2.5%)</b>					穴吹興産	—	0.7	1,974		ジャパンベストレスキ	—	4	4,500	
いちご	85.1	78.5	33,676		エヌ・ティ・ティ都市開	35.6	—	—		ファンコミュニケーション	19	16.5	8,860	
日本駐車場開発	84.6	67.8	11,729		サンフロンティア不動	8.7	8.5	10,642		ライク	—	2.4	3,859	
ヒューリック	119.7	131.6	145,812		エフ・ジェー・ネク	7	—	—		ビジネス・ブレイクス	—	2.5	917	
三栄建築設計	3.6	2.4	3,554		インテリックス	—	1.8	1,310		エスプール	—	2.3	6,637	
野村不動産HLDGS	38	41	99,015		ランドビジネス	—	2.6	2,002		WDBホールディング	3.1	2.7	7,284	
三重交通グループHD	15.7	12.5	7,175		日本社宅サービス	—	1.6	1,760		ティア	7.8	3.5	2,205	
サムティ	6.5	8.7	16,356		グランディハウス	19	5.4	2,435		C DG	—	0.5	739	
エー・ディー・ワーク	—	191.5	6,702		日本空港ビルデング	17	19.7	91,211		パリュールコマース	4.6	3.4	5,739	
日本商業開発	5.1	3.9	5,970		<b>サービス業 (5.1%)</b>					インフォーマット	32.2	32.7	54,674	
プレサンスコーポレーシ	9.2	9.8	16,816		日本工営	4.2	4	12,480		JPホールディング	25.8	17.1	4,873	
ユニソホールディング	8	9.4	39,668		L I F U L L	21.8	20.9	14,295		エコックホールディン	—	10.8	1,360	
日本管理センター	6.7	4.1	5,801		ジェイエイサーリクル	5.3	4	8,260		EPSホールディン	9.2	9	11,646	
サンセイインディック	—	1.8	1,506		日本M&Aセンター	39.8	45.1	140,261		レックス	—	1.5	2,451	
エストラスト	—	0.9	752		メンバーズ	—	2	3,426		プレステージ・インター	13.3	11.2	19,342	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
アミューズ	4.2	3.6	9,997	9,997	N・フィールド	4.8	4	2,352	2,352	よみうりランド	1.9	1.3	6,123	6,123
ドリームインキュベータ	3.1	1.8	2,458	2,458	パリュールH R	—	1.2	3,858	3,858	東京都競馬	4	3.9	13,123	13,123
クイック	5	3.7	5,076	5,076	M&Aキャピタルパートナー	1.7	2.1	13,398	13,398	常磐興産	6.4	2.4	4,180	4,180
TAC	17.1	3.1	610	610	ライオンエクスプレスHD	—	2.5	3,605	3,605	カナモト	8	9.8	26,411	26,411
ケネディクス	55.9	56.8	31,580	31,580	ERIホールディングス	—	1.7	1,371	1,371	東京ドーム	22.9	22.4	23,049	23,049
電通	68.3	61.5	245,077	245,077	アビスト	—	0.9	2,489	2,489	西尾レントオール	5.8	6.1	17,683	17,683
テイクアンドグヴィーズ	—	2.3	2,750	2,750	スピスマクス	—	2.9	4,062	4,062	アゴラ・ホスピタリティ&G	—	34.8	1,183	1,183
びあ	2	1.7	7,658	7,658	ウィルグループ	—	3.9	3,369	3,369	トランス・コスモス	6.7	6.6	17,311	17,311
イオンファンタジー	2.2	1.9	5,396	5,396	エスクローA J	12.7	8.3	1,992	1,992	乃村工藝社	13.6	27.9	38,306	38,306
シーティーエス	—	6.7	4,736	4,736	日本ビューホテル	8.2	—	—	—	藤田観光	3	2.6	7,563	7,563
ネクシィーズグループ	3.6	2.1	4,143	4,143	リクルートホールディングス	432.5	427.5	1,462,905	1,462,905	KNT-CTホールディングス	4.5	3.2	4,716	4,716
みらかホールディングス	16.5	16.7	42,518	42,518	エラン	—	3.5	6,209	6,209	日本管財	6.5	6.4	12,281	12,281
アルプス技研	6	5.3	8,225	8,225	土木管理総合試験	—	2.6	1,138	1,138	トーカイ	5.8	5.8	13,931	13,931
サンックス	—	10.6	3,731	3,731	ネットマーケティング	—	2.1	1,554	1,554	白洋舎	—	0.7	1,974	1,974
ダイオース	—	1.4	2,076	2,076	日本郵政	315.7	489.1	507,685	507,685	セコム	59.7	63.3	617,871	617,871
日本空調サービス	—	6.8	4,739	4,739	ベルシステム24HLDGS	10.6	10	15,780	15,780	セントラル警備保障	3.2	2.9	15,950	15,950
オリエンタルランド	66.3	70.5	1,115,662	1,115,662	鎌倉新書	—	4.4	6,283	6,283	丹青社	12.8	11.3	14,531	14,531
ダスキン	14.9	15.3	43,406	43,406	ソネット・メディア・ネットワーク	—	0.7	457	457	メイテック	6.7	7.4	39,368	39,368
明光ネットワークジャパン	9.7	7.1	6,432	6,432	一蔵	—	0.7	420	420	応用地質	7.3	6.4	7,385	7,385
ファルコホールディングス	8.2	3.3	5,666	5,666	LITALICO	—	1.4	2,693	2,693	船井総研ホールディング	12.2	12.3	29,987	29,987
秀英予備校	—	1.4	623	623	グローバルキッズCOMP	—	0.9	784	784	進学会ホールディングス	—	2.7	1,371	1,371
田谷	—	1.2	738	738	エポラブルアジア	—	2.7	5,413	5,413	オオバ	16.3	4.7	2,923	2,923
ラウンドワン	18.4	18.5	30,081	30,081	アトラエ	—	1.5	4,338	4,338	いであ	—	1.1	1,327	1,327
リゾートトラスト	23.4	25.3	44,477	44,477	ストライク	—	2.3	6,396	6,396	学究社	7	2	2,502	2,502
ビー・エム・エル	7.9	7.7	23,600	23,600	ソラスト	12.1	14.6	17,695	17,695	ベネッセホールディングス	19.8	21.9	61,845	61,845
ワタベウエディング	—	1	593	593	セラク	—	1.9	1,482	1,482	イオンディライト	7.8	7.4	26,381	26,381
りらいあコミュニケーション	9.9	10.8	14,493	14,493	インソース	—	2.9	7,081	7,081	ナック	—	3.8	3,720	3,720
リソー教育	11.7	30.3	13,998	13,998	ベイレントコンサルティング	—	4.2	19,026	19,026	ニチイ学館	11.9	8.5	14,985	14,985
早稲田アカデミー	—	1.7	1,385	1,385	ORCHESTRA HLDGS	—	1.2	1,236	1,236	ダイセキ	9.6	10	27,680	27,680
ユー・エス・エス	67.8	72.9	153,381	153,381	アイモバイル	—	1.9	1,138	1,138	ステップ	—	2.2	3,132	3,132
東京個別指導学院	—	2.1	1,967	1,967	キャリアインデックス	—	2.1	932	932					
サイバーエージェント	35	34.3	144,231	144,231	MS-Japan	—	2.4	3,482	3,482					
楽天	262.4	278.3	282,752	282,752	船場	—	0.9	818	818					
クレーク・アンド・リバー社	—	3.5	4,147	4,147	グレイステクノロジー	—	2.2	6,406	6,406					
テール・オー・ダブリュー	13.1	5.2	3,920	3,920	ジャパンエレベーターSHD	—	4.7	13,009	13,009					
山田コンサルティングGP	—	2.9	5,060	5,060	フルテック	—	0.8	1,000	1,000					
セントラルスポーツ	2.5	2.2	7,106	7,106	グリーンズ	—	2.3	3,125	3,125					
フルキャストホールディングス	6.6	6	12,990	12,990	ツナググループHLDGS	—	0.7	418	418					
エン・ジャパン	—	8.7	36,235	36,235	ソウルアウト	—	0.9	1,249	1,249					
リソルホールディングス	—	0.7	2,831	2,831	MS&CONSULTING	—	0.9	821	821					
テクノプロ・ホールディング	10.8	12	77,880	77,880	日総工産	—	4	4,456	4,456					
アトラ	—	1.2	446	446	キュービーネットHLDGS	—	3.6	7,840	7,840					
インターワークス	—	1.1	614	614	RPAホールディングス	—	2.5	4,225	4,225					
アイ・アールジャパンHD	—	2.4	8,784	8,784	スプリックス	—	2	2,892	2,892					
KeepPer 技研	—	2.2	3,174	3,174	アドバンテッジリスクマネ	—	2.3	1,800	1,800					
ファーストロジック	—	1.4	866	866	リログループ	31.1	32.6	83,879	83,879					
三機サービス	—	1.3	1,205	1,205	東祥	4.2	3.7	8,639	8,639					
Gunosy	—	4.2	5,905	5,905	エイチ・アイ・エス	10	9.3	25,751	25,751					
デザインワン・ジャパン	—	1.2	376	376	ラックランド	—	1.2	2,793	2,793					
イー・ガーディアン	3.8	3.1	5,226	5,226	共立メンテナンス	10.3	9.1	40,768	40,768					
リブセンス	—	3.3	848	848	イチネンホールディングス	8.6	6.2	7,018	7,018					
ジャパンマテリアル	17.1	16.3	20,945	20,945	建設技術研究所	7.6	4.1	6,789	6,789					
ベクトル	7.6	7.5	6,967	6,967	スペース	—	3.9	4,894	4,894					
ウチヤマホールディングス	—	3	1,443	1,443	長大	—	2.2	2,228	2,228					
チャムケアコーポレーション	—	1.9	3,781	3,781	燦ホールディングス	—	1.3	2,844	2,844					
ライクキッズネクスト	—	1.4	1,276	1,276	スバル興業	1.2	0.4	2,760	2,760					
キャリアリンク	—	2.2	1,302	1,302	東京テアトル	7	2.4	3,352	3,352					
I B J	—	4	4,416	4,416	タナベ経営	—	1.2	1,534	1,534					
アサンテ	4.7	2.4	4,848	4,848	ナガワ	—	1.7	9,622	9,622					

合計	株数、金額	千株		千円	
		株数	金額	株数	金額
		70,601.2	73,677.7	144,383.908	144,383.908
	銘柄数<比率>	1,498銘柄	2,131銘柄	<99.7%>	<99.7%>

(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) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期		末	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
国 内	百円	百円	百円	百円
TOPIX	287	—	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	株 8,318,400 (240,600)	株 — (—)

(注1) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

(注2) 当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ240,600株を貸付けています。

## ■投資信託財産の構成

2019年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 144,383,908	% 85.3
コール・ローン等、その他	24,819,662	14.7
投資信託財産総額	169,203,571	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9月19日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>169,662,900,164円</b>
コール・ローン等	19,763,867,043
株式 (評価額)	144,383,908,290
未収入金	4,981,771,637
未収配当金	61,109,873
未収利息	1,004,073
その他未収収益	11,859,248
差入委託証拠金	459,380,000
<b>(B) 負債</b>	<b>24,798,875,465</b>
未払解約金	5,440,424,660
差入委託証拠代用有価証券	460,980,000
受入担保金	18,897,468,081
その他未払費用	2,724
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>144,864,024,699</b>
元本	139,218,477,453
次期繰越損益金	5,645,547,246
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>139,218,477,453口</b>
1万口当り基準価額 (C / D)	10,406円

\* 期首における元本額は133,322,724,900円、当作成期間中における追加設定元本額は24,456,356,141円、同解約元本額は18,560,603,588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3,959,780,929円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A7,634,005,000円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A2 8,941,003円、ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 60,746,661円、ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 916,911,182円、ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 49,098,482円、ダイワ国際分散バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 1,278,942,805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) 33,474,382円、D-1's T O P I Xインデックス40,297,426円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド19,815,592円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 3,680,722円、iFree T O P I Xインデックス

1,240,728,743円、iFree 8資産バランス1,946,320,135円、iFree 年金バランス56,248,083円、D Cダイワ日本株式インデックス65,758,738,387円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,935,287,098円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,322,359,411円、ダイワ・ライフ・バランス70 3,053,282,137円、年金ダイワ日本株式インデックス4,860,270,912円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 14,875,081円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 54,571,393円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 21,059,608円、ダイワつみたてインデックス日本株式194,448,237円、ダイワつみたてインデックスバランス30 198,705円、ダイワつみたてインデックスバランス50 300,351円、ダイワつみたてインデックスバランス70 479,367円、ダイワ世界バランスファンド40 V A167,628,084円、ダイワ世界バランスファンド60 V A171,981,504円、ダイワ・バランスファンド35 V A 9,347,930,150円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75 V A3,092,274円、ダイワ・バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 827,002,497円、ダイワ国内バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 127,742,510円、ダイワ国内バランスファンド30 V A (適格機関投資家専用) 222,487,484円、ダイワ・ノーロードT O P I Xファンド160,214,687円、ダイワファンドラップT O P I Xインデックス9,622,016,197円、ダイワT O P I Xインデックス (ダイワSMA専用) 2,723,875,577円、ダイワファンドラップオンラインT O P I Xインデックス2,564,805,669円、ダイワ・インデックスセレクトT O P I X1,429,476,274円、ダイワライフスタイル25 195,425,595円、ダイワライフスタイル50 683,313,759円、ダイワライフスタイル75 559,222,873円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド) 12,947,400,487円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,406円です。

## ■損益の状況

当期 自 2018年9月20日 至 2019年9月19日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>3,377,304,256円</b>
受取配当金	3,168,480,765
受取利息	19,728,015
その他収益金	202,408,919
支払利息	△ 13,313,443
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 13,681,248,964</b>
売買益	5,990,482,970
売買損	△ 19,671,731,934
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>△ 212,010,360</b>
取引益	260,684,580
取引損	△ 472,694,940
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 1,058,828</b>
<b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b>	<b>△ 10,517,013,896</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>16,444,933,577</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 554,817,754</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>272,445,319</b>
<b>(I) 合計 (E + F + G + H)</b>	<b>5,645,547,246</b>
次期繰越損益金 (I)	5,645,547,246

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

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

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

## 運用報告書 (全体版) 第3期

(決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日~2019年12月2日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式組入 比率	株式先物 比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
1期末(2017年11月30日)	円 11,363	円 0	% 13.6	11,186	% 11.9	% 92.8	% 3.6	% 0.0	% 2.5	百万円 1,294
2期末(2018年11月30日)	11,423	0	0.5	11,049	△ 1.2	91.5	6.8	—	2.5	2,198
3期末(2019年12月2日)	13,050	0	14.2	12,386	12.1	93.4	3.8	—	2.8	2,353

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

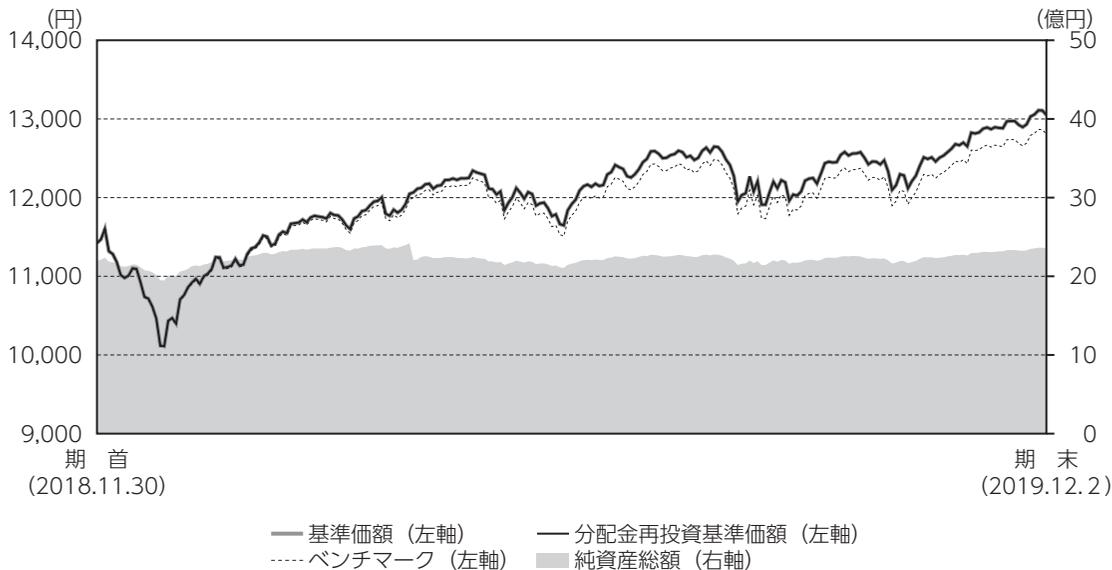
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：11,423円

期末：13,050円 (分配金0円)

騰落率：14.2% (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、世界的な金融緩和期待や米中通商協議の進展期待などを背景に海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 資 信 託 組 入 証 券 率	投 信 託 証 組 入 証 券 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首) 2018年11月30日	円 11,423	% -	11,049	% -	% 91.5	% 6.8	% -	% 2.5
12月末	10,470	△ 8.3	10,120	△ 8.4	91.6	2.6	-	2.5
2019年 1 月末	11,283	△ 1.2	10,898	△ 1.4	90.5	6.9	-	2.5
2 月末	11,752	2.9	11,329	2.5	91.6	7.5	-	2.6
3 月末	11,844	3.7	11,392	3.1	94.4	2.2	-	2.8
4 月末	12,304	7.7	11,809	6.9	96.0	2.1	-	2.7
5 月末	11,787	3.2	11,267	2.0	92.2	3.0	-	2.8
6 月末	12,298	7.7	11,740	6.3	90.9	6.0	-	2.7
7 月末	12,584	10.2	12,011	8.7	86.9	10.8	-	2.6
8 月末	12,215	6.9	11,632	5.3	91.6	3.5	-	2.8
9 月末	12,422	8.7	11,819	7.0	97.6	1.2	-	3.0
10月末	12,699	11.2	12,072	9.3	90.7	8.0	-	2.8
11月末	13,107	14.7	12,442	12.6	93.3	5.0	-	2.8
(期末) 2019年12月 2 日	13,050	14.2	12,386	12.1	93.4	3.8	-	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

(2018.12.1～2019.12.2)

## ■海外株式市況

米国・欧州を中心とする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、米中関係悪化への懸念が高まったことや、米国債券市場において景気後退の予兆とされる長短金利の逆転現象が見られたことなどを受け、下落して始まりました。2019年1月以降は、米中通商協議の進展期待や米国企業を中心とした良好な1-3月決算の発表などを好感し、上昇しました。5月からは、米中関係の緊張が続いたことや世界的な景気減速懸念などを嫌気し、下落しました。6月以降は、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。当作成期末にかけては、再度米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

## ■当ファンド

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

## ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2018.12.1～2019.12.2)

## ■当ファンド

当作成期を通じて、「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おおむね100%程度に維持しました。

## ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

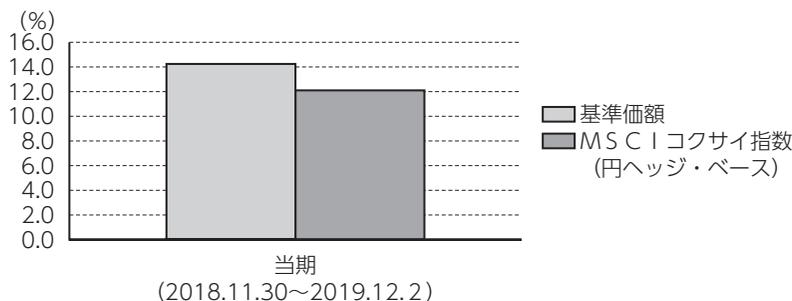
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（投資信託証券、株式先物を含む。）等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

## 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12.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は14.2%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ため、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、運用管理費用・売買委託手数料や保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

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

### 分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期 2018年12月1日 ～2019年12月2日	
	金額	比率
当期分配金（税込み）	—	—
対基準価額比率	—	—
当期の収益	—	—
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	3,049	—

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.12.1~2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	40円	0.332%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,024円です。
(投 信 会 社)	(31)	(0.256)	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)	(7)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.009	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(1)	(0.005)	
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0.012	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.011)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	4	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)	(4)	(0.031)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(△0)	(△0.002)	合併にかかる税金支払いの戻し、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	46	0.386	

(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。

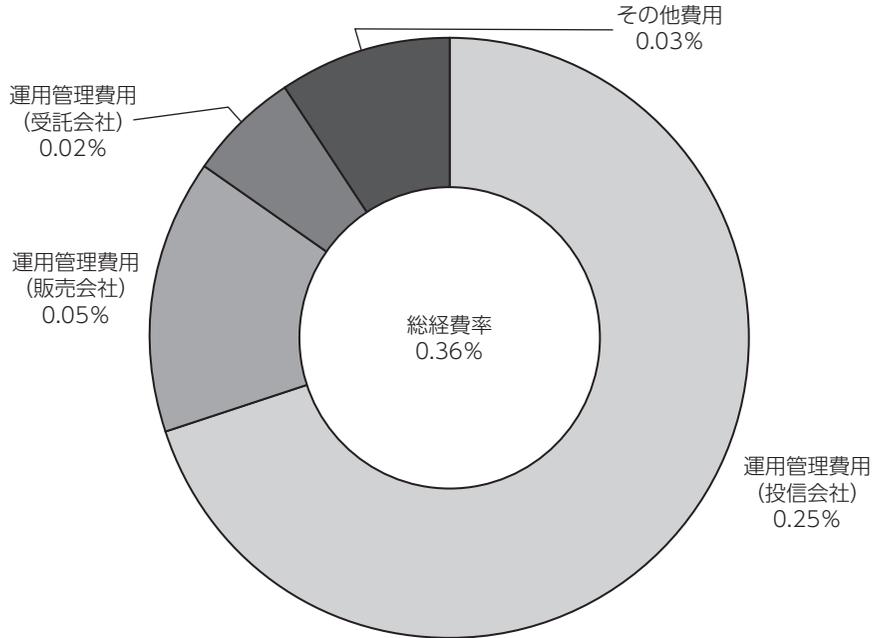
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.36%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2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	163,691	307,710	243,397	469,280

(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12月1日から2019年12月2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	12,675,101千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	39,657,433千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.31

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,206,916	1,127,210	2,352,940

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	2,352,940	99.8
コール・ローン等、その他	5,188	0.2
投資信託財産総額	2,358,128	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1香港ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=80.21円、1ニュージーランド・ドル=70.63円、1イギリス・ポンド=141.59円、1イスラエル・シェケル=31.56円、1スイス・フラン=109.59円、1デンマーク・クローネ=16.17円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローネ=11.46円、1ユーロ=120.86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(49,660,053千円)の投資信託財産総額(51,565,913千円)に対する比率は、96.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,358,128,317円
コール・ローン等	5,188,312
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	2,352,940,005
(B) 負債	4,956,207
未払解約金	1,135,269
未払信託報酬	3,758,670
その他未払費用	62,268
(C) 純資産総額(A-B)	2,353,172,110
元本	1,803,208,621
次期繰越損益金	549,963,489
(D) 受益権総口数	1,803,208,621口
1万口当り基準価額(C/D)	13,050円

\* 期首における元本額は1,924,332,921円、当作成期間中における追加設定元本額は570,028,310円、同解約元本額は691,152,610円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,050円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,751円
受取利息	490
支払利息	△ 3,241
(B) 有価証券売買損益	276,655,208
売買益	318,975,831
売買損	△ 42,320,623
(C) 信託報酬等	△ 7,530,813
(D) 当期損益金(A + B + C)	269,121,644
(E) 前期繰越損益金	27,186,116
(F) 追加信託差損益金	253,655,729
(配当等相当額)	( 75,462,897)
(売買損益相当額)	( 178,192,832)
(G) 合計(D + E + F)	549,963,489
次期繰越損益金(G)	549,963,489
追加信託差損益金	253,655,729
(配当等相当額)	( 75,462,897)
(売買損益相当額)	( 178,192,832)
分配準備積立金	296,310,511
繰越損益金	△ 2,751

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	256,062,759
(c) 収益調整金	253,655,729
(d) 分配準備積立金	40,247,752
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	549,966,240
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	549,966,240
(h) 受益権総口数	1,803,208,621口

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## <補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（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12月2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12月1日から2019年12月2日まで）

買				付				売				付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
MICROSOFT CORP (アメリカ)	16,345	234,939	14,373	CELGENE CORP (アメリカ)	7.75	91,895	11,857	AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.132	216,859	191,572	SHIRE PLC (ジャージー)	8.223	52,258	6,355
APPLE INC (アメリカ)	7,808	177,100	22,681	APPLE INC (アメリカ)	1.673	39,306	23,494	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	6.084	117,691	19,344	FIDELITY NATIONAL INFO SERV (アメリカ)	2.67	38,657	14,478
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.736	93,252	126,701	LINDE PLC (アイルランド)	1.5	33,756	22,504	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.705	92,355	131,000	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	2.498	31,306	12,532
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	6.162	90,086	14,619	MICROSOFT CORP (アメリカ)	1.994	30,181	15,136	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	6.91	85,333	12,349	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.138	26,082	189,000
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	10.518	82,442	7,838	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.183	24,330	132,953	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO (アメリカ)	12.683	75,071	5,919	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	1.574	19,693	12,511

(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12月2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（24,374,861千口）の内容です。

### (1) 外国株式

銘柄	2019年12月2日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	11	136	14,925	情報技術	
PALO ALTO NETWORKS INC	11.98	272	29,855	情報技術	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22.71	243	26,659	情報技術	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	115	12,720	情報技術	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	83	9,116	ヘルスケア	
SYNCHRONY FINANCIAL	62	231	25,439	金融	
ABBOTT LABORATORIES	201.07	1,718	188,445	ヘルスケア	
ARCONIC INC	39.5	122	13,412	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	15.96	235	25,816	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	32.29	202	22,223	一般消費財・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	31.88	331	36,364	情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	70.48	973	106,793	情報技術	
QORVO INC	11.79	122	13,475	情報技術	
AFLAC INC	81.23	445	48,858	金融	
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	147	16,212	一般消費財・サービス	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.35	128	14,050	コミュニケーション・サービス	
ADOBE INC	56.65	1,753	192,322	情報技術	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	132	14,556	素材	
LULULEMON ATHLETICA INC	12.99	293	32,155	一般消費財・サービス	

銘柄	2019年12月2日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円		
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	72	7,979	金融	
GARMIN LTD	13.18	128	14,121	一般消費財・サービス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24.48	578	63,453	素材	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	79.24	1,414	155,178	資本財・サービス	
VR BERKLEY CORP	17.71	120	13,208	金融	
AUTOZONE INC	2.91	342	37,595	一般消費財・サービス	
DOLLAR TREE INC	23.99	219	24,065	一般消費財・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	96.83	100	11,066	ヘルスケア	
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	131	14,454	公益事業	
CELANESE CORP	12.97	162	17,862	素材	
DR HORTON INC	43.97	243	26,693	一般消費財・サービス	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	12.49	38	4,230	エネルギー	
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	138	15,193	ヘルスケア	
AUTODESK INC	25.81	466	51,209	情報技術	
MOODY'S CORP	17.82	403	44,302	金融	
DEVON ENERGY CORP	48.68	106	11,687	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	16.68	109	11,961	素材	
ATMOS ENERGY CORP	16.54	176	19,403	公益事業	
ALLIANT ENERGY CORP	22	116	12,788	公益事業	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CITIGROUP INC	263.51	1,979	217,110	金融	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	47.42	809	88,823	情報技術	
AMERICAN ELECTRIC POWER	56.57	516	56,678	公益事業	
ALLEGHANY CORP	2.03	158	17,367	金融	
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	154	16,978	一般消費財・サービス	
HESS CORP	28.96	179	19,721	エネルギー	
DAVITA INC	10	71	7,871	ヘルスケア	
DANAHER CORP	70.15	1,024	112,317	ヘルスケア	
FORTIVE CORP	30.44	219	24,095	資本財・サービス	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	59.49	560	61,444	金融	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	40.93	77	8,480	一般消費財・サービス	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	29	3,227	一般消費財・サービス	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	60.74	260	28,599	生活必需品	
BUNGE LTD	18.38	98	10,760	生活必需品	
TE CONNECTIVITY LTD	38.44	356	39,087	情報技術	
APPLE INC	507.77	13,570	1,488,374	情報技術	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	285	31,267	金融	
BOEING CO/THE	60.58	2,218	243,305	資本財・サービス	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	220	24,222	金融	
BECTON DICKINSON AND CO	30.11	778	85,368	ヘルスケア	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	31	3,500	一般消費財・サービス	
LEIDOS HOLDINGS INC	14	127	13,948	情報技術	
CDK GLOBAL INC	11	58	6,460	情報技術	
NISOURCE INC	40.26	106	11,679	公益事業	
CH. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	131	14,396	資本財・サービス	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	96.83	474	52,007	金融	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	464.47	2,797	306,881	コミュニケーション・サービス	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	144.92	3,192	350,163	金融	
ANSYS INC	9.89	251	27,627	情報技術	
BB&T CORP	77.63	424	46,591	金融	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	77.86	422	46,302	金融	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	262.66	1,495	164,035	ヘルスケア	
JPMORGAN CHASE & CO	362.64	4,778	524,066	金融	
T ROWE PRICE GROUP INC	27.59	340	37,390	金融	
LKQ CORP	33	116	12,769	一般消費財・サービス	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	5.47	103	11,298	金融	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	248	27,262	生活必需品	
CADENCE DESIGN SYS INC	36.14	253	27,845	情報技術	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16.11	263	28,954	金融	
DOLLAR GENERAL CORP	26.72	420	46,116	一般消費財・サービス	
SERVICENOW INC	20.83	589	64,664	情報技術	
CATERPILLAR INC	65.65	950	104,212	資本財・サービス	
BROWN & BROWN INC	24.93	94	10,319	金融	
AQUA AMERICA INC	22.01	97	10,687	公益事業	
CMS ENERGY CORP	33.84	207	22,751	公益事業	
MOSAIC CO/THE	52.09	99	10,883	素材	
DELTA AIR LINES INC	16.5	94	10,371	資本財・サービス	
CORNING INC	83.99	243	26,751	情報技術	
CISCO SYSTEMS INC	483.58	2,191	240,319	情報技術	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12.65	80	8,874	ヘルスケア	
MORGAN STANLEY	139.89	692	75,917	金融	
WABCO HOLDINGS INC	9.4	126	13,892	資本財・サービス	
MSCI INC	9.75	252	27,717	金融	

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	115	12,627	資本財・サービス	
MIDDLEBY CORP	9.18	106	11,655	資本財・サービス	
COTY INC-CL A	47.57	54	6,020	生活必需品	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25.07	150	16,511	情報技術	
BROADCOM INC	45.31	1,432	157,143	情報技術	
ACUITY BRANDS INC	3.5	45	5,020	資本財・サービス	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	165	18,192	ヘルスケア	
ARAMARK	31.73	138	15,187	一般消費財・サービス	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16.12	45	5,033	素材	
DTE ENERGY COMPANY	19.33	241	26,488	公益事業	
CENTENE CORP	51.13	309	33,911	ヘルスケア	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	161	17,709	金融	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	212	23,335	金融	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22.32	208	22,833	金融	
GARTNER INC	11.74	188	20,661	情報技術	
SPLUNK INC	17.21	255	27,986	情報技術	
DOMINION ENERGY INC	89.41	743	81,501	公益事業	
MONSTER BEVERAGE CORP	44.36	265	29,104	生活必需品	
SMITH (A.O.) CORP	14	67	7,431	資本財・サービス	
DEERE & CO	33.62	564	61,967	資本財・サービス	
GLOBAL PAYMENTS INC	33.87	613	67,276	情報技術	
VIMWARE INC-CLASS A	8.33	129	14,217	情報技術	
BURLINGTON STORES INC	7	157	17,274	一般消費財・サービス	
NASDAQ INC	14.27	149	16,402	金融	
VAIL RESORTS INC	3.9	94	10,380	一般消費財・サービス	
EAST WEST BANCORP INC	14.61	66	7,342	金融	
TARGA RESOURCES CORP	16.33	59	6,542	エネルギー	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8.94	147	16,224	金融	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	95	10,516	金融	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4.05	27	3,050	素材	
CONSOLIDATED EDISON INC	36.48	316	34,765	公益事業	
COGNEX CORP	24.39	122	13,423	情報技術	
TELEFLEX INC	4.85	171	18,795	ヘルスケア	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8.06	93	10,221	資本財・サービス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	125	13,739	ヘルスケア	
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	110	12,154	ヘルスケア	
WELLCAR HEALTH PLANS INC	5	161	17,662	ヘルスケア	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	15.7	234	25,688	ヘルスケア	
IDEX CORP	7	113	12,494	資本財・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO	91.32	619	67,928	生活必需品	
ROLLINS INC	10.5	37	4,128	資本財・サービス	
AMETEK INC	25.97	257	28,201	資本財・サービス	
CHURCH & DWIGHT CO INC	28.83	202	22,210	生活必需品	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	36	4,057	資本財・サービス	
HEICO CORP	5.35	69	7,621	資本財・サービス	
XPO LOGISTICS INC	10.6	87	9,613	資本財・サービス	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3.98	103	11,334	金融	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	316	34,732	素材	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4.17	121	13,271	情報技術	
COSTCO WHOLESALE CORP	48.83	1,463	160,568	生活必需品	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	137	15,072	情報技術	
GRUBHUB INC	10	43	4,729	一般消費財・サービス	
EPAM SYSTEMS INC	5.49	116	12,756	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12月2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	
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	129	14,151	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.1	252	27,673	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	28	58	6,418	金融
UGI CORP	20.85	90	9,959	公益事業
CUMMINS INC	16.04	293	32,169	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	87.14	477	52,403	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	43.26	97	10,642	情報技術
CDW CORP/DE	17.92	242	26,543	情報技術
SIGNATURE BANK	7.69	94	10,404	金融
COSTAR GROUP INC	4.92	301	33,071	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	159	17,537	金融
AMERCO	0.7	25	2,780	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8.26	158	17,357	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	4.8	278	30,565	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	29	43	4,793	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	127	13,948	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	28.81	302	33,178	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.5	35	3,896	情報技術
DEXCOM INC	11.72	266	29,219	ヘルスケア
COPART INC	24.95	222	24,354	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	15.91	123	13,495	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	15.45	185	20,393	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.63	267	29,293	ヘルスケア
TRANSNIGM GROUP INC	5	283	31,099	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	140	15,386	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	43.47	84	9,321	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	225.94	443	48,595	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	31.38	435	47,723	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3.82	154	16,919	金融
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	73	8,056	エネルギー
T-MOBILE US INC	42.03	330	36,210	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	69	7,669	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	454.42	2,426	266,149	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	25.75	129	14,251	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	145	15,956	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	12.5	58	6,467	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	105	11,611	金融
CSX CORP	81.51	583	63,956	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.5	180	19,841	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	158	17,427	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	65	7,170	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	47.47	8,548	937,588	一般消費財・サービス
FLOWERVEVE CORP	19.86	96	10,608	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	22.03	539	59,183	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	479.45	3,266	358,268	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	16.13	86	9,475	情報技術
AES CORP	83.41	157	17,299	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	154	16,988	金融
EOG RESOURCES INC	64.76	459	50,359	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	166	18,288	情報技術
ABIOMED INC	5.55	108	11,941	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	174	19,177	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34.58	279	30,633	ヘルスケア

銘柄	2019年12月2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	
FORD MOTOR CO	433.81	393	43,107	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	11	36	3,974	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	17.21	139	15,291	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	54	5,975	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	45.54	138	15,244	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	112	12,365	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	167	18,387	情報技術
MARKEL CORP	1.58	179	19,678	金融
NEXTERA ENERGY INC	51.64	1,207	132,432	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	150.25	170	18,753	素材
INSULET CORP	7.69	142	15,662	ヘルスケア
US BANCORP	165.2	991	108,769	金融
UNITED RENTALS INC	10.55	161	17,709	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	5.5	80	8,789	情報技術
FASTENAL CO	58.14	206	22,650	資本財・サービス
FISERV INC	64.56	750	82,308	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	988.88	1,114	122,234	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	21.49	115	12,643	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	136.43	491	53,869	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	7	19	2,180	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	26.11	474	52,045	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36.27	802	88,055	金融
ALPHABET INC-CL A	32.74	4,269	468,288	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	35.95	4,691	514,545	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	118	12,967	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	65.95	351	38,568	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	56.61	269	29,610	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	184	20,261	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	42.11	305	33,554	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	244	26,821	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24.09	484	53,131	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	27	2,994	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	214	23,551	エネルギー
HOME DEPOT INC	124.15	2,737	300,263	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	111	12,241	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	95.84	142	15,651	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3.5	88	9,661	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	255	28,031	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	14	50	5,586	一般消費財・サービス
HUMANA INC	14.85	506	55,577	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	33.54	387	42,518	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	158	17,346	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	128	14,131	ヘルスケア
HP INC	161.33	323	35,530	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	132.5	209	23,005	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	53	5,852	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	17.83	91	10,081	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	124	13,659	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	98	10,832	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	210	23,066	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	77.25	235	25,841	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	96.54	1,297	142,362	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	187	20,569	素材

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	94	10,407	資本財・サービス	
ZOETIS INC	51.45	620	68,009	ヘルスケア	
INGERSOLL-RAND PLC	25.48	334	36,640	資本財・サービス	
CHENIERE ENERGY INC	24.84	150	16,493	エネルギー	
ALLEGRIE PLC	11.1	133	14,613	資本財・サービス	
LEGGETT & PLATT INC	15.72	82	9,020	一般消費財・サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	109	12,045	コミュニケーション・サービス	
WASTE CONNECTIONS INC	26.65	241	26,467	資本財・サービス	
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	123	13,501	情報技術	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8.64	97	10,659	ヘルスケア	
JM SMUCKER CO/THE	13.93	146	16,056	生活必需品	
JOHNSON & JOHNSON	296.77	4,080	447,526	ヘルスケア	
ABBVIE INC	166.54	1,461	160,248	ヘルスケア	
HOLOGIC INC	30.42	156	17,122	ヘルスケア	
KIMBERLY-CLARK CORP	39.32	536	58,798	生活必需品	
KROGER CO	94.8	259	28,427	生活必需品	
KLA CORP	19.19	314	34,488	情報技術	
LOCKHEED MARTIN CORP	29.5	1,153	126,520	資本財・サービス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.36	287	31,508	情報技術	
LOWE'S COS INC	85.96	1,008	110,600	一般消費財・サービス	
ELI LILLY & CO	98.52	1,156	126,804	ヘルスケア	
LAM RESEARCH CORP	17.24	460	50,454	情報技術	
JONES LANG LASALLE INC	5.87	97	10,708	不動産	
LOEWS CORP	35.91	182	20,047	金融	
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	156	17,117	金融	
MCDONALD'S CORP	86.07	1,673	183,592	一般消費財・サービス	
3M CO	63.95	1,085	119,077	資本財・サービス	
FACEBOOK INC-CLASS A	270.31	5,450	597,814	コミュニケーション・サービス	
MANPOWERGROUP INC	6.5	60	6,604	資本財・サービス	
S&P GLOBAL INC	26.18	692	75,992	金融	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	205	22,579	素材	
CONCHO RESOURCES INC	25.52	185	20,309	エネルギー	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	19	65	7,135	コミュニケーション・サービス	
PHILLIPS 66	50.6	580	63,667	エネルギー	
TECHNIPFMC PLC	45.61	85	9,424	エネルギー	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	180	19,830	一般消費財・サービス	
DXC TECHNOLOGY CO	24.29	90	9,945	情報技術	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13.75	232	25,524	生活必需品	
MYLAN NV	48.88	91	10,068	ヘルスケア	
METLIFE INC	86.35	430	47,269	金融	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86.17	227	24,922	情報技術	
ARISTA NETWORKS INC	5.93	115	12,691	情報技術	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	24.19	108	11,944	金融	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17.71	296	32,496	情報技術	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	204	22,408	ヘルスケア	
BAKER HUGHES CO	84.46	189	20,768	エネルギー	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	285	31,360	資本財・サービス	
MERCK & CO. INC.	285.53	2,489	273,020	ヘルスケア	
DUPONT DE NEMOURS INC	83.2	539	59,141	素材	
MASCO CORP	35.43	164	18,089	資本財・サービス	
M & T BANK CORP	13.23	217	23,904	金融	
MARSH & MCLENNAN COS	55.85	603	66,199	金融	
BLACK KNIGHT INC	16.44	103	11,361	情報技術	

銘柄	2019年12月2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		
HEICO CORP-CLASS A	7.07	71	7,788	資本財・サービス	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	31.8	446	48,955	一般消費財・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	18.78	336	36,894	情報技術	
WAYFAIR INC- CLASS A	6	50	5,588	一般消費財・サービス	
SQUARE INC - A	36.26	250	27,489	情報技術	
TRANSUNION	20.29	175	19,207	資本財・サービス	
VISTRA ENERGY CORP	42.85	113	12,468	公益事業	
CAPRI HOLDINGS LTD	11	40	4,480	一般消費財・サービス	
BEIGENE LTD-ADR	3.51	71	7,803	ヘルスケア	
NETAPP INC	23	139	15,284	情報技術	
NIKE INC -CL B	142.18	1,329	145,791	一般消費財・サービス	
NORFOLK SOUTHERN CORP	28.43	550	60,337	資本財・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26.26	248	27,229	情報技術	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17.49	157	17,230	金融	
ALLY FINANCIAL INC	50.94	162	17,789	金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17.72	623	68,367	資本財・サービス	
APTIV PLC	26.8	251	27,595	一般消費財・サービス	
NEWMONT GOLD CORP CORP	91.73	352	38,634	素材	
MCKESSON CORP	21.61	312	34,282	ヘルスケア	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32.57	184	20,244	情報技術	
XYLEM INC	19.72	152	16,764	資本財・サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	171.14	1,419	155,664	生活必需品	
NUCOR CORP	36.92	208	22,822	素材	
WESTERN UNION CO	36	96	10,613	情報技術	
GODADDY INC - CLASS A	19.3	128	14,051	情報技術	
NEWELL BRANDS INC	40.58	77	8,554	一般消費財・サービス	
EVERGY INC	32.43	205	22,504	公益事業	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	394	43,310	エネルギー	
ERIC INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	45	4,995	金融	
OKTA INC	10.1	131	14,376	情報技術	
LIBERTY BROADBAND-C	13.5	161	17,692	コミュニケーション・サービス	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	135	14,822	ヘルスケア	
LINDE PLC	57.96	1,195	131,088	素材	
WIX.COM LTD	5	60	6,629	情報技術	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	152	16,780	金融	
KKR & CO INC -A	49.96	147	16,159	金融	
PAYCHEX INC	33	284	31,170	情報技術	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8.27	365	40,117	一般消費財・サービス	
ALTRIA GROUP INC	207.29	1,030	112,995	生活必需品	
PFIZER INC	623.73	2,402	263,518	ヘルスケア	
CIGNA CORP	40.5	809	88,805	ヘルスケア	
DELL TECHNOLOGIES -C	19.17	92	10,195	情報技術	
ALTICE USA INC- A	10.38	26	2,912	コミュニケーション・サービス	
XCEL ENERGY INC	53.81	330	36,290	公益事業	
STERIS PLC	8.97	135	14,869	ヘルスケア	
FOX CORP - CLASS B	15.3	53	5,870	コミュニケーション・サービス	
FOX CORP - CLASS A	52.67	188	20,657	コミュニケーション・サービス	
STRYKER CORP	37.38	765	83,989	ヘルスケア	
DOW INC	88.15	470	51,599	素材	
PARKER HANNIFIN CORP	12.39	246	27,014	資本財・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	16.48	48	5,350	資本財・サービス	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22.03	281	30,889	エネルギー	
POLARIS INC	9.89	96	10,597	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12月2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	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	278.25	3,396	372,508	生活必需品
EXELON CORP	98.59	437	48,011	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26.52	302	33,141	ヘルスケア
NVR INC	0.45	170	18,715	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	122.28	732	80,389	エネルギー
TWILIO INC - A	13.31	137	15,077	情報技術
DOCUSIGN INC	10.27	73	8,021	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	4.91	135	14,907	情報技術
MATCH GROUP INC	9.28	65	7,173	コミュニケーション・サービス
PEPSICO INC	156.2	2,121	232,704	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	50	5,497	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	44	4,850	情報技術
MONGODB INC	3.9	57	6,360	情報技術
SNAP INC - A	68.89	105	11,522	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	75.09	195	21,429	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.88	401	44,030	金融
AMCOR PLC	174.57	179	19,644	素材
ROKU INC	9.39	150	16,516	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	253	27,770	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	72.8	1,464	160,620	情報技術
PENTAIR PLC	15.75	69	7,661	資本財・サービス
QUALCOMM INC	134.03	1,119	122,821	情報技術
INVESCO LTD	37	64	7,126	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	128	14,110	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	175	19,296	金融
RAYTHEON COMPANY	31.16	677	74,306	資本財・サービス
DISH NETWORK CORP-RTS	1.61	0	12	コミュニケーション・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	9.25	341	37,436	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	236	25,931	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.86	925	101,493	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	41.29	479	52,600	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	8.44	94	10,358	素材
RESMED INC	13.83	206	22,692	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	18.12	193	21,175	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	87	9,568	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	4	42	4,709	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	11.63	108	11,850	ヘルスケア
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	153	16,881	金融
CHEVRON CORP	213.52	2,500	274,305	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	38.64	267	29,284	公益事業
TESLA INC	16.51	544	59,746	一般消費財・サービス
NORTONLIFELOCK INC	79.44	197	21,695	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	15.81	249	27,352	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	15.82	223	24,472	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18.17	854	93,667	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	219	24,071	不動産
TWITTER INC	84.84	262	28,762	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	113.05	700	76,863	公益事業
SYSCO CORP	48.6	391	42,936	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	28.6	391	42,886	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	124	13,624	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	77	8,508	素材
SCHLUMBERGER LTD	149.99	542	59,552	エネルギー

銘柄	2019年12月2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	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	104	11,441	資本財・サービス
AT&T INC	818.15	3,058	335,428	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	101	11,113	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	36.27	77	8,540	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8.34	486	53,340	素材
SEMPRA ENERGY	31.6	465	51,042	公益事業
TIFFANY & CO	10.86	145	15,937	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	23.49	140	15,375	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	105.74	1,271	139,414	情報技術
SALESFORCE.COM INC	96.2	1,567	171,868	情報技術
WESTROCK CO	23.21	93	10,266	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	99.06	424	46,534	資本財・サービス
TERADYNE INC	20.96	131	14,388	情報技術
UNION PACIFIC CORP	80.49	1,416	155,366	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	102.44	119	13,089	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	70.61	428	46,962	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	90.33	1,339	146,966	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	80.87	968	106,198	資本財・サービス
UNUM GROUP	19	58	6,405	金融
SPRINT CORP	114.74	67	7,450	コミュニケーション・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	17.81	259	28,515	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	104	11,505	金融
AMEREN CORPORATION	28.61	212	23,324	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	107.26	3,001	329,246	ヘルスケア
VERISIGN INC	10.85	206	22,698	情報技術
VALERO ENERGY CORP	45.4	433	47,548	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	6.35	148	16,287	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	143	15,713	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	138	15,176	ヘルスケア
ANTHEM INC	29.08	839	92,067	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	201.84	3,059	335,564	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	476.67	2,595	284,723	金融
WASTE MANAGEMENT INC	46.9	529	58,080	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	125.23	284	31,206	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15.91	150	16,479	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	8.7	124	13,654	一般消費財・サービス
WALMART INC	158.96	1,893	207,630	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	78	8,586	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23.65	343	37,684	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	138	15,176	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	19.88	77	8,488	情報技術
WABTEC CORP	18.98	149	16,356	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	131.81	805	88,375	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.5	144	15,831	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	9.92	92	10,096	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	38.47	711	78,033	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	139	15,275	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	89.76	534	58,675	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15.11	296	32,555	金融
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	177	19,491	情報技術
WECC ENERGY GROUP INC	34.67	307	33,710	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	50.77	301	33,026	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	193.27	3,566	391,121	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12月2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	
PPL CORP	73.94	251	27,597	公益事業
PULTEGROUP INC	35.56	140	15,464	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	24.34	313	34,395	素材
NORTHERN TRUST CORP	20.62	221	24,253	金融
NVIDIA CORP	63.91	1,385	151,927	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	8.59	191	20,981	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	49.94	765	83,919	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	24.82	98	10,840	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	32.11	288	31,657	生活必需品
NETFLIX INC	50.12	1,577	172,973	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43.93	1,379	151,268	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	119	13,072	公益事業
GLOBE LIFE INC	12.15	124	13,693	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	18.56	203	22,371	金融
TEXTRON INC	22.1	102	11,208	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	79.99	103	11,300	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	24.52	103	11,311	公益事業
OMNICOM GROUP	25.46	202	22,194	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	261.18	1,466	160,819	情報技術
MASTERCARD INC - A	101.41	2,963	325,037	情報技術
ONEOK INC	45.66	324	35,581	エネルギー
CENTURYLINK INC	97.47	141	15,490	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	457	50,157	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	32.71	329	36,116	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	11.91	144	15,851	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	42	4,690	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO-B	17.75	89	9,827	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	62.74	130	14,285	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	1,012.68	3,374	370,087	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4.18	142	15,678	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21.27	171	18,828	ヘルスケア
NORDSTROM INC	8	30	3,349	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	72.62	872	95,675	金融
ANALOG DEVICES INC	39.3	443	48,686	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	114.47	448	49,153	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	34.8	180	19,782	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	94.6	498	54,638	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22.83	224	24,614	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17.84	214	23,484	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	11.31	147	16,172	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	62.07	397	43,645	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	63.46	468	51,408	資本財・サービス
ACN PLC	26.41	537	58,978	金融
AMGEN INC	66.7	1,565	171,713	ヘルスケア
TAPESTRY INC	25.5	68	7,520	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	48.03	444	48,728	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	17.84	331	36,406	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	102.64	594	65,181	情報技術
CME GROUP INC	41.37	838	91,987	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33.89	76	8,381	エネルギー
ECOLAB INC	29.12	543	59,620	素材
EQUIFAX INC	12.56	175	19,236	資本財・サービス
GAP INC/THE	28.2	46	5,137	一般消費財・サービス

銘柄	2019年12月2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	
GILEAD SCIENCES INC	144.04	968	106,227	ヘルスケア
HORMEL FOODS CORP	33.15	147	16,190	生活必需品
STATE STREET CORP	39.48	296	32,519	金融
SUNTRUST BANKS INC	46.15	326	35,857	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	128.07	633	69,531	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	51.75	424	46,525	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	13	60	6,640	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	11.45	86	9,531	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	182	20,032	ヘルスケア
FEDEX CORP	28.93	463	50,784	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51.81	518	56,830	金融
FMC CORP	11.42	111	12,269	素材
FLEX LTD	45	53	5,858	情報技術
CERNER CORP	41.33	295	32,452	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11.63	164	18,014	素材
CITRIX SYSTEMS INC	13.5	152	16,703	情報技術
INTEL CORP	497.06	2,885	316,474	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	117	12,851	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	301	33,014	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	35.91	626	68,661	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	106	11,713	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	16.54	530	58,189	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	54	6,000	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	12.38	734	80,506	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	17.9	211	23,143	情報技術
SNAP-ON INC	5	80	8,799	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	193	21,228	一般消費財・サービス
COMERICA INC	11.87	83	9,166	金融
INGREDION INC	5.3	44	4,834	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	82.01	723	79,307	公益事業
TARGET CORP	55.74	696	76,425	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	190	20,945	資本財・サービス
VVV GRAINGER INC	5.88	186	20,440	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	161	17,675	資本財・サービス
CINTAS CORP	9.95	255	28,053	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	160	17,627	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	125	13,816	生活必需品
CLOROX COMPANY	12.78	189	20,777	生活必需品
ENTERGY CORP	21.14	246	26,986	公益事業
MICROSOFT CORP	809.83	12,259	1,344,589	情報技術
INCYTE CORP	19.93	187	20,582	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	147.72	1,111	121,951	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	148.77	1,657	181,756	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	129.91	617	67,694	情報技術
BLACKROCK INC	13.6	673	73,823	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	138	15,181	公益事業
HASBRO INC	14.49	147	16,162	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	26.2	170	18,712	生活必需品
KEYCORP	117.82	228	25,056	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	179	19,659	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	165.75	870	95,514	生活必需品
KOHL'S CORP	16.5	77	8,507	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	5.72	179	19,642	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2019年12月2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	
APACHE CORP	36.73	81	8,975	エネルギー
CHUBB LTD	50.52	765	83,935	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	79	8,734	情報技術
ALLSTATE CORP	39.99	445	48,839	金融
EBAY INC	90.53	321	35,268	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	129.27	1,396	153,140	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	12.83	100	11,028	素材
XILINX INC	25.83	239	26,284	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	29.84	101	11,183	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	19	94	10,373	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CLA	23.4	457	50,167	生活必需品
TRIMBLE INC	22	89	9,779	情報技術
LENNAR CORP-A	33.94	202	22,204	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	72	7,917	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	39.17	173	19,032	金融
PROGRESSIVE CORP	64.74	472	51,870	金融
PACCAR INC	35.25	286	31,459	資本財・サービス
PVH CORP	6.18	59	6,572	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	21.3	638	70,041	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	9.37	235	25,854	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	130.62	1,115	122,390	一般消費財・サービス
PTC INC	12	91	10,081	情報技術
PERRIGO CO PLC	19.29	98	10,838	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	34.23	282	31,025	公益事業
INTUIT INC	28.46	736	80,812	情報技術
BORGWARNER INC	30.81	129	14,209	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	23	185	20,342	一般消費財・サービス
BALL CORP	35.8	236	25,938	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	162.47	702	77,070	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	371	40,736	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	16.06	227	24,989	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28.56	633	69,462	ヘルスケア
VF CORP	38.82	343	37,698	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	39.03	157	17,285	コミュニケーション・サービス
VIACOM INC-CLASS B	30.71	73	8,107	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	9.42	131	14,399	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	134	14,711	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	49.92	225	24,682	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	510.46	2,253	247,183	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	66	7,312	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	22	123	13,565	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	32	3,593	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	127	13,934	不動産
アメリカ・ドル 通貨計	33,750.2 611銘柄	300,306	32,937,623 <64.7%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	23	76	6,320	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	355	29,330	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24.38	33	2,759	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	21.21	185	15,292	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42	153	12,665	素材
INTACT FINANCIAL CORP	17	232	19,237	金融
BCE INC	9	57	4,754	コミュニケーション・サービス

銘柄	2019年12月2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	22	287	23,751	素材
SUNCOR ENERGY INC	172.12	713	58,915	エネルギー
METRO INC/CN	30	174	14,420	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	33	234	19,398	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	130	974	80,490	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	44	508	41,972	金融
TORONTO-DOMINION BANK	189	1,447	119,596	金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	39	130	10,778	金融
ROYAL BANK OF CANADA	166	1,804	149,122	金融
TC ENERGY CORP	88	591	48,858	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	55.71	258	21,347	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	192	37	3,125	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	174	385	31,885	素材
CAE INC	23	82	6,782	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	18.33	170	14,065	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	64	5,289	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	34	2,863	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	56	4,693	素材
HYDRO ONE LTD	48	120	9,922	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	178	14,723	生活必需品
WSP GLOBAL INC	12	102	8,499	資本財・サービス
PARKLAND FUEL CORP	28	132	10,923	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	75	6,259	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	25	136	11,281	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	39	3,227	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	39	251	20,757	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	228	18,909	素材
STARS GROUP INC/THE	35	111	9,204	一般消費財・サービス
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	130	10,774	公益事業
AIR CANADA	17	85	7,029	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	105.34	60	4,995	素材
BANK OF MONTREAL	66	674	55,739	金融
POWER CORP OF CANADA	31	99	8,257	金融
METHANEX CORP	6	29	2,450	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	10	445	36,803	情報技術
NUTRIEN LTD	60.27	377	31,221	素材
AURORA CANNABIS INC	70	23	1,920	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	20	49	4,050	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	34	30	2,536	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	22	122	10,140	素材
CAMECO CORP	28	33	2,799	エネルギー
TELUS CORP	3	15	1,243	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	20	64	5,366	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	91	7,561	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4	61	5,114	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	117	434	35,872	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	180	14,871	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	226	18,743	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	97	8,042	生活必需品
BLACKBERRY LTD	64	46	3,875	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	65	393	32,549	金融
ENBRIDGE INC	213	1,071	88,518	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CLA	90	691	57,144	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12月2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	
MANULIFE FINANCIAL CORP	202	527	43,608	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	43	161	13,329	ヘルスケア
ENCANA CORP	152	79	6,542	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18	566	46,781	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	74	6,179	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	109	9,022	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	71	856	70,750	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	308	25,463	情報技術
HUSKY ENERGY INC	30.12	29	2,406	エネルギー
ONEX CORPORATION	16	126	10,456	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	186	15,421	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	11	946	金融
OPEN TEXT CORP	27	156	12,900	情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	41	3,456	金融
SAPUTO INC	29	116	9,619	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	76	6,324	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	90	391	32,315	生活必需品
FORTIS INC	42	218	18,058	公益事業
LUNDIN MINING CORP	66	47	3,920	素材
CENOVUS ENERGY INC	141	165	13,676	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	131	10,839	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	40	3,330	公益事業
ALTAGAS LTD	47	92	7,649	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	20	43	3,565	不動産
KEYERA CORP	22	71	5,890	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	105	8,724	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,345.88 86銘柄	20,699 < 3.4%>	1,710,232 < 3.4%>
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	74	5,524	金融
BHP GROUP LTD	318.05	1,215	90,280	素材
SOUTH32 LTD	563.87	152	11,304	素材
ALUMINA LTD	362.17	83	6,211	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	95.76	330	24,537	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	199	14,849	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	36	36	2,681	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	297.31	769	57,152	金融
WESTPAC BANKING CORP	368.11	902	67,018	金融
SANTOS LTD	182.7	148	11,055	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	49	3,682	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	307.72	764	56,754	金融
RIO TINTO LTD	41.69	403	29,995	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	182	13,544	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	167	12,465	資本財・サービス
COLES GROUP LTD	166.96	271	20,157	生活必需品
OIL SEARCH LTD	154.18	114	8,517	エネルギー
SEEK LTD	26	60	4,476	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	190	14,124	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	84.2	258	19,230	素材
INCITEC PIVOT LTD	204	65	4,892	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	188.45	1,523	113,086	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	20	69	5,132	エネルギー
ORICA LTD	58.45	138	10,320	素材

銘柄	2019年12月2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	
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	194	14,449	金融
CIMIC GROUP LTD	10	33	2,497	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	140.56	558	41,495	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	29	2,196	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	83	6,171	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	38	2,875	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	135	10,063	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	249.35	48	3,619	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	67.33	194	14,477	素材
MACQUARIE GROUP LTD	31.29	431	32,072	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	209	15,521	一般消費財・サービス
CSL LTD	54.73	1,551	115,197	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	157.53	667	49,558	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	8.05	188	13,985	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	103	7,661	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	194	14,409	金融
BORAL LTD	86	44	3,282	素材
ASX LTD	22.6	184	13,711	金融
COMPUTERSHARE LTD	20.61	36	2,713	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	213	15,874	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	157	11,680	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	63	51	3,807	金融
WORLEYP LTD	71.87	107	8,004	エネルギー
AGL ENERGY LTD	84.66	172	12,829	公益事業
BRAMBLES LTD	183.37	230	17,087	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	8	35	2,615	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	150	11,184	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	63	4,711	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15.51	81	6,044	金融
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,432.39 53銘柄	14,367 < 2.1%>	1,066,801 < 2.1%>
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	235	1,279	17,926	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	220	1,126	15,780	一般消費財・サービス
MTR CORP	165	724	10,148	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	2,164	30,319	不動産
SINO LAND CO	340	399	5,592	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	285.52	2,030	28,440	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	563	7,896	不動産
CLP HOLDINGS LTD	190	1,533	21,481	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	774	10,847	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,180.35	1,761	24,672	公益事業
HANG SENG BANK LTD	90	1,436	20,123	金融
WHEELLOCK & CO LTD	160	778	10,905	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	592	8,304	不動産
WH GROUP LTD	915	735	10,306	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	139	3,436	48,139	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	370	593	8,314	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	204	2,863	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	80	185	2,594	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	150	157	2,203	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	75	189	2,656	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	86	151	2,127	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12月2日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千香港ドル	千円		
SJM HOLDINGS LTD	100	79	1,117	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	80	194	2,729	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	305.52	1,590	22,279	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	291	4,083	公益事業	
PCCW LTD	600	283	3,967	コミュニケーション・サービス	
AIA GROUP LTD	1,478	11,587	162,341	金融	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	608	8,522	不動産	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	120	361	5,060	生活必需品	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	535	7,504	生活必需品	
SANDS CHINA LTD	238	880	12,337	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	190	1,118	15,665	資本財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	390	1,037	14,533	金融	
WYNN MACAU LTD	168	289	4,053	一般消費財・サービス	
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	9,813.04 34銘柄	555,842 < 1.1% >		
<b>(シンガポール)</b>	百株	千シンガポール・ドル	千円		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	129	333	26,716	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	211	532	42,733	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	65	5,233	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	173	116	9,324	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	166	128	10,332	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	53	4,312	不動産	
CAPITALAND LTD	334	122	9,858	不動産	
YANGZHUANG SHIPBUILDING	270	27	2,230	資本財・サービス	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	26	2,117	コミュニケーション・サービス	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	27	2,211	一般消費財・サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	348	375	30,090	金融	
GENTING SINGAPORE LTD	450	41	3,338	一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	32	50	4,073	情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	924	312	25,050	コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	58	4,670	資本財・サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	40	8	702	資本財・サービス	
SATS LTD	77	38	3,075	資本財・サービス	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	168	148	11,925	金融	
COMFORTDELGRO CORP LTD	369	86	6,955	資本財・サービス	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	64	5,183	生活必需品	
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,242 20銘柄	210,139 < 0.4% >		
<b>(ニュージーランド)</b>	百株	千ニュージーランド・ドル	千円		
MERIDIAN ENERGY LTD	150	70	4,990	公益事業	
MERCURY NZ LTD	217.05	104	7,358	公益事業	
A2 MILK CO LTD	70	108	7,673	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	76	5,406	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	73	5,166	資本財・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	145.26	75	5,365	素材	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	92	203	14,392	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	66	4,712	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	968.1 8銘柄	55,065 < 0.1% >		
<b>(イギリス)</b>	百株	千イギリス・ポンド	千円		
TUI AG-DI	48.02	51	7,230	一般消費財・サービス	
BP PLC	2,309.65	1,109	157,036	エネルギー	

銘柄	2019年12月2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		
UNILEVER PLC	120.91	553	78,373	生活必需品	
BARCLAYS PLC	1,801.73	309	43,761	金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	177.45	126	17,879	資本財・サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	324.28	63	8,923	一般消費財・サービス	
PRUDENTIAL PLC	303.22	417	59,097	金融	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	508.36	114	16,281	金融	
EVRAZ PLC	74.41	27	3,902	素材	
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	50	7,153	素材	
BAE SYSTEMS PLC	377.96	216	30,685	資本財・サービス	
AVIVA PLC	443.49	179	25,356	金融	
AVEVA GROUP PLC	11.4	51	7,357	情報技術	
GLAXOSMITHKLINE PLC	546.29	958	135,670	ヘルスケア	
INFORMA PLC	162	128	18,152	コミュニケーション・サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	42.04	47	6,742	情報技術	
MELROSE INDUSTRIES PLC	643.35	147	20,914	資本財・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	81	11,537	コミュニケーション・サービス	
DCC PLC	9.38	61	8,776	資本財・サービス	
OCADO GROUP PLC	44.17	58	8,286	一般消費財・サービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	66	9,351	資本財・サービス	
HALMA PLC	39.78	83	11,861	情報技術	
GVC HOLDINGS PLC	88.05	74	10,616	一般消費財・サービス	
NMC HEALTH PLC	9.75	24	3,463	ヘルスケア	
JD SPORTS FASHION PLC	64.11	48	6,904	一般消費財・サービス	
M&G PLC	259.64	61	8,675	金融	
RELX PLC	202.6	379	53,729	資本財・サービス	
DIAGEO PLC	266.94	844	119,624	生活必需品	
RIO TINTO PLC	125.42	526	74,611	素材	
STANDARD CHARTERED PLC	297.45	207	29,371	金融	
TESCO PLC	1,093.1	250	35,504	生活必需品	
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	195	27,688	ヘルスケア	
GLENCORE PLC	1,235.14	301	42,654	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	59	8,404	金融	
SMITHS GROUP PLC	40.8	67	9,595	資本財・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109.63	33	4,740	金融	
PEARSON PLC	82.71	53	7,572	コミュニケーション・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	176.31	37	5,349	生活必需品	
NEXT PLC	11.59	78	11,090	一般消費財・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	56	7,953	一般消費財・サービス	
WHITBREAD PLC	17.85	82	11,628	一般消費財・サービス	
BUNZL PLC	31.59	67	9,495	資本財・サービス	
VODAFONE GROUP PLC	3,034.98	465	65,902	コミュニケーション・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	87	12,332	素材	
KINGFISHER PLC	172.29	36	5,120	一般消費財・サービス	
WPP PLC	130.21	130	18,445	コミュニケーション・サービス	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	70	9,961	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	13	29	4,128	公益事業	
RENTOKIL INITIAL PLC	177.58	79	11,186	資本財・サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	80.82	490	69,415	生活必需品	
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	53	7,525	金融	
SCHRODERS PLC	12.27	40	5,731	金融	
SSE PLC	124.6	161	22,934	公益事業	
WEIR GROUP PLC/THE	39.42	55	7,788	資本財・サービス	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	82	11,676	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12月2日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千円	千円		
ASTRAZENECA PLC	144.04	1,074	152,103	ヘルスケア	
FERGUSON PLC	27.24	183	25,926	資本財・サービス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	191	27,137	金融	
3I GROUP PLC	132.93	142	20,157	金融	
ASHTREAD GROUP PLC	59.21	139	19,701	資本財・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	97.25	73	10,379	情報技術	
NATIONAL GRID PLC	357.13	317	44,988	公益事業	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,349.13	449	63,630	金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	125.86	69	9,826	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	102.29	174	24,667	生活必需品	
CENTRICA PLC	680.02	54	7,723	公益事業	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	19.63	90	12,746	一般消費財・サービス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	255.03	780	110,495	生活必需品	
BHP GROUP PLC	261.42	447	63,294	素材	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49.64	127	18,056	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	2,333.46	1,344	190,406	金融	
ANGLO AMERICAN PLC	107.45	217	30,830	素材	
MONDI PLC	59.21	99	14,046	素材	
WM MORRISON SUPERMARKETS	391.67	77	10,997	生活必需品	
CARNIVAL PLC	13.83	44	6,369	一般消費財・サービス	
EASYJET PLC	16.44	21	3,114	資本財・サービス	
COMPASS GROUP PLC	164.81	312	44,209	一般消費財・サービス	
PERSIMMON PLC	25.69	65	9,304	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	856.24	164	23,223	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	66	9,399	生活必需品	
BURBERRY GROUP PLC	51.36	108	15,300	一般消費財・サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	21.82	109	15,469	一般消費財・サービス	
INTERTEK GROUP PLC	15.92	87	12,433	資本財・サービス	
ITV PLC	275.87	40	5,667	コミュニケーション・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	34.41	236	33,481	金融	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	477.42	1,055	149,458	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	428.67	938	132,892	エネルギー	
MEGGITT PLC	99.25	63	9,035	資本財・サービス	
G4S PLC	113.2	23	3,351	資本財・サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	33	4,757	金融	
ANTOFAGASTA PLC	34.6	30	4,252	素材	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	330.46	104	14,827	金融	
EXPERIAN PLC	93.19	238	33,818	資本財・サービス	
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 93銘柄 銘柄数<比率>	19,935	2,822,641	< 5.5%>	
(イスラエル)	株数、金額	千円	千円		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	190	6,021	金融	
AZRIELI GROUP LTD	5.3	144	4,561	不動産	
ISRAEL CHEMICALS LTD	110.96	177	5,589	素材	
ELBIT SYSTEMS LTD	3	169	5,350	資本財・サービス	
BANK HAPOALIM BM	151.6	419	13,229	金融	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	474	14,970	金融	
NICE LTD	8	416	13,128	情報技術	
イスラエル・シェケル 通貨計	株数、金額 7銘柄 銘柄数<比率>	1,991	62,851	< 0.1%>	
(スイス)	株数、金額	千円	千円		
DUFREY AG-REG	8.3	80	8,875	一般消費財・サービス	
UBS GROUP AG-REG	425.77	516	56,552	金融	

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千円	千円		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	80	8,840	素材	
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	108	11,883	資本財・サービス	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	76.24	2,349	257,505	ヘルスケア	
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	30	3,363	金融	
SIKA AG-REG	11.4	198	21,744	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	85	9,348	生活必需品	
ABB LTD-REG	206.23	451	49,427	資本財・サービス	
SWISS RE AG	36.66	397	43,510	金融	
NESTLE SA-REG	335.45	3,485	382,030	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.34	197	21,623	金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5.31	132	14,507	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	394	43,260	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD	21.98	103	11,340	金融	
SGS SA-REG	0.65	169	18,534	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1.53	36	4,010	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG	6.65	118	12,994	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG	7.93	120	13,183	情報技術	
ALCON INC	42.49	234	25,708	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	140	15,342	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14.92	585	64,144	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	106	11,637	金融	
CLARIANT AG-REG	15.68	32	3,550	素材	
NOVARTIS AG-REG	234.62	2,159	236,704	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.2	40	4,405	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	54.28	413	45,304	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	2.76	142	15,655	コミュニケーション・サービス	
ZEBETIT AG-REG	4.56	244	26,825	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	0.89	261	28,665	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	106	11,702	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	5.63	128	14,085	ヘルスケア	
LONZA GROUP AG-REG	8.55	290	31,820	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	23	2,628	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	47.7	245	26,952	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	188	20,701	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4.95	80	8,820	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	99	10,947	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.17	129	14,205	生活必需品	
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 39銘柄 銘柄数<比率>	14,712	1,612,345	< 3.2%>	
(デンマーク)	株数、金額	千円	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	210.28	8,015	129,616	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	72.36	662	10,713	金融	
ISS A/S	13.2	205	3,322	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	264	4,271	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S	5	129	2,100	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18.57	1,198	19,379	資本財・サービス	
CARLSBERG AS-B	12.32	1,201	19,435	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	965	15,617	素材	
COLOPLAST-B	15.19	1,217	19,679	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	27.98	2,066	33,407	資本財・サービス	
DEMANT A/S	13.14	272	4,408	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	625	10,115	資本財・サービス	
TRYG A/S	17	331	5,360	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12月2日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
PANDORA A/S	百株	千円			
	7.5	204	3,310	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	649	10,509	素材	
GENMAB A/S	7.33	1,158	18,727	ヘルスケア	
ORSTED A/S	22.76	1,422	23,001	公益事業	
デンマーク・クロネ 通貨計	486.02 17銘柄	20,592	332,977 < 0.7% >		
(ノルウェー)	百株	千円			
NORSK HYDRO ASA	130.5	425	5,062	素材	
DNB ASA	85.45	1,322	15,740	金融	
ORKLA ASA	137.84	1,230	14,641	生活必需品	
TELENOR ASA	87.46	1,471	17,505	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	111.21	1,888	22,471	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	957	11,396	素材	
MOWI ASA	46.77	1,069	12,723	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	346	4,128	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	403	4,806	コミュニケーション・サービス	
AKER BP ASA	13.06	345	4,107	エネルギー	
ノルウェー・クロネ 通貨計	676.85 10銘柄	9,460	112,584 < 0.2% >		
(スウェーデン)	百株	千円			
ICA GRUPPEN AB	7	292	3,353	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	403.81	3,484	39,936	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	181.58	2,688	30,807	資本財・サービス	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7.77	332	3,814	コミュニケーション・サービス	
SKF AB-B SHARES	40	731	8,384	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	26	639	7,332	一般消費財・サービス	
SWEDISH MATCH AB	21.88	1,003	11,501	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	70.26	992	11,377	コミュニケーション・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	196.97	1,617	18,536	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	165.26	1,553	17,802	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	90.75	1,131	12,968	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	90.39	1,670	19,147	一般消費財・サービス	
SKANSKA AB-B SHS	37.09	784	8,994	資本財・サービス	
SANDVIK AB	132.81	2,312	26,505	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	62.9	3,183	36,488	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	76.68	2,690	30,835	資本財・サービス	
SECURITAS AB-B SHS	25	397	4,549	資本財・サービス	
TELIA CO AB	364.21	1,509	17,300	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	48.4	1,140	13,067	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	38.11	1,179	13,521	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	108.82	2,474	28,358	資本財・サービス	
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	359	4,124	金融	
LUNDIN PETROLEUM AB	19	560	6,427	エネルギー	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	67.47	2,030	23,273	生活必需品	
BOLIDEN AB	31.71	783	8,975	素材	
EPIROC AB-A	69.82	780	8,945	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	25	269	3,084	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	24	179	2,056	一般消費財・サービス	
NORDEA BANK ABP	345.48	2,343	26,855	金融	
KINNEVIK AB - B	36.41	798	9,150	金融	
HEXAGON AB-B SHS	38.68	2,094	23,998	情報技術	

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	百株	千円			
	13	288	3,308	金融	
スウェーデン・クロネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,875.74 32銘柄	42,302 484,786 < 1.0% >		
ユーロ (アイルランド)	百株	千ユーロ	千円		
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19.95	64	7,763	素材	
AIB GROUP PLC	90	26	3,230	金融	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	102.34	46	5,640	金融	
KINGSPAN GROUP PLC	16	78	9,459	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	17.12	199	24,084	生活必需品	
CRH PLC	80.12	278	33,630	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8.89	92	11,174	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	334.42 7銘柄	785 94,983 < 0.2% >		
ユーロ (オランダ)	百株	千ユーロ	千円		
QIAGEN N.V.	25.21	97	11,840	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	93.09	392	47,416	ヘルスケア	
NN GROUP NV	31	108	13,053	金融	
HEINEKEN NV	29.1	273	33,074	生活必需品	
AEGON NV	143.61	58	7,102	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	131.07	306	37,044	生活必需品	
AKZO NOBEL N.V.	25.04	217	26,304	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	19.38	225	27,240	素材	
WOLTERS KLUWER	30.97	201	24,389	資本財・サービス	
ING GROEP NV	432.86	452	54,638	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	295.49	82	9,985	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	46.53	1,149	138,903	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	34.53	53	6,464	金融	
ADYEN NV	1.5	104	12,621	情報技術	
UNILEVER NV	166.82	897	108,470	生活必需品	
PROSUS NV	54.94	339	41,081	一般消費財・サービス	
VOPAK	6.3	30	3,684	エネルギー	
RANDSTAD NV	20.2	106	12,905	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	11	95	11,566	生活必需品	
ALTICE EUROPE NV	112.95	61	7,374	コミュニケーション・サービス	
STMICROELECTRONICS NV	74.98	167	20,208	情報技術	
AIRBUS SE	63.45	846	102,298	資本財・サービス	
EXOR NV	10.88	75	9,131	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	113	13,745	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	107.87	144	17,495	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	14.78	226	27,402	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,100.46 26銘柄	6,829 825,443 < 1.6% >		
ユーロ (ベルギー)	百株	千ユーロ	千円		
GALAPAGOS NV	5.57	99	12,040	ヘルスケア	
UCB SA	19.21	141	17,078	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	30.11	199	24,068	金融	
COLRUYT SA	3.5	16	1,988	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15.39	141	17,130	金融	
SOLVAY SA	8.73	90	10,973	素材	
UMICORE	16	62	7,537	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	83.47	599	72,503	生活必需品	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2019年12月2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	
AGEAS	16.54	90	10,890	金融
PROXIMUS	22.69	62	7,508	コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	4.62	18	2,287	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	225.83 11銘柄	1,522 184,007 < 0.4%>	
<b>ユーロ (ルクセンブルク)</b>	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	160.64	126	15,302	不動産
ARCELORMITTAL	80.31	124	15,071	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	1.31	62	7,545	ヘルスケア
SES	44.02	53	6,408	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	47	45	5,482	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	333.28 5銘柄	412 49,811 < 0.1%>	
<b>ユーロ (フランス)</b>	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	8.45	21	2,655	コミュニケーション・サービス
TOTAL SA	255.19	1,215	146,932	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	18.61	202	24,493	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	52.1	641	77,482	素材
KERING	8.24	450	54,445	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	58.92	516	62,380	資本財・サービス
BOUYGUES SA	18.92	70	8,478	資本財・サービス
BNP PARIBAS	122.69	625	75,579	金融
PEUGEOT SA	64.97	142	17,212	一般消費財・サービス
NATIXIS	76.74	29	3,517	金融
THALES SA	14.04	124	15,088	資本財・サービス
DANONE	64.94	485	58,645	生活必需品
CARREFOUR SA	80.22	120	14,523	生活必需品
SUEZ	29.5	39	4,790	公益事業
VIVENDI	104.3	259	31,413	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	27.41	709	85,701	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	58.49	214	25,978	資本財・サービス
LEGRAND SA	30.42	218	26,353	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	7	965	生活必需品
PERNOD RICARD SA	26.32	438	53,027	生活必需品
EURAZEO SE	5.6	34	4,186	金融
SOCIETE GENERALE SA	80.65	230	27,838	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	29.88	1,217	147,088	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	71	8,682	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	16.45	176	21,342	情報技術
VALEO SA	37.03	132	16,004	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	116	14,085	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	76	9,266	資本財・サービス
EFFAGE	7.5	74	8,982	資本財・サービス
SODEXO SA	12.48	132	15,958	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	28	3,419	ヘルスケア
INGENICO GROUP	4.99	48	5,841	情報技術
AMUNDI SA	4.37	30	3,628	金融
TELEPERFORMANCE	8.7	187	22,606	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	53	6,506	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	5.6	26	3,258	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	57	6,948	ヘルスケア
SEB SA	1.97	27	3,357	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	31.11	438	53,015	一般消費財・サービス

銘柄	2019年12月2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	
DASSAULT AVIATION SA	0.22	27	3,283	資本財・サービス
WORLDLINE SA	13.3	78	9,443	情報技術
AXA SA	231.71	572	69,157	金融
EDENRED	30.07	135	16,372	資本財・サービス
RENAULT SA	25.54	110	13,413	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	3.41	231	28,025	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	29	3,574	生活必需品
ATOS SE	9.46	72	8,812	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	15.15	216	26,183	情報技術
WENDEL	2.01	24	2,971	金融
ORANGE	257.92	386	46,758	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	29.61	117	14,164	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	24	2,921	金融
SANOFI	120.77	1,020	123,353	ヘルスケア
VINCI SA	55.31	547	66,165	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	73.51	170	20,647	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	181	21,920	金融
BIOMERIEUX	4.57	37	4,531	ヘルスケア
ENGIE	210.99	302	36,618	公益事業
EDF	67.6	63	7,617	公益事業
SAFRAN SA	35.87	532	64,356	資本財・サービス
ILIAD SA	2.19	25	3,058	コミュニケーション・サービス
ARKEMA	8.38	78	9,526	素材
ADP	3.5	62	7,508	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14	20	2,519	コミュニケーション・サービス
SCOR SE	32.89	128	15,498	金融
GETLINK SE	39.4	60	7,290	資本財・サービス
BOLLORE	73	28	3,423	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,987.76 67銘柄	14,982 1,810,802 < 3.6%>	
<b>ユーロ (ドイツ)</b>	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	100.78	692	83,678	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	18	47	5,730	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	229.67	150	18,164	金融
COMMERZBANK AG	96.89	50	6,160	金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	72	8,789	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	21.21	372	44,983	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	82.21	962	116,369	資本財・サービス
E.ON SE	276.97	263	31,794	公益事業
UNIPER SE	13.8	40	4,886	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.21	214	25,877	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	37	4,583	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	11.8	139	16,914	一般消費財・サービス
BASF SE	112.83	769	93,029	素材
ALLIANZ SE-REG	45.48	988	119,471	金融
THYSSENKRUPP AG	40.3	45	5,542	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	18.57	178	21,519	生活必需品
RWE AG	75.26	202	24,477	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	29	3,538	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5.6	43	5,233	資本財・サービス
BRENNINTAG AG	14.36	69	8,401	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	240	29,007	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	29	3,564	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12月2日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
HOCHTIEF AG	1.66	18	2,236	資本財・サービス	
SAP SE	104.71	1,292	156,267	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17.04	444	53,669	金融	
ZALANDO SE	20.25	79	9,569	一般消費財・サービス	
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	142	17,257	素材	
KION GROUP AG	6	36	4,366	資本財・サービス	
WIRECARD AG	13.67	163	19,792	情報技術	
COVESTRO AG	19.45	82	9,990	素材	
SARTORIUS AG-VORZUG	3.05	58	7,051	ヘルスケア	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PREF	21.02	141	17,066	一般消費財・サービス	
DELIVERY HERO SE	10.56	50	6,126	一般消費財・サービス	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	62	7,512	ヘルスケア	
METRO AG	15	21	2,651	生活必需品	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	66	7,980	ヘルスケア	
KNORR-BREMSE AG	5.49	48	5,857	資本財・サービス	
BEIERSDORF AG	12.75	134	16,311	生活必需品	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	7	27	3,316	素材	
MERCK KGAA	16.92	179	21,676	ヘルスケア	
ADIDAS AG	19.8	559	67,662	一般消費財・サービス	
PUMA SE	12.95	88	10,674	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	115	13,911	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	363.69	554	66,970	コミュニケーション・サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	22.71	151	18,268	ヘルスケア	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	98.52	504	60,964	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	130.44	252	30,565	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	6.44	108	13,115	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	106.76	361	43,663	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	18.04	251	30,360	金融	
LANXESS AG	15.29	92	11,180	素材	
MTU AERO ENGINES AG	6.66	163	19,793	資本財・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	47.96	170	20,548	不動産	
SYMRISE AG	14.36	126	15,279	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	17	2,089	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PREF	9	50	6,091	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	57.63	272	32,938	不動産	
国小計	株数、金額 57銘柄数<比率>	2,607.29	12,530	1,514,495	< 3.0%>
<b>ユーロ (ポルトガル)</b>	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	29	42	5,080	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	101	12,231	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	106	12,826	エネルギー	
国小計	株数、金額 3銘柄数<比率>	376.59	249	30,138	< 0.1%>
<b>ユーロ (スペイン)</b>	百株	千ユーロ	千円		
TELEFONICA SA	542.59	377	45,589	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	21.5	53	6,413	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	711.85	340	41,137	金融	
IBERDROLA SA	685.24	611	73,940	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	496.34	49	6,040	金融	
BANKINTER SA	67	42	5,140	金融	
REPSOL SA	176.85	252	30,543	エネルギー	
GRIFOLS SA	30.04	93	11,258	ヘルスケア	

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
BANCO SANTANDER SA	1,775.93	628	75,917	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	50.48	364	44,110	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	93	11,346	公益事業	
MAPFRE SA	80.05	20	2,475	金融	
CAIXABANK SA	468.59	125	15,172	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35.83	126	15,299	資本財・サービス	
AENA SME SA	8.66	144	17,447	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	20.96	81	9,879	コミュニケーション・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	117.54	332	40,145	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	25	3,138	資本財・サービス	
ENAGAS SA	36.75	83	10,042	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40.56	71	8,701	公益事業	
FERROVIAL SA	60.55	163	19,722	資本財・サービス	
BANKIA SA	159.05	27	3,380	金融	
国小計	株数、金額 22銘柄数<比率>	5,644.07	4,110	496,843	< 1.0%>
<b>ユーロ (イタリア)</b>	百株	千ユーロ	千円		
PRYSMIAN SPA	41.45	85	10,364	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	117.33	217	26,276	金融	
MEDIOBANCA SPA	99.71	101	12,231	金融	
UNICREDIT SPA	294.71	370	44,744	金融	
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	61	7,451	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	27	3,268	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	1,354.57	311	37,662	金融	
ATLANTIA SPA	60.27	121	14,655	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	77.27	81	9,889	金融	
MONCLER SPA	15.22	60	7,315	一般消費財・サービス	
RECORDATI SPA	6.92	26	3,183	ヘルスケア	
ENI SPA	286.21	392	47,438	エネルギー	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	44.83	37	4,488	生活必需品	
PIRELLI & C SPA	56.51	29	3,517	一般消費財・サービス	
LEONARDO SPA	66.76	70	8,564	資本財・サービス	
ENEL SPA	889.57	609	73,711	公益事業	
SNAM SPA	243	109	13,251	公益事業	
TERNA SPA	199	116	14,021	公益事業	
FINCOBANK SPA	59.72	67	8,127	金融	
国小計	株数、金額 19銘柄数<比率>	5,481.89	2,897	350,165	< 0.7%>
<b>ユーロ (フィンランド)</b>	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	197	23,910	素材	
NOKIA OYJ	652.61	209	25,330	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	41.16	37	4,544	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	88.53	108	13,053	素材	
METSO OYJ	11.08	38	4,660	資本財・サービス	
ELISA OYJ	13	63	7,621	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	49.34	181	21,885	金融	
FORTUM OYJ	44	94	11,374	公益事業	
KONE OYJ-B	38.6	219	26,507	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	17.7	43	5,253	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	48.49	148	17,980	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	17.63	69	8,416	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 12銘柄数<比率>	1,087.39	1,411	170,539	< 0.3%>

銘	柄	2019年12月2日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ (オーストリア)	百株	86.25	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	12.16	57	6,933	公益事業	
OMV AG	12.09	62	7,560	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	27.5	89	10,801	金融	
VOESTALPINE AG	18	43	5,232	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	23	2,833	金融	
ANDRITZ AG	5.5	19	2,353	資本財・サービス	
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	86.25 6銘柄	295 < 0.1%>	35,714	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	21,265.23 235銘柄	46,028 <10.9%>	5,562,945	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	121,507.56 1,245銘柄	- <93.4%>	47,526,836	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年12月2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12月2日現在		
		口 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.679	359	39,484	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.433	519	56,935	
BOSTON PROPERTIES INC	1.556	215	23,643	
VORNADO REALTY TRUST	2.128	137	15,070	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.28	302	33,198	
EQUITY RESIDENTIAL	4.248	361	39,649	
EQUINIX INC	0.944	535	58,690	
AMERICAN TOWER CORP	4.869	1,042	114,298	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6.228	108	11,947	
KIMCO REALTY CORP	3.3	71	7,825	
INVITATION HOMES INC	6.081	185	20,362	
VICI PROPERTIES INC	5.464	135	14,820	
VENTAS INC	3.702	215	23,675	
WEYERHAEUSER CO	7.435	219	24,064	
AGNC INVESTMENT CORP	7.559	130	14,359	
CROWN CASTLE INTL CORP	4.614	616	67,640	
IRON MOUNTAIN INC	3.474	111	12,238	
VEREIT INC	13.632	133	14,592	
SUN COMMUNITIES INC	1.214	199	21,931	
PROLOGIS INC	7.007	641	70,358	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.2	195	21,390	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.177	131	14,400	
DUKE REALTY CORP	4.971	174	19,180	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.771	240	26,398	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.974	128	14,108	
通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	154.192 42銘柄	10,027 <2.2%>	1,099,807
(カナダ)		千口	千カナダ・ドル	千円
WELLTOWER INC	4.572	386	42,408	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6.434	224	24,614	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2.058	126	13,908	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.1	149	16,421	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.95	144	15,843	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15.632	145	15,996	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1.552	86	9,488	
REALTY INCOME CORP	3.348	256	28,139	
PUBLIC STORAGE	1.75	368	40,437	
REGENCY CENTERS CORP	1.939	126	13,832	
SL GREEN REALTY CORP	0.65	55	6,083	
UDR INC	2.965	142	15,625	
WP CAREY INC	1.6	133	14,639	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2.164	90	9,975	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.269	274	30,100	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.072	113	12,469	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4.197	87	9,556	
通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	5 3銘柄	169 <0.0%>	14,033

銘	柄	2019年12月2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
WELLTOWER INC	4.572	386	42,408	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6.434	224	24,614	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2.058	126	13,908	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.1	149	16,421	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.95	144	15,843	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15.632	145	15,996	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1.552	86	9,488	
REALTY INCOME CORP	3.348	256	28,139	
PUBLIC STORAGE	1.75	368	40,437	
REGENCY CENTERS CORP	1.939	126	13,832	
SL GREEN REALTY CORP	0.65	55	6,083	
UDR INC	2.965	142	15,625	
WP CAREY INC	1.6	133	14,639	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2.164	90	9,975	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.269	274	30,100	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.072	113	12,469	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4.197	87	9,556	
通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	154.192 42銘柄	10,027 <2.2%>	1,099,807
(カナダ)		千口	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1.6	88	7,328	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2	43	3,565	
RIOC REAL ESTATE INVST TR	1.4	37	3,139	
通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	5 3銘柄	169 <0.0%>	14,033

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12月2日現在		
	□ 数	価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
<b>(オーストラリア)</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千円
LENLEASE GROUP	4.303	83	6,169
TRANSURBAN GROUP	31.468	483	35,865
SYDNEY AIRPORT	9.129	83	6,222
APA GROUP	14.243	156	11,632
SCENTRE GROUP	64.017	252	18,727
DEXUS	13.949	170	12,666
GPT GROUP	30.647	188	13,994
MIRVAC GROUP	61.117	205	15,292
STOCKLAND	18.729	94	7,022
GOODMAN GROUP	20.198	299	22,225
VICINITY CENTRES	50.371	134	10,023
オーストラリア・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	318.171 11銘柄	2,152 <0.3%>
<b>(香港)</b>	千□	千香港ドル	千円
LINK REIT	24	1,920	26,899
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	52	398	5,587
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	390	5,468
香港ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	110 3銘柄	2,709 <0.1%>
<b>(シンガポール)</b>	千□	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	28	56	4,514
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	90	7,290
CAPITALAND MALL TRUST	31.5	79	6,367
SUNTEC REIT	26	47	3,837
MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST	37.6	88	7,117
シンガポール・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	153.6 5銘柄	363 <0.1%>
<b>(イギリス)</b>	千□	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	10.295	98	13,970
SEGRO PLC	13.286	118	16,817
BRITISH LAND CO PLC	14.58	83	11,882
イギリス・ポンド 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	38.161 3銘柄	301 <0.1%>
<b>ユーロ (フランス)</b>	千□	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.751	248	30,029
ICADE	0.406	36	4,457
GECINA SA	0.578	90	10,953
KLEPIERRE	2.394	77	9,423

銘柄	2019年12月2日現在		
	□ 数	価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
COVIVIO	千□	千ユーロ	千円
	0.353	35	4,283
ユ 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	5.482 5銘柄	489 <0.1%>
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	784.606 72銘柄	1,442,585 <2.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2019年12月2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12月2日現在		
	買 建 額	売 建 額	
外 国	百万円	百万円	
	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	1,293	-
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	151	-
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	50	-
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	114	-
	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	80	-
EURO STOXX 50 (ドイツ)	250	-	

(注1) 外貨建の評価額は、2019年12月2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いません。
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

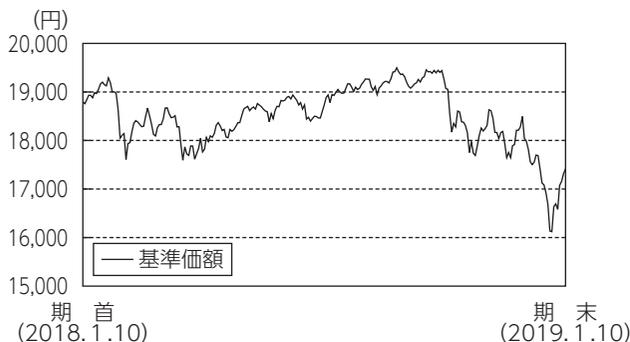
## 大和投資信託

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)		株組比率	株式比率	株先比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率					
(期首)2018年1月10日	18,797	-	15,025	-	93.4	3.9	0.0	2.4	
1月末	19,006	1.1	15,186	1.1	92.1	3.4	0.0	2.3	
2月末	18,507	△ 1.5	14,756	△ 1.8	91.8	3.6	0.0	2.2	
3月末	17,888	△ 4.8	14,237	△ 5.2	92.4	4.7	0.0	2.3	
4月末	18,225	△ 3.0	14,476	△ 3.7	96.0	4.1	0.0	2.4	
5月末	18,553	△ 1.3	14,680	△ 2.3	94.4	1.8	-	2.3	
6月末	18,450	△ 1.8	14,575	△ 3.0	97.0	2.0	-	2.5	
7月末	19,010	1.1	15,003	△ 0.1	95.5	2.5	-	2.4	
8月末	19,412	3.3	15,285	1.7	93.3	3.6	-	2.3	
9月末	19,444	3.4	15,284	1.7	95.5	5.0	-	2.3	
10月末	17,885	△ 4.9	14,056	△ 6.5	93.0	3.6	-	2.5	
11月末	18,210	△ 3.1	14,274	△ 5.0	91.5	6.8	-	2.5	
12月末	16,694	△ 11.2	13,075	△ 13.0	91.6	2.6	-	2.5	
(期末)2019年1月10日	17,415	△ 7.4	13,628	△ 9.3	90.1	6.6	-	2.4	

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

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：18,797円 期末：17,415円 騰落率：△7.4%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク(MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース))の動きに連動させることをめざして運用を行った結果、米中貿易摩擦が深刻化したことや米国の代表的銘柄であるアップルの業績下方修正などを嫌気し海外株式市況が下落したことから、基準価額は下落しました。

◆ 投資環境について

○ 海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は下落しました。

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2018年1月11日から2019年1月10日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	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・シケル 356 (△ 131)	百株 -	千イスラエル・シケル -
	スイス	百株 386.66 (20.67)	千スイス・フラン 2,529 (△ 45)	百株 9.46	千スイス・フラン 0
	デンマーク	百株 111.32 (-)	千デンマーク・クローネ 4,337 (-)	百株 81	千デンマーク・クローネ 724
国	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

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	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 -
国	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 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国		千口	千口	千口
アメリカ	(-)	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	口数	金額	口数	金額			
外	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 ( - )	千口 62.5 ( - )	千香港ドル 1,158 ( - )	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 ( - )
	オーストラリア	千口 62.5 ( - )	千香港ドル 1,158 ( - )	千口 18.5 ( - )	千シンガポール・ドル 49 (△ 0)	千口 6.058 ( - )	千イギリス・ポンド 32 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )
	香港	千口 18.5 ( - )	千シンガポール・ドル 49 (△ 0)	千口 6.058 ( - )	千イギリス・ポンド 32 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )
	シンガポール	千口 6.058 ( - )	千イギリス・ポンド 32 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )
	イギリス	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )
国	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	千口 1,634 ( - )	千ユーロ 155 ( - )	

(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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	13,331	11,936	-	-

(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	柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価
APPLE INC (アメリカ)		千株	千円	円	SHIRE PLC (ジャージー)		千株	千円	円
MICROSOFT CORP (アメリカ)		10.792	210,868	19,539	APPLE INC (アメリカ)		8.223	52,258	6,355
AMAZON.COM INC (アメリカ)		18.682	202,062	10,815	KEURIG DR PEPPER INC (アメリカ)		1.1	25,253	22,958
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)		1.113	197,298	177,267	RELX PLC (イギリス)		1.476	20,138	13,644
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)		6.646	123,757	18,621	LINDE PLC (アイルランド)		8.2	19,315	2,355
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)		6.895	100,938	14,639	OLD MUTUAL PLC (イギリス)		0.75	13,050	17,400
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)		8.128	100,261	12,335	MICROSOFT CORP (アメリカ)		41.479	12,644	304
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)		0.799	98,886	123,762	GKN PLC (イギリス)		1	10,945	10,945
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		11.288	96,881	8,582	THOMSON REUTERS CORP (カナダ)		15.154	10,601	699
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)		0.751	91,530	121,877	RANDGOLD RESOURCES LTD (ジャージー)		1.012	9,535	9,422

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	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 INC	—	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 INC	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
VR 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		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	
AVNET INC	11	—	—	—	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	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
LIFEPOINT HOTELS INC	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
CH. 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
RENAISSANCE 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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			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
WELL CARE 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		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
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		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
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
FREEMPORT-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		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			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 VTFG 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		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
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
AUTOMATION 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

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
SYMANTEC CORP	39.5	54	107	11,643	千円	千円	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	10.02	15.81	207	22,415	千円	千円	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	11	11	95	10,349	千円	千円	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13.23	16.05	477	51,683	千円	千円	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	20	28	116	12,605	千円	千円	不動産
TWITTER INC	38	57	183	19,888	千円	千円	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	69	89.27	406	43,934	千円	千円	公益事業
SYSCO CORP	37	43.92	274	29,688	千円	千円	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	19	24.82	294	31,868	千円	千円	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	10	46	5,080	千円	千円	金融
STERICYCLE INC	5	-	-	-	千円	千円	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	13	23	76	8,236	千円	千円	素材
SCHLUMBERGER LTD	93.93	135.88	560	60,626	千円	千円	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10.5	20.26	90	9,841	千円	千円	資本財・サービス
AT&T INC	419.7	685.37	2,062	223,192	千円	千円	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	9	17.58	86	9,334	千円	千円	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	-	36.27	64	6,988	千円	千円	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5.4	7.61	302	32,779	千円	千円	素材
SEMPRA ENERGY	17	27.68	311	33,666	千円	千円	公益事業
TIFFANY & CO	7.5	10.86	93	10,160	千円	千円	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	17	23.49	94	10,201	千円	千円	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	66.5	90.23	868	93,949	千円	千円	情報技術
SALESFORCE.COM INC	46	69.51	1,014	109,788	千円	千円	情報技術
WESTROCK CO	17.12	23.21	90	9,793	千円	千円	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	60.53	83.88	268	29,012	千円	千円	資本財・サービス
ANDEAVOR	10.5	-	-	-	千円	千円	その他
UNION PACIFIC CORP	56.5	69.85	1,050	113,628	千円	千円	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	61	102.44	164	17,810	千円	千円	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	35.5	60.83	390	42,264	千円	千円	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	52.5	78.79	861	93,187	千円	千円	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	49	64.48	631	68,309	千円	千円	資本財・サービス
UNUM GROUP	12	19	61	6,639	千円	千円	金融
SPRINT CORP	41.14	41.14	25	2,786	千円	千円	コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	10	10	10	1,137	千円	千円	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	9.53	14.32	174	18,926	千円	千円	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	11	18	75	8,196	千円	千円	金融
AMEREN CORPORATION	18.5	28.61	184	19,927	千円	千円	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	66.1	90.73	2,210	239,158	千円	千円	ヘルスケア
VERISIGN INC	7.5	10.85	168	18,269	千円	千円	情報技術
VALERO ENERGY CORP	30	38.82	300	32,461	千円	千円	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	3.3	4.8	134	14,602	千円	千円	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17.5	30.08	99	10,716	千円	千円	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6	9.92	123	13,341	千円	千円	ヘルスケア
ANTHEM INC	18	23.46	589	63,796	千円	千円	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	105	140.83	1,586	171,668	千円	千円	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	321.87	432.75	2,068	223,795	千円	千円	金融
WASTE MANAGEMENT INC	32	42.25	388	41,994	千円	千円	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	60	107.9	271	29,359	千円	千円	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10.5	10.5	88	9,612	千円	千円	一般消費財・サービス

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			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		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
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		
VWV 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		
KOHL'S 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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
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	<60.9%>		
(カナダ)	株数	株数	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		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・ドル	千円			
GREAT-WEST LIFE CO 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		
PENBINA 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 CORP	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		
ENCANNA 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		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・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 銘柄数<比率>	2,877.74 86銘柄	3,722.88 88銘柄	15,054 < 3.3%>	1,231,917		
(オーストラリア)	百株	百株	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

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千オーストラリア・ドル	千円			
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 銘柄数<比率>	4,563.08 52銘柄	6,373.33 55銘柄	10,253 < 2.2%>	795,707		
(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

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千香港ドル	千円		
WHEELOK & 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 総株数<比率>	7,477.59	8,782.23	32,921	454,316	
(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	
YANGZHIJIANG 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	
SEMPORCOR 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	

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
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 総株数<比率>	3,119	3,670	2,159	172,713	
(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 総株数<比率>	462.79	696.05	435	31,994	
(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	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千ドル			
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
ASHTREAD 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

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千ドル			
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			
	銘柄数<比率>	99銘柄	92銘柄	< 5.8%>			
(イスラエル)	株数	株数	千イスラエル・シケル	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・シケル 通貨計	株数・金額 257.48	370.26	1,254	37,007			
	銘柄数<比率>	7銘柄	7銘柄	< 0.1%>			
(スイス)	株数	株数	千スイス・フラン	千円			
DUFREY 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-GENUSSSCHEIN	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	千円		
			株数	金額					
SGS SA-REG	百株	百株	104	11,630	千スイス・フラン			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 銘柄数<比率>	1,180.73 36銘柄	1,578.6 38銘柄	10,114 1,123,608				< 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 銘柄数<比率>	398.18 18銘柄	428.5 17銘柄	14,913 249,656				< 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	

銘柄	期首		当		期		末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	千円		
			株数	金額					
EQUINOR ASA	76.17	111.21	2,163	27,621	千ノルウェー・ クローネ			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	
GENSIDIGE 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 銘柄数<比率>	404.12 9銘柄	570.99 10銘柄	7,996 102,118				< 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 HANDELSBANKENA 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	
LUNDBIN 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 銘柄数<比率>	1,627.18 31銘柄	2,469.2 32銘柄	31,367 382,991				< 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	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KINGSPAN GROUP PLC	百株	百株	千ユーロ	千円	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	12.66	17.12	61	7,672	生活必需品
CRH PLC	50.5	65	158	19,859	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 銘柄数<比率>	210.1 5銘柄	319.3 7銘柄	579 < 0.2%>	72,416
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 銘柄数<比率>	1,381.16 25銘柄	1,820.89 23銘柄	4,194 < 1.4%>	524,257
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 IN BEV 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 銘柄数<比率>	134.43 10銘柄	180.18 10銘柄	985 < 0.3%>	123,206
ユーロ (ルクセンブルク)	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ARCELORMITTAL	百株	百株	千ユーロ	千円	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	43.44	53.27	104	13,072	ヘルスケア
SES	0.6	1.31	46	5,793	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	19	44.02	75	9,450	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	88.54 5銘柄	229.52 6銘柄	351 < 0.1%>	43,969
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		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千ユーロ	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 銘柄数<比率>	1,864.05 70銘柄	2,450.52 68銘柄	10,241 < 3.5%>	1,280,207		
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		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千ユーロ	千円			
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 -PRF	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 & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	17.66	22.71	136	17,123	ヘルスケア		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	66.01	80.1	391	48,976	一般消費財・サービス		
HANNOVER RUECK SE	84.23	130.44	237	29,650	情報技術		
DEUTSCHE POST AG-REG	3.5	6.44	77	9,684	金融		
DEUTSCHE BOERSE AG	66.98	89.74	227	28,447	資本財・サービス		
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	12.74	18.97	204	25,585	金融		
LANXESS AG	15.6	15.6	24	3,092	コミュニケーション・サービス		
MITU AERO ENGINES AG	6	6	26	3,348	素材		
AXEL SPRINGER SE	4	4	67	8,470	資本財・サービス		
DEUTSCHE WOHNEN SE	4.7	4.7	24	3,113	コミュニケーション・サービス		
SYMRISE AG	23.63	32.85	136	17,045	不動産		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	8.3	14.36	98	12,356	素材		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62.4	62.4	20	2,510	コミュニケーション・サービス		
HUGO BOSS AG -ORD	2.5	2.5	15	1,981	一般消費財・サービス		
VONOVIA SE	3.5	8.11	47	5,975	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,659.15 60銘柄	2,256 61銘柄	9,056 < 3.1%>	1,132,071		

# 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	
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 総額数<比率>	195.09 340.85	168 21,046	< 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 ARGENTIA	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 総額数<比率>	3,393.4 5,226.29	3,209 401,140	< 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

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	
TERNA SPA	百株	百株	千ユーロ	千円	
	99	199	102	12,840	公益事業
国 小 計	株数、金額 総額数<比率>	4,022.94 18銘柄	4,913.99 18銘柄	1,964 < 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 総額数<比率>	587.27 12銘柄	863.72 12銘柄	1,173 < 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 総額数<比率>	56.59 5銘柄	87.09 6銘柄	287 < 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 総額数<比率>	64 1銘柄	-	-	< - >
ユーロ通貨計	株数、金額 総額数<比率>	13,656.72 237銘柄	18,688.35 237銘柄	32,211 < 10.9% >	
ファンド合計	株数、金額 総額数<比率>	77,886.52 1,242銘柄	103,430.96 1,236銘柄	33,270,926 < 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)				
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
	70	-	-	-
合 計	口数、金額 総額数<比率>	70 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。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.872	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	□数、金額 銘柄数<比率>	87,951 40銘柄	107,467 39銘柄	6,334 <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	□数、金額 銘柄数<比率>	3.4 2銘柄	3.4 2銘柄	76 <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
LENLEASE GROUP	4.303	4.303	51	3,980

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額 千オーストラリア・ドル	邦貨換算金額 千円
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	□数、金額 銘柄数<比率>	184,319 12銘柄	191,828 11銘柄	1,139 <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	□数、金額 銘柄数<比率>	47.5 2銘柄	110 3銘柄	2,739 <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	□数、金額 銘柄数<比率>	75 4銘柄	93.5 4銘柄	200 <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	□数、金額 銘柄数<比率>	21,928 4銘柄	27,986 4銘柄	147 <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	□数、金額 銘柄数<比率>	3,102 5銘柄	4,736 5銘柄	343 <0.1%>
合計	□数、金額 銘柄数<比率>	423.2 69銘柄	538,917 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ある。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外 S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	1,564	-
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	144	-
SP1 200 FUTURES (オーストラリア)	88	-
FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	180	-
国 SWISS MKT IX FUTR (スイス)	95	-
EURO STOXX 50 (ドイツ)	348	-

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	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、i Free 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)

## 運用報告書 (全体版) 第3期

(決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日~2019年12月2日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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			株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 信 託 証 券 率 組 入 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率				
1 期末(2017年11月30日)	円 11,391	円 0	% 13.9	% 93.0	% 1.5	% 4.5	百万円 915
2 期末(2018年11月30日)	11,550	0	1.4	92.1	2.0	5.0	1,637
3 期末(2019年12月 2 日)	12,622	0	9.3	90.2	5.5	3.4	1,845

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

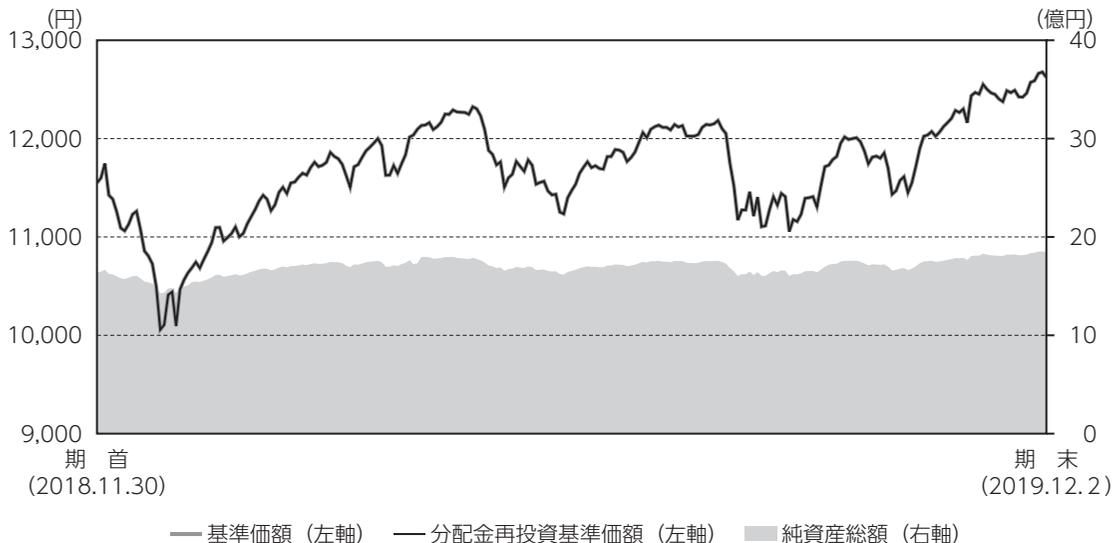
(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：11,550円

期末：12,622円（分配金0円）

騰落率：9.3%（分配金込み）

#### ■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国株式インデックスマザーファンド	11.9%	80.0%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	1.3%	19.3%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

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

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

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 信 組 託 入 証 比	資 券 率
	騰 落 率	騰 落 率				
(期首) 2018年11月30日	円 11,550	% -	% 92.1	% 2.0	% 5.0	% 5.0
12月末	10,441	△9.6	92.5	1.1	5.4	5.4
2019年 1 月末	11,134	△3.6	92.7	1.1	5.2	5.2
2 月末	11,729	1.5	92.8	1.0	5.2	5.2
3 月末	11,744	1.7	95.1	1.5	2.6	2.6
4 月末	12,231	5.9	95.6	0.9	2.7	2.7
5 月末	11,434	△1.0	94.2	1.1	3.7	3.7
6 月末	11,863	2.7	93.5	1.5	4.2	4.2
7 月末	12,102	4.8	93.0	1.5	4.7	4.7
8 月末	11,393	△1.4	94.7	1.9	2.5	2.5
9 月末	11,801	2.2	94.9	1.2	3.0	3.0
10月末	12,301	6.5	90.8	5.1	3.3	3.3
11月末	12,677	9.8	90.2	5.5	3.4	3.4
(期末) 2019年12月 2 日	12,622	9.3	90.2	5.5	3.4	3.4

(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**

(2018.12.1～2019.12.2)

**■先進国株式市況**

米国・欧州を中心とする先進国株式市況は上昇しました。

先進国株式市況は、当作成期首より、米中関係悪化への懸念が高まったことや、米国債券市場において景気後退の予兆とされる長短金利の逆転現象が見られたことなどを受け、下落して始まりました。2019年1月以降は、米中通商協議の進展期待や米国企業を中心とした良好な1-3月決算の発表などを好感し、上昇しました。5月からは、米中関係の緊張が続いたことや世界的な景気減速懸念などを嫌気し、下落しました。6月以降は、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。当作成期末にかけては、再度米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。

**■先進国為替相場**

為替相場は、当作成期を通してみると円高となりました。

当作成期首より、株価や原油価格が下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。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。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、円安傾向となりました。

**■新興国株式市況**

新興国株式市況は、米中貿易摩擦などの悪材料はありましたが、全体としては上昇基調でした。

新興国株式市況は、2018年12月に中国大手通信機器メーカーの幹部拘束による米中対立の激化が悪材料となり、幅広く売られる展開となりました。2019年に入ると、FRB（米国連邦準備制度理事会）の利上げ終了見通しが強まったことで新興国への資金流入が進んだことや米中通商協議に対する期待の高まりから、新興国株式市況は上昇しました。しかし5月以降は、米中貿易摩擦の急激な激化と長期化が懸念材料となったことで、新興国株式市況は軟調な展開となりました。当作成期末にかけては、米中の次官級通商協議等の動きを受けて米中貿易摩擦への懸念が後退したことやFRBの利下げが好感されて、新興国株式市況は全体的に買われました。

国別では、中国株式市場は、政府主導の景気対策期待が好材料となった上、MSCI等でインデックスの組入比率が引き上げられることを見通した海外からの資金流入もあり、堅調でした。個人消費が底堅く大手エネルギー会社の大幅増配なども好感されたロシア株式市場や、新政権の政策期待からブラジル株式市場も上昇しました。台湾市場も、好決算を受けてハイテク株を中心に買われました。一方、景気悪化懸念が強まったマレーシア株式市場は軟調でした。

## ■新興国為替相場

新興国通貨の為替相場は、米中貿易摩擦の激化などから新興国からの資金流出が進んだことにより、全体としては対米ドルで下落しました。

通貨別では、経常赤字の拡大や労働組合の抗議運動などが嫌気された南アフリカ・ランド、経済政策に対する懸念で資金流出が進んだトルコ・リラ、燃料価格の上昇に端を発したトラック運転手のストなどによる経済的混乱が悪材料となったブラジル・レアルが売られました。一方、経常収支の黒字拡大を受けてタイ・バーツが買われました。

なお、円はリスク回避の動きや世界的な貿易摩擦懸念を受けて、対米ドルで当作成期を通じてやや円高となり、新興国通貨全体としては対円でも下落となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックスマザーファンド

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

### ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

（2018.12.1～2019.12.2）

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

### ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

株式組入比率（D R（預託証券）、E T F（上場投資信託証券）、株価指数先物を含む。以下同じ。）は、ベンチマークのリバランス時や大量設定時を除き、当作成期を通じて原則として98%以上で運用を行いました。

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

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

## ベンチマークとの差異について

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

## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ～2019年12月2日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（%）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,622

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックスマザーファンド

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

### ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2018.12.1~2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	40円	0.343%	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11,694円です。
(投 信 会 社)	(31)	(0.267)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	2	0.018	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(1)	(0.012)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.004)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0.013	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(2)	(0.013)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	8	0.067	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)	(0.054)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(1)	(0.007)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	52	0.441	

(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。

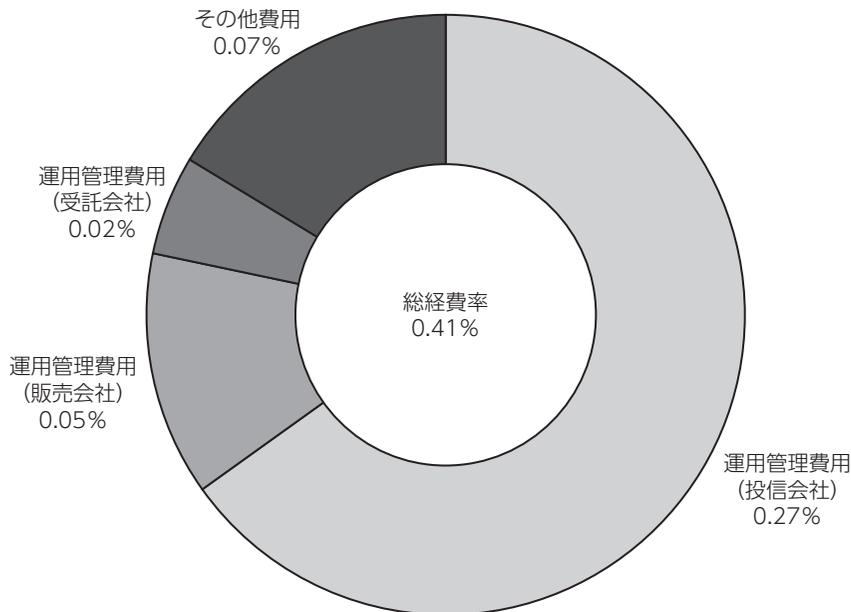
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.41%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

項目	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデック ス・マザーファンド	45,696	70,540	30,342	48,040
外国株式インデック スマザーファンド	84,128	206,510	75,302	191,060

(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12月1日から2019年12月2日まで)

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,619,829千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,480,290千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.55
	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	19,867,583千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	109,147,375千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.18

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	209,548	224,901	355,367			
外国株式インデックスマザーファンド	529,688	538,513	1,475,526			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	355,367	19.2
外国株式インデックスマザーファンド	1,475,526	79.7
コール・ローン等、その他	20,387	1.1
投資信託財産総額	1,851,281	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1香港ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=80.21円、1ニュージーランド・ドル=70.63円、1台湾ドル=3.59円、1イギリス・ポンド=141.59円、1イスラエル・シケル=31.56円、1スイス・フラン=109.59円、1トルコ・リラ=19.09円、1デンマーク・クローネ=16.17円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローネ=11.46円、1メキシコ・ペソ=5.61円、100チリ・ペソ=13.55円、1インド・ルピー=1.54円、100インドネシア・ルピア=0.78円、1ブラジル・リアル=25.88円、1マレーシア・リンギット=26.24円、1南アフリカ・ランド=7.50円、1タイ・バーツ=3.63円、1ユーロ=120.86円です。

(注3) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(8,232,358千円)の投資信託財産総額(8,268,757千円)に対する比率は、99.6%です。外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(127,572,094千円)の投資信託財産総額(134,104,169千円)に対する比率は、95.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,851,281,887円
コール・ローン等	20,237,588
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド(評価額)	355,367,340
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,475,526,959
未収入金	150,000
(B) 負債	5,826,618
未払解約金	2,788,039
未払信託報酬	2,990,623
その他未払費用	47,956
(C) 純資産総額(A - B)	1,845,455,269
元本	1,462,100,428
次期繰越損益金	383,354,841
(D) 受益権総口数	1,462,100,428口
1万口当り基準価額(C / D)	12,622円

\* 期首における元本額は1,417,526,848円、当作成期間中における追加設定元本額は481,206,327円、同解約元本額は436,632,747円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,622円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 10,247円
受取利息	1,612
支払利息	△ 11,859
(B) 有価証券売買損益	157,885,363
売買益	174,323,240
売買損	△ 16,437,877
(C) 信託報酬等	△ 5,908,956
(D) 当期損益金(A + B + C)	151,966,160
(E) 前期繰越損益金	44,099,059
(F) 追加信託差損益金	187,289,622
(配当等相当額)	( 79,867,426)
(売買損益相当額)	( 107,422,196)
(G) 合計(D + E + F)	383,354,841
次期繰越損益金(G)	383,354,841
追加信託差損益金	187,289,622
(配当等相当額)	( 79,867,426)
(売買損益相当額)	( 107,422,196)
分配準備積立金	196,075,466
繰越損益金	△ 10,247

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	151,969,731
(c) 収益調整金	187,289,622
(d) 分配準備積立金	44,105,735
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	383,365,088
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	383,365,088
(h) 受益権総口数	1,462,100,428口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2019年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2019年12月2日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(1) 株 式

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

買				付				売				付			
銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	
		千株	千円	円			千株	千円	円			千株	千円	円	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)		1,455	131,163	90	LENOVO GROUP LTD (香港)		428	41,580	97						
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)		119	103,787	872	GAZPROM PJSC-SPON ADR (ロシア)		78.05	40,243	515						
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)		1,304	101,170	77	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)		82	20,700	252						
BANK OF CHINA LTD-H (中国)		1,434	67,365	46	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN (ポーランド)		6.19	18,300	2,956						
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島)		3.2	62,250	19,453	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)		22.3	17,776	797						
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR (ロシア)		38.03	53,244	1,400	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF (ブラジル)		39.3	16,388	417						
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)		9.4	46,245	4,919	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)		17.5	15,359	877						
VALE SA (ブラジル)		35.3	45,545	1,290	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE (ポーランド)		12.26	14,875	1,213						
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)		36.5	44,820	1,227	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT (台湾)		64.964	14,633	225						
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)		530	41,340	78	CNOOC LTD (香港)		70	13,972	199						

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

買				付				売				付			
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価	
		千口	千円	円			千口	千円	円			千口	千円	円	
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)		813	1,835,813	2,258	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)		992	2,201,617	2,219						
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)		41.63	7,332	176											
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)		41.6	6,228	149											
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI (トルコ)		171.87	5,788	33											
REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)		43.21	3,201	74											

(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12月2日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド(5,229,878千口)の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	柄	2019年12月2日現在		業種等
		株数	評価額	
			外貨建金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SURGUTNEFTGAS-SP ADR PREF	164	92	10,130	エネルギー
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	41	820	89,937	一般消費財・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	24	284	31,200	コミュニケーション・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	120	153	16,820	一般消費財・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	264.5	249	27,385	コミュニケーション・サービス
JD.COM INC-ADR	97	316	34,736	一般消費財・サービス
NETEASE INC-ADR	6	189	20,750	コミュニケーション・サービス
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	45	149	16,405	一般消費財・サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S	893.06	123	13,517	金融

銘柄	柄	2019年12月2日現在		業種等
		株数	評価額	
			外貨建金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	30.9	62	6,825	素材
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	48.2	332	36,456	エネルギー
SURGUTNEFTGAS-SP ADR	296	200	21,995	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	129.7	340	37,341	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	187	213	23,412	生活必需品
RUSHYDRO PJSC-ADR	982.45	77	8,491	公益事業
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	799.6	1,169	128,305	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	11	217	23,888	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	186.9	1,782	195,480	エネルギー

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在			業種等
	株数	評価額	金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ROSNET OIL CO PJSC-REGS GDR	582.8	395	43,338	エネルギー
GAZPROM PJSC-SPON ADR	2,268.7	1,802	197,671	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S	86	120	13,252	素材
TATNEFT PJSC - PREF	45.4	48	5,355	エネルギー
ALROSA PJSC	791.6	96	10,544	素材
MOSCOW EXCHANGE MICEXRXTS PJ	660.09	108	11,930	金融
AEROFLOT PJSC	580.6	93	10,210	資本財・サービス
アメリカ・ドル 通貨計	9,341.5 25銘柄	9,440	1,035,386 <12.5%>	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,190	961	13,470	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,060	943	13,218	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	240	292	4,095	資本財・サービス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	160	344	4,830	情報技術
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	640	936	13,126	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	410	242	3,400	資本財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	200	820	11,488	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	600	541	7,590	素材
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	15,578	6,838	95,810	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	155	536	7,513	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,060	797	11,167	一般消費財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERV-H	560	295	4,134	資本財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	135	411	5,759	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	825	869	12,182	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	152	5,043	70,657	コミュニケーション・サービス
CHINA TELECOM CORP LTD-H	5,580	1,651	23,140	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H	420	299	4,189	資本財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	2,600	1,742	24,405	コミュニケーション・サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	505	1,431	20,057	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	1,920	998	13,987	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	800	814	11,409	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	8,280	2,989	41,877	エネルギー
CNOOC LTD	4,800	5,452	76,393	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	640	364	5,110	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	2,360	915	12,828	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	215	1,076	15,075	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	840	356	4,989	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	37,190	23,169	324,602	金融
CHINA MOBILE LTD	1,575	9,292	130,187	コミュニケーション・サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	436	789	11,056	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	4,080	1,746	24,464	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	306	256	3,592	金融
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	4,570	520	7,298	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	140	723	10,140	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHIH	2,020	1,026	14,376	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,345	2,039	28,566	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	220	392	5,492	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	352	909	12,747	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	640	2,166	30,351	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	190	413	5,789	一般消費財・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	580	401	5,623	エネルギー
BYD CO LTD-H	80	297	4,163	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	11,990	3,800	53,249	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE CH	210	633	8,870	金融
PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	2,490	781	10,953	金融
CITIC LTD	1,570	1,538	21,555	資本財・サービス

銘柄	2019年12月2日現在			業種等
	株数	評価額	金額	
	百株	千香港ドル	千円	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMEN-H	2,150	350	4,909	金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	30,000	16,740	234,527	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,960	793	11,118	コミュニケーション・サービス
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	740	239	3,348	素材
GUANGDONG INVESTMENT LTD	420	679	9,520	公益事業
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	940	2,467	34,569	不動産
CRRC CORP LTD - H	640	329	4,617	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	2,100	1,278	17,917	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,850	362	5,080	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	770	6,829	95,686	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	270	1,030	14,431	不動産
BAIC MOTOR CORP LTD-H	680	298	4,182	一般消費財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	3,120.8	1,700	23,828	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,490	1,624	22,753	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	80	588	8,249	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	327	958	13,423	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	920	199	2,796	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	380	317	4,450	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	40	412	5,783	一般消費財・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,480	2,246	31,478	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,420	859	12,035	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	590	789	11,059	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,880	451	6,321	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	584	1,617	22,663	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	244	342	4,799	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,520	3,006	42,121	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	100	850	11,908	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	380	302	4,243	素材
KUNLUN ENERGY CO LTD	980	649	9,102	公益事業
GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H	664	873	12,242	不動産
CHINA OILFIELD SERVICES-H	440	463	6,497	エネルギー
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,140	334	4,679	資本財・サービス
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	460	283	3,976	資本財・サービス
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,380	1,799	25,207	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3,441	1,768	24,779	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	490	915	12,823	不動産
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	720	789	11,055	不動産
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	4,650	106	1,491	情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H	915	3,385	47,430	金融
BANK OF CHINA LTD-H	36,210	11,369	159,292	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	305	443	6,213	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,140	385	5,398	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	968	756	10,605	金融
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	670	266	3,735	金融
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	365	1,169	16,389	不動産
香港ドル 通貨計	239,922.8 91銘柄	162,294	2,273,747 <27.5%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
YANGZHUANG SHIPBUILDING	477	49	3,940	資本財・サービス
シンガポール・ドル 通貨計	477 1銘柄	49	3,940 <0.0%>	
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	160	1,342	4,819	情報技術
TAIWAN CEMENT	1,262.32	5,226	18,761	素材
ASIA CEMENT CORP	740	3,363	12,074	素材
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	801.12	5,808	20,851	生活必需品

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
FORMOSA PLASTICS CORP	676	千台湾ドル	千円	23,588	素材
NAN YA PLASTICS CORP	601.4	4,300	15,437	素材	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	6033.9	5,272	18,926	素材	
WALSIN LIHWA CORP	930	1,320	4,740	資本財・サービス	
CHINA STEEL CORP	1,666.86	3,900	14,002	素材	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	826.16	3,998	14,355	情報技術	
DELTA ELECTRONICS INC	410	5,740	20,606	情報技術	
ACER INC	930	1,669	5,992	情報技術	
INVENTEC CORP	670	1,530	5,496	情報技術	
TATUNG CO LTD	550	1,212	4,353	一般消費財・サービス	
QUANTA COMPUTER INC	740	4,462	16,019	情報技術	
AU OPTRONICS CORP	3,780	3,318	11,914	情報技術	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	804	9,085	32,615	コミュニケーション・サービス	
MEDIA TEK INC	380.03	16,018	57,505	情報技術	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	210	5,239	18,809	情報技術	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	611.87	1,551	5,568	金融	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,384.11	6,200	22,260	金融	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,848.38	7,707	27,670	金融	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,620	2,544	9,133	金融	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,780.27	4,815	17,288	金融	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,158.28	4,262	15,302	金融	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,849.93	5,605	20,122	金融	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,567.68	2,233	8,019	金融	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	4,631.39	4,654	16,709	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,850.28	6,227	22,358	金融	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,361.72	3,125	11,219	金融	
LARGAN PRECISION CO LTD	10	4,435	15,921	情報技術	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	100	2,235	8,023	情報技術	
TAIWAN MOBILE CO LTD	310	3,549	12,742	コミュニケーション・サービス	
WISTRON CORP	621.1	1,720	6,176	情報技術	
INNOLUX CORP	3,360	2,654	9,529	情報技術	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	230	1,681	6,035	コミュニケーション・サービス	
PEGATRON CORP	630	4,284	15,379	情報技術	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	146.46	1,999	7,177	金融	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	636.54	1,320	4,741	金融	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	214	2,013	7,229	情報技術	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	300	2,880	10,339	エネルギー	
POU CHEN	374.4	1,488	5,342	一般消費財・サービス	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,120	95,160	341,624	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,629.02	23,266	83,527	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	110	3,360	12,064	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	147.6	3,402	12,213	情報技術	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,040	3,094	11,107	資本財・サービス	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	5,310	7,938	28,499	情報技術	
台湾ドル 通貨計	58,694.82	304,791	1,094,201	<13.2%>	
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円		
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,147.6	1,159	22,126	金融	
AKBANK T.A.S.	1,492.72	1,159	22,141	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	1,271	781	14,921	金融	
TURK CELL ILETISIM HIZMET AS	558.1	756	14,446	コミュニケーション・サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	55.8	691	13,198	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	507.91	407	7,776	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	803.9	731	13,965	金融	
TURKIYE HALK BANKASI	1,002.5	578	11,042	金融	
YAPI VE KREDI BANKASI	1,075.6	258	4,927	金融	

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	795.1	千トルコ・リラ	千円	7,786	金融
KOC HOLDING AS	446.75	407	17,073	資本財・サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	489.2	668	12,756	資本財・サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	68.8	316	6,041	生活必需品	
トルコ・リラ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	9,714.98	8,811	168,206	<2.0%>
(メキシコ)	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	108	1,211	6,794	生活必需品	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	9,230	13,845	77,670	コミュニケーション・サービス	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	719	3,059	17,162	コミュニケーション・サービス	
CEMEX SAB-CPO	8,793.19	6,287	35,270	素材	
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO	371	6,584	36,939	生活必需品	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	296.23	1,264	7,092	素材	
ALFA S.A.B.-A	1,067	1,638	9,194	資本財・サービス	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	863	4,408	24,730	素材	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	956	5,208	29,218	生活必需品	
GRUPO FINANCIERO BANORTE CO	573	5,898	33,090	金融	
メキシコ・ペソ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	22,976.42	49,405	277,164	<3.4%>
(チリ)	百株	千チリ・ペソ	千円		
ENEL CHILE SA	4,877.97	29,458	3,991	公益事業	
LATAM AIRLINES GROUP SA	99.7	84,236	11,414	資本財・サービス	
CENCOSUD SA	578.5	59,296	8,034	生活必需品	
BANCO SANTANDER CHILE	9,830.9	42,243	5,723	金融	
ENEL AMERICAS SA	7,007.93	108,230	14,665	公益事業	
EMPRESAS CMPC SA	168.8	29,455	3,991	素材	
S.A.C.I. FALABELLA	131.5	42,473	5,755	一般消費財・サービス	
EMPRESAS COPEC SA	46.3	29,632	4,015	エネルギー	
BANCO DE CHILE	3,966.92	32,409	4,391	金融	
チリ・ペソ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	26,708.52	457,435	61,982	<0.8%>
(インド)	百株	千インド・ルピー	千円		
TATA STEEL LTD	121.5	5,194	7,998	素材	
AXIS BANK LTD	221.8	16,392	25,243	金融	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11.8	8,550	13,167	一般消費財・サービス	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	24.9	5,067	7,804	生活必需品	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	551.9	15,596	24,018	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	634.6	21,693	33,408	金融	
NTPC LTD	818	9,517	14,656	公益事業	
POWER FINANCE CORPORATION	305.8	3,501	5,392	金融	
JSW STEEL LTD	305.6	7,992	12,309	素材	
INDIAN OIL CORP LTD	1,304.9	17,146	26,405	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	532.35	27,232	41,937	エネルギー	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	237.9	628	967	公益事業	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	30.5	3,437	5,294	金融	
TECH MAHINDRA LTD	42.2	3,213	4,948	情報技術	
YES BANK LTD	235.2	1,606	2,473	金融	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	318.2	2,270	3,496	一般消費財・サービス	
REC LTD	458.7	6,325	9,741	金融	
COAL INDIA LTD	470	9,646	14,855	エネルギー	
BHARTI INFRA TEL LTD	114.4	3,160	4,867	コミュニケーション・サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	79	2,294	3,534	金融	
GAIL INDIA LTD	209.06	2,635	4,058	公益事業	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	478.1	9,569	14,736	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	106.8	8,405	12,944	素材	
WIPRO LTD	136.53	3,245	4,997	情報技術	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千円	千円		
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	72.86	14,959	23,038	情報技術	
INFOSYS LTD	433.6	30,193	46,498	情報技術	
LARSEN & TOUBRO LTD	55.72	7,413	11,417	資本財・サービス	
TATA MOTORS LTD	1,066.8	17,228	26,532	一般消費財・サービス	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	151.7	34,849	53,667	金融	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	385.7	59,827	92,134	エネルギー	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	890.35	11,730	18,064	エネルギー	
ITC LTD	311	7,663	11,801	生活必需品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	134.9	7,157	11,021	一般消費財・サービス	
HERO MOTOCORP LTD	22.4	5,451	8,394	一般消費財・サービス	
BHARTI AIRTEL LTD	386.22	17,088	26,315	コミュニケーション・サービス	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	152.4	6,855	10,557	ヘルスケア	
HCL TECHNOLOGIES LTD	75.7	8,536	13,145	情報技術	
VEDANTA LTD	1,035.7	14,976	23,063	素材	
インド・ルビー	株数、金額	438,256	674,915		
通貨計	銘柄数<比率>	38銘柄	< 8.2%>		
(インドネシア)	百株	千円	千円		
UNITED TRACTORS TBK PT	284	594,270	4,635	エネルギー	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,891	2,529,150	19,727	一般消費財・サービス	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	470	538,150	4,197	素材	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	770	612,150	4,774	生活必需品	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	9,727	3,822,711	29,817	コミュニケーション・サービス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,727	1,295,250	10,102	金融	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	661	2,075,540	16,189	金融	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,653	2,547,967	19,874	金融	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	3,015	578,880	4,515	公益事業	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	8,076	3,303,084	25,764	金融	
ADARO ENERGY TBK PT	4,729	581,667	4,537	エネルギー	
インドネシア・ルビー	株数、金額	184,788,819	144,134		
通貨計	銘柄数<比率>	11銘柄	< 1.7%>		
(ブラジル)	百株	千円	千円		
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	12	80	2,080	公益事業	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	51	189	4,900	金融	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	63	442	11,453	金融	
CIA DE SAANEAMENTO DO PA-UNIT	16	146	3,801	公益事業	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	177	503	13,027	一般消費財・サービス	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	1,024	2,984	77,250	エネルギー	
BANCO BRADESCO SA-PREF	943.6	3,148	81,490	金融	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	1,286.36	4,476	115,852	金融	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	304	381	9,881	素材	
VALE SA	968.9	4,842	125,325	素材	
GERDAU SA-PREF	418	710	18,390	素材	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	781	2,436	63,062	エネルギー	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	478.97	625	16,176	公益事業	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	461.41	612	15,846	金融	
BRASKEM SA-PREF A	50	139	3,621	素材	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	48	172	4,463	公益事業	
BANCO DO BRASIL S.A.	453	2,165	56,500	金融	
COSAN SA	40	248	6,428	エネルギー	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	94	327	8,473	公益事業	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	78	493	12,767	公益事業	
EMBRAER SA	282	507	13,136	資本財・サービス	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	855	666	17,259	素材	
CCR SA	311	534	13,835	資本財・サービス	
BRF SA	294	1,076	27,847	生活必需品	
CIA SAANEAMENTO BASICO DE SP	96	551	14,260	公益事業	

銘柄	2019年12月2日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千円	千円		
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	77	231	5,986	公益事業	
TIM PARTICIPACOES SA	288.26	390	10,101	コミュニケーション・サービス	
TELEFONICA BRASIL SA-PREF	141	793	20,526	コミュニケーション・サービス	
LOJAS RENNER S.A.	50.05	259	6,709	一般消費財・サービス	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	85	189	4,901	一般消費財・サービス	
JBS SA	596	1,697	43,928	生活必需品	
SUZANO SA	42.45	163	4,236	素材	
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	70	140	3,646	金融	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	79	157	4,066	公益事業	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	189	901	23,341	金融	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	141.08	219	5,684	不動産	
CIELO SA	493.28	384	9,957	情報技術	
HYPERA SA	53	176	4,567	ヘルスケア	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	57	456	11,824	生活必需品	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	90	185	4,807	公益事業	
SUL AMERICA SA - UNITS	45	239	6,194	金融	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	32	46	1,212	公益事業	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	107	471	12,211	金融	
KLABIN SA - UNIT	98	173	4,494	素材	
LOJAPAR PARTICIPACOES SA	363	791	20,489	エネルギー	
ULTRAS AMERICANAS SA	96	158	4,091	一般消費財・サービス	
COGNA EDUCACAO	415	425	11,008	一般消費財・サービス	
BANCO BRADESCO S.A.	244.65	764	19,786	金融	
AMBEV SA	786	1,418	36,716	生活必需品	
ブラジル・レアル	株数、金額	14,225.01	39,303	1,017,178	
通貨計	銘柄数<比率>	49銘柄	< 12.3%>		
(マレーシア)	百株	千円	千円		
MALAYAN BANKING BHD	776	661	17,368	金融	
GENTING BHD	633	369	9,683	一般消費財・サービス	
PUBLIC BANK BERHAD	415	814	21,365	金融	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	542	382	10,040	素材	
GENTING MALAYSIA BHD	675	211	5,561	一般消費財・サービス	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	955	494	12,980	金融	
TENAGA NASIONAL BHD	542	713	18,716	公益事業	
PETRONAS GAS BHD	103	159	4,189	公益事業	
SAPURA ENERGY BHD	6,928	190	4,999	エネルギー	
マレーシア・リンギット	株数、金額	11,569	3,997	104,905	
通貨計	銘柄数<比率>	9銘柄	< 1.3%>		
(南アフリカ)	百株	千円	千円		
GOLD FIELDS LTD	304.6	2,343	17,579	素材	
NEPI ROCKCASTLE PLC	49	607	4,557	不動産	
OLD MUTUAL LTD	915.3	1,696	12,727	金融	
VODACOM GROUP LTD	197.7	2,394	17,959	コミュニケーション・サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	129.9	1,664	12,485	生活必需品	
NEDBANK GROUP LTD	119	2,606	19,545	金融	
BIDVEST GROUP LTD	77.6	1,575	11,812	資本財・サービス	
BID CORP LTD	64.5	2,080	15,607	生活必需品	
NETCARE LTD	329.3	658	4,939	ヘルスケア	
STANDARD BANK GROUP LTD	364.2	6,036	45,271	金融	
SASOL LTD	185.3	4,891	36,689	素材	
REMGRO LTD	99.3	1,908	14,314	金融	
EXXARO RESOURCES LTD	46	613	4,599	エネルギー	
PICK N PAY STORES LTD	85.7	581	4,362	生活必需品	
TRUWORTH INTERNATIONAL LTD	96.4	492	3,694	一般消費財・サービス	
SANLAM LTD	384.9	2,941	22,057	金融	

銘柄	2019年12月2日現在			業種等
	株数	評価額	業種等	
TIGER BRANDS LTD	百株 31.8	千南アフリカ・ランド 649	千円 4,872	生活必需品
FIRSTSTRAND LTD	662.9	4,151	31,133	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	353.1	1,842	13,818	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	43.3	671	5,039	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	301.4	4,438	33,288	金融
NASPERS LTD-N SHS	23.69	4,962	37,220	一般消費財・サービス
INVESTEC LTD	69.9	588	4,414	金融
MTN GROUP LTD	658.8	6,085	45,640	コミュニケーション・サービス
INPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	193.3	2,176	16,324	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	70.3	825	6,189	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	70.8	1,940	14,553	素材
BARLOWORLD LTD	60.7	691	5,183	資本財・サービス
SAPPI LIMITED	157.1	626	4,695	素材
TELKOM SA SOC LTD	156.3	732	5,496	コミュニケーション・サービス
SPAR GROUP LIMITED/THE	69.3	1,427	10,702	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	31.9	558	4,186	一般消費財・サービス
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	276.4	683	5,124	ヘルスケア
SIBANYE GOLD LTD	762.3	2,201	16,511	素材
南アフリカ・ランド 通貨計	株数、金額 7,441.99 34銘柄	68,346	512,600 < 6.2%>	
(タイ)	百株	千タイ・バーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	102	1,810	6,572	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	202	7,696	27,937	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	160	2,480	9,002	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	78	1,209	4,388	金融
SIAM COMMERCIAL BANK PAVDR	688	8,324	30,219	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	302	1,683	6,111	金融
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	248	5,257	19,085	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,248	3,686	13,382	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,233	1,430	5,191	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	384	4,608	16,727	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	2,843	995	3,612	エネルギー
PTT PCL-NVDR	4,651	20,115	73,019	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	471	3,249	11,797	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	527	4,005	14,538	生活必需品
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,316	3,619	13,136	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	768	4,128	14,984	素材
タイ・バーツ 通貨計	株数、金額 16,221 16銘柄	74,299	269,707 < 3.3%>	
ファンド合計	株数、金額 354銘柄	467,220.83	7,638,071 < 92.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年12月2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	株数	2019年12月2日現在	
		評価額	業種等
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	209	4,355	477,717
通貨計	口数、金額 209 1銘柄	4,355	477,717 < 5.8%>
(トルコ)	千口	千トルコ・リラ	千円
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	171.87	250	4,790
通貨計	口数、金額 171.87 1銘柄	250	4,790 < 0.1%>
(メキシコ)	千口	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	88.4	2,640	14,813
通貨計	口数、金額 88.4 1銘柄	2,640	14,813 < 0.2%>
(南アフリカ)	千口	千南アフリカ・ランド	千円
REDEFINE PROPERTIES LTD	105	864	6,481
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	76.93	1,754	13,160
南アフリカ・ランド 通貨計	口数、金額 181.93 2銘柄	2,618	19,641 < 0.2%>
合計	口数、金額 5銘柄	651.2	516,963 < 6.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、2019年12月2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12月2日現在	
	買建額	売建額
外国	百万円	百万円
MSCI EMGMKT(アメリカ)	96	-

(注1) 外貨建の評価額は、2019年12月2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20期 (決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2日)

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式（預託証券を含みます。）
株式組入制限	無制限

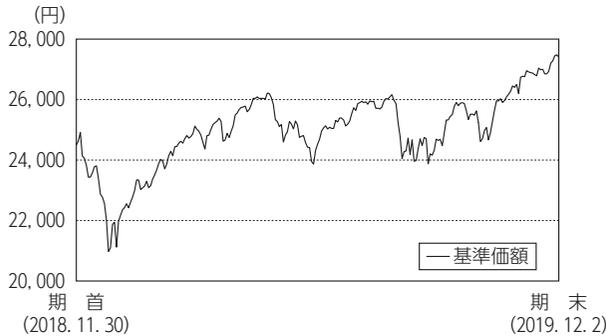
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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 (円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率			
(期首)2018年11月30日	24,496	—	16,678	—	95.1	2.3	2.6
12月末	21,941	△10.4	14,911	△10.6	96.2	1.2	2.7
2019年1月末	23,373	△4.6	15,850	△5.0	96.1	1.2	2.7
2月末	24,775	1.1	16,795	0.7	96.2	1.1	2.7
3月末	24,945	1.8	16,870	1.2	95.8	1.6	2.8
4月末	26,060	6.4	17,595	5.5	96.4	0.9	2.7
5月末	24,412	△0.3	16,406	△1.6	96.0	1.1	2.8
6月末	25,291	3.2	16,972	1.8	95.8	1.6	2.8
7月末	25,979	6.1	17,414	4.4	95.7	1.5	2.7
8月末	24,692	0.8	16,519	△1.0	95.1	2.0	2.9
9月末	25,483	4.0	17,023	2.1	95.8	1.2	3.0
10月末	26,498	8.2	17,659	5.9	91.1	6.1	2.8
11月末	27,482	12.2	18,297	9.7	90.6	6.6	2.7
(期末)2019年12月2日	27,400	11.9	18,243	9.4	90.5	6.7	2.7

- (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：24,496円 期末：27,400円 騰落率：11.9%

【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上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米中関係悪化への懸念が高まったことや、米国債券市場において景気後退の予兆とされる長短金利の逆転現象が見られたことを受け、下落して始まりまし。2019年1月以降は、米中通商協議の進展期待や米国企業を中心とした良好な1-3月決算の発表などを好感し、上昇しました。5月からは、米中関係の緊張が続いたことや世界的な景気減速懸念などを嫌気し、下落しました。6月以降は、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU(欧州連合)離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。当作成期末にかけては、再度米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して円高となりました。

当作成期首より、株価や原油価格が下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。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。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU(欧州連合)離脱交渉の進展期待が高まる中で、円安傾向となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後の運用にあたりましても、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先物取引等の株価指数先物も一部利用し、株式組入比率(投資信託証券、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

ベンチマークの騰落率は9.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は11.9%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ってまいります。

# 外国株式インデックスマザーファンド

## ■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 ( 1) ( 0) ( 0)
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	2 ( 2) ( 0)
その他費用 (保管費用) (その他)	7 ( 7) ( 0)
合 計	10

(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12月1日から2019年12月2日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 11,284.7 ( 91.07)	千アメリカ・ドル 87,440 (△ 2,352)	百株 5,036.19	千アメリカ・ドル 33,749
	カナダ	百株 2,159 (△ 105.59)	千カナダ・ドル 8,134 (△ 292)	百株 1,118	千カナダ・ドル 2,686
	オーストラリア	百株 2,768.05 (△ 317.2)	千オーストラリア・ドル 4,668 (△ 442)	百株 931.73	千オーストラリア・ドル 1,768
	香港	百株 3,954 ( 286.09)	千香港・ドル 16,635 ( ー)	百株 3,702	千香港・ドル 6,967
	シンガポール	百株 1,359 ( ー)	千シンガポール・ドル 704 ( ー)	百株 1,899	千シンガポール・ドル 261
	ニュージーランド	百株 380 ( ー)	千ニュージーランド・ドル 295 ( ー)	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	百株 10,885.98 ( 625.28)	千イギリス・ポンド 6,843 (△ 174)	百株 3,744.24	千イギリス・ポンド 3,634
	イスラエル	百株 441 ( ー)	千イスラエル・シェケル 882 ( ー)	百株 483	千イスラエル・シェケル 117
	スイス	百株 548.45 ( 118.8)	千スイス・フラン 3,988 (△ 153)	百株 148.5	千スイス・フラン 1,287

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	デンマーク	百株 142.3 ( 5.3)	千デンマーク・クローネ 6,073 ( ー)	百株 77.3	千デンマーク・クローネ 2,681
	ノルウェー	百株 201 ( 24)	千ノルウェー・クローネ 2,524 ( ー)	百株 117	千ノルウェー・クローネ 1,827
	スウェーデン	百株 809 ( 151)	千スウェーデン・クローネ 11,020 ( ー)	百株 369.5	千スウェーデン・クローネ 4,038
	ユーロ (アイルランド)	百株 68.5 ( ー)	千ユーロ 261 ( ー)	百株 9	千ユーロ 27
	ユーロ (オランダ)	百株 1,022.6 (△ 7.62)	千ユーロ 2,968 (△ 53)	百株 154	千ユーロ 601
	ユーロ (ベルギー)	百株 63.5 ( ー)	千ユーロ 574 ( ー)	百株 14	千ユーロ 111
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 323.3 ( ー)	千ユーロ 288 ( ー)	百株 10	千ユーロ 42
	ユーロ (フランス)	百株 860.1 ( 23.48)	千ユーロ 4,455 (△ 3)	百株 316	千ユーロ 1,505
	ユーロ (ドイツ)	百株 864.4 ( 21.24)	千ユーロ 3,656 (△ 105)	百株 405.2	千ユーロ 1,606
	ユーロ (ポルトガル)	百株 110 ( ー)	千ユーロ 61 ( ー)	百株 —	千ユーロ —
国	ユーロ (スペイン)	百株 1,873 ( 4,550.2)	千ユーロ 1,482 ( 115)	百株 5,170.2	千ユーロ 677
	ユーロ (イタリア)	百株 1,853 ( ー)	千ユーロ 841 ( ー)	百株 994	千ユーロ 503
	ユーロ (フィンランド)	百株 358.5 ( 81.85)	千ユーロ 468 ( ー)	百株 138.85	千ユーロ 126
	ユーロ (オーストリア)	百株 50 ( ー)	千ユーロ 178 (△ 11)	百株 8	千ユーロ 24
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 7,446.9 ( 4,669.15)	千ユーロ 15,236 (△ 58)	百株 7,219.25	千ユーロ 5,226

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外	アメリカ	千口 91.22 ( 2.4)	千アメリカ・ドル 4,522 ( —)	千口 13.479 ( —)	千アメリカ・ドル 879 ( —)
	カナダ	千口 3.8 ( —)	千カナダ・ドル 173 ( —)	千口 — ( —)	千カナダ・ドル — ( —)
	オーストラリア	千口 86 ( —)	千オーストラリア・ドル 665 ( —)	千口 6.4 ( —)	千オーストラリア・ドル 90 ( —)
	香港	千口 24 ( —)	千香港・ドル 692 ( —)	千口 — ( —)	千香港・ドル — ( —)
	シンガポール	千口 95.5 12.16)	千シンガポール・ドル 233 (△ 2)	千口 12.16 ( —)	千シンガポール・ドル 3 ( —)
	国	イギリス	千口 14.55 ( —)	千イギリス・ポンド 89 ( —)	千口 22.2 ( —)
ユーロ (フランス)		千口 1.79 ( —)	千ユーロ 152 ( —)	千口 0.25 ( —)	千ユーロ 31 ( —)

- (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12月1日から2019年12月2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 25,361	百万円 19,425	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12月1日から2019年12月2日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
MICROSOFT CORP (アメリカ)	千株 25	千円 346,644	円 13,865	CELGENE CORP (アメリカ)	千株 21.25	千円 249,796	円 11,755
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.57	311,915	198,672	APPLE INC (アメリカ)	8.3	188,085	22,660
APPLE INC (アメリカ)	10.85	226,791	20,902	SHIRE PLC (ジャージー)	24.324	154,583	6,355
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	8.1	156,863	19,365	MICROSOFT CORP (アメリカ)	8.55	124,832	14,600
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO (アメリカ)	25.8	153,804	5,961	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.54	106,160	196,593
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.99	121,219	122,444	ORACLE CORP (アメリカ)	15.8	92,082	5,827
PROSUS NV (オランダ)	14.5	120,665	8,321	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	6.8	86,288	12,689
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.97	119,436	123,130	CISCO SYSTEMS INC (アメリカ)	11.8	65,328	5,536
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	8.1	117,384	14,491	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	4.75	58,661	12,349
BLACKSTONE GROUP INC/THE A (アメリカ)	19	111,097	5,847	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	2.9	57,912	19,969

- (注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	30.5	33	408	44,776	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	25	28.5	647	71,026	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	48	55.5	594	65,151	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS INC	—	41	298	32,719	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	16	241	26,519	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	188	185	692	75,907	金融
ABBOTT LABORATORIES	456.66	499.16	4,265	467,820	ヘルスケア
ARCONIC INC	113.33	111.33	344	37,804	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	41.5	43.5	641	70,363	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	105	98	614	67,447	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	78	85.5	889	97,527	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	84.79	173.62	2,398	263,074	情報技術
QORVO INC	34	34	354	38,861	情報技術
AFLAC INC	203	216	1,184	129,920	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	31.5	36.5	432	47,415	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	39	42	293	32,158	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	127.8	137.5	4,256	466,802	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	59.5	64.5	298	32,690	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	26	31	699	76,736	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	100	113	186	20,449	金融
GARMIN LTD	29	39	380	41,787	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	58	61.3	1,448	158,893	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	192	205.5	3,669	402,438	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	41.71	—	—	—	その他
WR BERKLEY CORP	25.5	41.75	283	31,138	金融
AUTOZONE INC	7	7.3	859	94,311	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	63.21	69.71	637	69,928	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	257	314	327	35,885	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	29.5	32	279	30,671	公益事業
CELANESE CORP	35.5	35	439	48,203	素材
DR HORTON INC	94.16	101.16	559	61,412	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	24.5	24.5	75	8,297	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	59	70	395	43,409	ヘルスケア
AUTODESK INC	57.5	61	1,103	121,030	情報技術
MOODY'S CORP	44.5	48	1,088	119,333	金融
DEVON ENERGY CORP	139.5	116.5	255	27,970	エネルギー
ALBEMARLE CORP	28	31.5	205	22,588	素材
ATMOS ENERGY CORP	28	33.5	358	39,300	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	62.5	67	355	38,947	公益事業
CITIGROUP INC	660.73	653.73	4,910	538,618	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	115	122.5	2,092	229,456	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	130	142.5	1,301	142,774	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.1	4.1	319	35,077	金融
DOMINO'S PIZZA INC	11	11	323	35,506	一般消費財・サービス
HESS CORP	72	78	484	53,118	エネルギー
DAVITA INC	35	35	251	27,551	ヘルスケア
DANAHER CORP	163	182	2,656	291,401	ヘルスケア
FORTIVE CORP	78	87	627	68,865	資本財・サービス
AVNET INC	32	—	—	—	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	151.5	162.5	1,530	167,839	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	49	49	92	10,152	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	47.28	56.28	97	10,678	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	143.5	158	678	74,395	生活必需品
BUNGE LTD	36	40	213	23,418	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	89.25	98.25	910	99,904	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
APPLE INC	1,272.5	1,298	34,689	3,804,695	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	90	94	797	87,500	金融
BOEING CO/THE	143.1	149.9	5,489	602,037	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	39.15	44.65	477	52,424	金融
BECTON DICKINSON AND CO	70.19	76.49	1,977	216,866	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	67	142	15,637	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	38.5	38.5	349	38,358	情報技術
CDK GLOBAL INC	32	36	192	21,144	情報技術
NISOURCE INC	93.5	110.5	292	32,056	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	36	38.5	295	32,451	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	265.21	243.21	1,190	130,628	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,074.54	1,169.04	7,042	772,399	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	334.5	363.5	8,007	878,307	金融
ANSYS INC	22.5	24.5	623	68,439	情報技術
H&R BLOCK INC	51	—	—	—	一般消費財・サービス
BB&T CORP	200	215.5	1,179	129,336	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	190	1,030	112,990	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	421.5	668.5	3,806	417,490	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	877.7	910.7	11,999	1,316,092	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	63	69.5	858	94,186	金融
CIGNA HOLDING CO	64	—	—	—	その他
LKQ CORP	85	94	331	36,373	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	13.5	254	27,885	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	68.62	90.62	614	67,407	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	72.5	83	583	63,951	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	38.1	38.1	624	68,478	金融
DOLLAR GENERAL CORP	69.5	75	1,180	129,444	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	46.5	51.6	1,460	160,186	情報技術
CATERPILLAR INC	155.5	162	2,344	257,158	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	—	70	264	28,975	金融
AQUA AMERICA INC	—	63	278	30,589	公益事業
CMS ENERGY CORP	72	82	502	55,131	公益事業
MOSAIC CO/THE	97.5	109.5	208	22,878	素材
DELTA AIR LINES INC	47.5	47.5	272	29,857	資本財・サービス
CORNING INC	213	232	673	73,894	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,222.5	1,210.5	5,484	601,570	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	37	236	25,955	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	346	356.5	1,763	193,471	金融
WABCO HOLDINGS INC	14	15.5	208	22,908	資本財・サービス
MSCI INC	23	24.5	635	69,648	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	10	10	255	28,061	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	14.5	16	185	20,314	資本財・サービス
COTY INC-CL A	118.39	84.39	97	10,681	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	56	65	390	42,810	情報技術
BROADCOM INC	108.02	111.22	3,516	385,732	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	—	—	—	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC	10	11.5	150	16,495	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	24.3	33.3	390	42,783	ヘルスケア
ARAMARK	64.5	70.5	307	33,744	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	53.5	60.5	172	18,891	素材
DTE ENERGY COMPANY	46.5	52.5	655	71,942	公益事業
CENTENE CORP	54.5	121.5	734	80,583	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	30	32	380	41,731	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	129	130.5	501	55,048	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	46.5	53.5	498	54,729	金融
GARTNER INC	23.5	27.2	436	47,869	情報技術
SPLUNK INC	38	45	671	73,649	情報技術
AGCO CORP	17	—	—	—	資本財・サービス

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DOMINION ENERGY INC	172	226.41	1,881	206,384	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	111	117	699	76,764	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	36.5	41.5	200	22,030	資本財・サービス
DEERE & CO	80	87.5	1,470	161,277	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	42.5	81.84	1,482	162,559	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	19.5	25	389	42,671	情報技術
CHEMOURS CO/THE	45.5	—	—	—	素材
BURLINGTON STORES INC	—	19	427	46,888	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	31.5	34.5	361	39,655	金融
VAIL RESORTS INC	10.2	11.2	271	29,809	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	36.5	41	187	20,604	金融
TARGA RESOURCES CORP	58.5	65.5	239	26,243	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	16.5	18	297	32,665	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	19.8	21.8	239	26,231	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	10.5	72	7,909	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	80	92	799	87,676	公益事業
COGNEX CORP	45.5	50.5	253	27,793	情報技術
TELEFLEX INC	12.3	13.3	469	51,543	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	23	26	300	32,971	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	22	323	35,477	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	6.5	240	26,333	ヘルスケア
WELL CARE HEALTH PLANS INC	—	15.2	489	53,693	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	31.5	38	566	62,175	ヘルスケア
IDEX CORP	19.5	22.5	366	40,160	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	216.5	230.5	1,563	171,457	生活必需品
ROLLINS INC	25.5	43.25	155	17,006	資本財・サービス
AMETEK INC	61.75	65.25	646	70,857	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	65	73.5	516	56,623	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	32	36.5	135	14,808	資本財・サービス
HEICO CORP	—	12	155	17,095	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	31	25.5	210	23,127	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	11.5	298	32,750	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	85.5	75	694	76,123	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	11	319	35,008	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	114	124	3,717	407,751	生活必需品
SCANA CORP	35	—	—	—	その他
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	24	292	32,069	情報技術
GRUBHUB INC	—	26	112	12,296	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	—	16.5	349	38,338	情報技術
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13.5	—	—	—	金融
RPM INTERNATIONAL INC	—	38	280	30,729	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.5	6.9	561	61,596	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	76	69.5	145	15,931	金融
UGI CORP	46	52	226	24,838	公益事業
CUMMINS INC	40.5	43.5	795	87,243	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	191.5	215.5	1,181	129,596	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	68.5	76.5	171	18,819	情報技術
CDW CORP/DE	40.5	43.5	587	64,433	情報技術
SIGNATURE BANK	15	15	185	20,295	金融
COSTAR GROUP INC	9.7	9.9	606	66,546	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	13.9	14.9	345	37,870	金融
AMERCO	2.2	2.2	79	8,740	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16.5	18.5	354	38,875	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	10.9	12.7	737	80,871	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	95	110	165	18,181	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19.5	23	349	38,328	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	74.16	81.66	857	94,042	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	46	—	—	—	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
IPG PHOTONICS CORP	10.2	10.2	144	15,896	情報技術
DEXCOM INC	—	27	613	67,314	ヘルスケア
COPART INC	54	58.5	520	57,104	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	26.5	46.5	359	39,444	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	29	32.5	391	42,899	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	19.5	22.7	629	69,050	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12.8	13.3	754	82,725	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	26	303	33,253	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	90	99	193	21,228	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	509.81	575.81	1,129	123,846	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	73.5	79	1,095	120,145	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	11.5	464	50,934	金融
CABOT OIL & GAS CORP	120.5	120.5	192	21,067	エネルギー
T-MOBILE US INC	90	100	785	86,153	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	29	34.5	135	14,814	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,051	1,141.5	6,095	668,566	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	57.5	71	358	39,294	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	45.5	48.5	362	39,768	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	30.5	30.5	143	15,779	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	86.5	86.5	237	26,080	金融
CSX CORP	214	221.5	1,584	173,800	資本財・サービス
FLUOR CORP	36.5	—	—	—	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	26	26.8	461	50,643	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	32.25	40.75	414	45,436	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	21.5	24	196	21,511	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	107.4	117.7	21,195	2,324,713	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	66.5	—	—	—	エネルギー
FLOWSERVE CORP	32	35.5	172	18,962	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	54.5	60	1,469	161,190	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,099.05	1,196.55	8,152	894,121	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	34	37.5	200	22,029	情報技術
AES CORP	170	201	380	41,688	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	20.5	—	—	—	その他
EVEREST RE GROUP LTD	10.2	12.4	336	36,892	金融
EOG RESOURCES INC	152.5	164	1,162	127,531	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	44.5	48.5	422	46,343	情報技術
ABIOMED INC	10.8	12.9	253	27,756	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	42.5	46.5	408	44,835	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	83.9	92.4	746	81,855	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	956.23	1,109.23	1,004	110,224	一般消費財・サービス
MACYS INC	80.98	—	—	—	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	39.9	46.9	154	16,944	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	—	37	299	32,875	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	48.87	110	12,086	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	79.89	100.89	307	33,772	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	34	40	247	27,117	資本財・サービス
FORTINET INC	38	41.5	436	47,843	情報技術
MARKEL CORP	3.6	4.1	465	51,064	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	44	—	—	—	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	122.5	135.5	3,168	347,494	公益事業
FREEMONT-MCMORAN INC	364.08	434.08	493	54,180	素材
INSULET CORP	—	17.5	324	35,643	ヘルスケア
US BANCORP	403.5	428	2,569	281,799	金融
UNITED RENTALS INC	21.5	23	352	38,609	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	17.5	254	27,967	情報技術
FASTENAL CO	77	163	578	63,502	資本財・サービス
FISERV INC	107	161.63	1,878	206,065	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,263.5	2,468.5	2,781	305,129	資本財・サービス

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NEKTAR THERAPEUTICS	44.5	—	—	—	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	56	61	327	35,887	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	60.5	—	—	—	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	334	361	1,299	142,540	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	27.5	33	93	10,279	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	66	69	1,254	137,539	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	93.4	92.9	2,056	225,539	金融
ALPHABET INC-CL A	77.6	84	10,954	1,201,473	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	81.77	87.47	11,414	1,251,940	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	27.5	31.5	211	23,168	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	156.5	168.5	898	98,541	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	125.68	152.68	728	79,861	公益事業
GENUINE PARTS CO	37.5	43	448	49,223	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	101.84	106.34	772	84,734	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	176	207	624	68,542	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	30.5	64.1	1,288	141,376	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	30	86	9,456	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	234	248	520	57,094	エネルギー
HOME DEPOT INC	298.5	310	6,835	749,751	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	14	17.5	232	25,503	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	294	299	445	48,830	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11.9	11.9	299	32,847	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	37.5	43.5	644	70,688	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	44.5	44.5	161	17,756	一般消費財・サービス
HUMANA INC	36	38.3	1,306	143,341	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	89.5	81.5	941	103,316	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	21	362	39,724	情報技術
HELMERICH & PAYNE	29	—	—	—	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	40.5	45	310	34,006	ヘルスケア
HP INC	433	426	855	93,821	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	394	394	623	68,407	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	48	48	232	25,538	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	43	47	242	26,573	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	54.5	60	270	29,672	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	25	121	13,353	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	103.5	119	499	54,778	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	161.53	198.53	605	66,413	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	238.5	250	3,361	368,661	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	100	107	495	54,383	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	36	40	253	27,753	資本財・サービス
ZOETIS INC	126.5	135.5	1,633	179,112	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	65.79	69.79	915	100,359	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	54.5	65.5	396	43,492	エネルギー
ALLEGION PLC	24.5	26.5	318	34,886	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	35	35	183	20,084	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	136.73	117.73	253	27,762	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	68.57	75.57	684	75,052	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	89	96.5	241	26,523	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	22	247	27,143	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	29.2	34.2	359	39,419	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	696	748	10,284	1,127,976	ヘルスケア
ABBVIE INC	394.29	417.79	3,665	402,006	ヘルスケア
HOLOGIC INC	71	75.5	387	42,497	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	89.5	99.5	1,356	148,790	生活必需品
KROGER CO	218.5	229.5	627	68,819	生活必需品
KLA CORP	41	46.5	761	83,570	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	66.7	71.7	2,803	307,508	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	23.2	25.6	785	86,177	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
L BRANDS INC	59	—	—	—	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	212	224.5	2,633	288,854	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	252.5	246.05	2,887	316,689	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	42.3	42.3	1,128	123,794	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	12.5	14.5	241	26,452	不動産
LOEWS CORP	72.5	79	402	44,103	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	57.99	57.99	342	37,557	金融
MCDONALD'S CORP	203.5	216	4,200	460,740	一般消費財・サービス
3M CO	153.5	162.5	2,758	302,581	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	624.5	676.5	13,640	1,496,138	コミュニケーション・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	51.04	—	—	—	情報技術
MANPOWERGROUP INC	16	17.8	164	18,086	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	65	69.8	1,847	202,607	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	16	18.4	493	54,166	素材
CONCHO RESOURCES INC	52.5	58	420	46,158	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	134.5	—	—	—	その他
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	53	66	225	24,785	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	116	128.5	1,474	161,684	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	111.5	121	227	25,003	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	134	144.5	461	50,636	一般消費財・サービス
MATTEL INC	87	—	—	—	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	73.38	77.88	290	31,886	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	32	33.5	566	62,187	生活必需品
MYLAN NV	137.5	148.5	278	30,587	ヘルスケア
METLIFE INC	227	235	1,172	128,642	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	157	181	477	52,349	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	13.9	15.1	294	32,316	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	42	48	216	23,701	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	42.78	47.78	799	87,673	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6.4	6.4	460	50,499	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	132.73	144.73	324	35,589	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	32.3	33.8	661	72,601	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	29.4	—	—	—	金融
MERCK & CO. INC.	696.21	727.21	6,339	695,351	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	598.55	211.68	1,371	150,469	素材
MASCO CORP	79	86	400	43,908	資本財・サービス
M & T BANK CORP	35.19	35.69	587	64,487	金融
MARSH & MCLENNAN COS	132.5	144.5	1,561	171,277	金融
BLACK KNIGHT INC	—	44	277	30,408	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	—	23	231	25,337	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	77.22	78.72	1,104	121,186	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	37.5	48	859	94,300	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	—	18.5	157	17,230	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	77.5	101	698	76,568	情報技術
TRANSUNION	47	55	474	52,065	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	87	100.5	266	29,243	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	38.5	44.5	165	18,127	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	79.5	—	—	—	その他
BEIGENE LTD-ADR	—	10.5	213	23,411	ヘルスケア
NETAPP INC	68.5	74.5	451	49,509	情報技術
NIKE INC -CL B	332	355.5	3,323	364,529	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	74	75	1,451	159,173	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	60	68	642	70,510	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	34.5	37.5	336	36,942	金融
ALLY FINANCIAL INC	114.5	114.5	364	39,985	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	43	44.5	1,565	171,690	資本財・サービス
APTIV PLC	68.5	72	675	74,136	一般消費財・サービス
NEWMONT GOLDCORP CORP	140	231.61	889	97,547	素材

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MCKESSON CORP	53	55.5	802	88,045	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	71	81	459	50,346	情報技術
XYLEM INC	48	51.5	399	43,781	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	404.5	440.5	3,653	400,668	生活必需品
NUCOR CORP	82	87	490	53,779	素材
WESTERN UNION CO	117.46	129.46	347	38,167	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	45	53	351	38,586	情報技術
NEWELL BRANDS INC	122.92	122.92	236	25,912	一般消費財・サービス
EVERGY INC	69.5	68.5	433	47,535	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	197	257.24	992	108,821	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	7	118	12,998	金融
OKTA INC	—	30	389	42,702	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	28.5	31.5	376	41,282	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	107.05	296	32,534	ヘルスケア
LINDE PLC	147.96	152.96	3,154	345,951	素材
WIX.COM LTD	—	14.5	175	19,225	情報技術
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	83	205	22,521	金融
KKR & CO INC -A	—	147	433	47,546	金融
PAYCHEX INC	83.5	93.5	805	88,316	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21.2	22	973	106,720	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	491	528.5	2,626	288,090	生活必需品
P G & E CORP	132.5	—	—	—	公益事業
PFIZER INC	1,520.13	1,571.13	6,051	663,782	ヘルスケア
ALKERMES PLC	40	—	—	—	ヘルスケア
CIGNA CORP	—	106.8	2,135	234,182	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	—	45.51	220	24,203	情報技術
ALTICE USA INC- A	—	41	104	11,503	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	131.5	148.5	913	100,151	公益事業
STERIS PLC	—	25	377	41,442	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	—	48.33	169	18,542	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	—	99.99	357	39,217	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	87	95	1,946	213,455	ヘルスケア
DOW INC	—	210.68	1,124	123,324	素材
PARKER HANNIFIN CORP	35	37.5	745	81,762	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	—	52	153	16,881	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	45	46.5	594	65,199	エネルギー
POLARIS INC	15.5	15.5	151	16,609	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	650.67	707.67	8,637	947,396	生活必需品
EXELON CORP	254.72	273.72	1,215	133,295	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	57.5	66	752	82,479	ヘルスケア
NVR INC	0.9	1	379	41,589	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	303	319	1,912	209,717	エネルギー
TWILIO INC - A	—	31.5	325	35,682	情報技術
DOCUSIGN INC	—	29	206	22,649	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	—	14	387	42,504	情報技術
MATCH GROUP INC	—	18	126	13,914	コミュニケーション・サービス
PEPSICO INC	366	395.5	5,372	589,209	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	11	134	14,785	情報技術
DROPPBOX INC-CLASS A	—	52	96	10,545	情報技術
MONGODDB INC	—	12.5	185	20,386	情報技術
SNAP INC - A	—	208	317	34,790	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	—	215.68	561	61,552	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	110	118	1,104	121,165	金融
AMCOR PLC	—	479	491	53,902	素材
ROKU INC	—	24	384	42,214	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	48.5	51.5	623	68,364	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	167	180.8	3,636	398,903	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	—	—	—	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PENTAIR PLC	42.05	47.05	208	22,886	資本財・サービス
QUALCOMM INC	369.5	343.5	2,869	314,775	情報技術
INVESCO LTD	109.5	109.5	192	21,089	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	19	20.5	322	35,318	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	72	83.5	460	50,462	金融
PINTEREST INC- CLASS A	—	45	87	9,614	コミュニケーション・サービス
RAYTHEON COMPANY	75.2	79.2	1,721	188,865	資本財・サービス
DISH NETWORK CORP-RTS	—	3.49	0	26	コミュニケーション・サービス
RED HAT INC	45.5	—	—	—	その他
REGENERON PHARMACEUTICALS	20.9	22	811	89,038	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	60	67.5	598	65,631	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	12.5	12.3	2,341	256,865	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	99.5	107	1,242	136,310	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	24	26.5	296	32,523	素材
RESMED INC	37	41.5	620	68,093	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	35.5	38	404	44,408	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	30.5	33.5	194	21,384	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	14.5	14.5	155	17,070	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	—	31	287	31,586	ヘルスケア
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	302.35	503	55,181	金融
CHEVRON CORP	497.18	538.18	6,303	691,390	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	83	103	711	78,062	公益事業
TESLA INC	33	37.7	1,243	136,428	一般消費財・サービス
NORTONLIFELOCK INC	161.5	184.5	459	50,387	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	39.22	44.22	697	76,504	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	37.5	43.5	613	67,291	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	45.05	44.15	2,075	227,596	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	87	91.5	521	57,223	不動産
TWITTER INC	179	211.5	653	71,702	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	266.5	293.5	1,819	199,552	公益事業
SYSCO CORP	127	137	1,103	121,035	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	71.23	73.03	998	109,511	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	35.5	39.5	254	27,956	金融
STERICYCLE INC	21.5	—	—	—	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	62	62	209	22,936	素材
SCHLUMBERGER LTD	359.02	392.02	1,419	155,648	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	46	46	236	25,978	資本財・サービス
AT&T INC	1,887.91	2,065.91	7,722	846,989	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	36.5	40.5	233	25,603	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	110	123	264	28,964	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21.9	23.3	1,358	149,021	素材
SEMPRA ENERGY	64.5	79	1,163	127,605	公益事業
TIFFANY & CO	29.5	32.5	434	47,694	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70.5	71	423	46,474	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	253	265	3,185	349,392	情報技術
SALESFORCE.COM INC	186	234.21	3,815	418,434	情報技術
WESTROCK CO	66.3	71.3	287	31,538	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	238.84	229.84	984	107,969	資本財・サービス
TERADYNE INC	—	50	312	34,324	情報技術
UNION PACIFIC CORP	201.5	199.5	3,511	385,086	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	226	248	288	31,688	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	178.38	193.88	1,175	128,949	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	214.37	231.37	3,432	376,437	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	179	197	2,358	258,700	資本財・サービス
UNUM GROUP	59	59	181	19,892	金融
SPRINT CORP	207.65	231.65	137	15,041	コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	51	—	—	—	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	41.94	48.94	714	78,358	ヘルスケア

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		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		
VOYA FINANCIAL INC	43.5	43.5	253	27,805	金融
AMEREN CORPORATION	62.5	72	535	58,698	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	249.76	267.76	7,493	821,919	ヘルスケア
VERISIGN INC	29	30	572	62,761	情報技術
VALERO ENERGY CORP	112.92	117.42	1,121	122,977	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	15.1	16.1	376	41,296	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	68.38	81.88	389	42,774	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	23	25	348	38,248	ヘルスケア
ANTHEM INC	67.4	72.8	2,101	230,486	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	387	509.12	7,717	846,426	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,196.22	1,209.22	6,585	722,288	金融
WASTE MANAGEMENT INC	110.5	119.5	1,349	147,988	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	319	347	788	86,469	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	32	34.5	325	35,735	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	19	271	29,820	一般消費財・サービス
WALMART INC	382	405	4,823	529,002	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	29	252	27,669	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	53	58	842	92,419	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	26	29	350	38,439	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	59.11	59.11	230	25,239	情報技術
WABTEC CORP	22.5	54.11	425	46,629	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	328	342.5	2,093	229,637	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	20.5	455	49,931	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	18	18	167	18,320	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	88.57	91.57	1,693	185,742	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	16.5	414	45,413	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	220	220	1,311	143,812	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	35.23	37.23	731	80,214	金融
WESTERN DIGITAL CORP	78	84	422	46,369	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	82.8	90.8	804	88,286	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	134	146	865	94,974	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	460.5	489.5	9,031	990,603	情報技術
PPL CORP	186	211	718	78,753	公益事業
PULTEGROUP INC	69	75	297	32,616	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	64.5	67.5	869	95,385	素材
NORTHERN TRUST CORP	56.5	60	643	70,572	金融
NVIDIA CORP	150	163	3,532	387,484	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	20.5	23.5	523	57,400	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	122.43	127.43	1,952	214,134	金融
QURATE RETAIL INC-SERIES A	114.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	53	211	23,147	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	79	83	746	81,830	生活必需品
NETFLIX INC	113.4	123.2	3,876	425,186	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	105	113	3,547	389,104	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	—	79.5	315	34,642	公益事業
GLOBE LIFE INC	29.25	29.25	300	32,966	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	42.5	48.5	533	58,461	金融
TEXTRON INC	68.5	68.5	316	34,740	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	275	—	—	—	コミュニケーション・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	116	—	—	—	その他
NEWS CORP - CLASS A	102.37	117.37	151	16,580	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	53	59.5	250	27,448	公益事業
OMNICOM GROUP	60.5	64	508	55,791	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	792.83	676.83	3,799	416,753	情報技術
MASTERCARD INC - A	240.5	255	7,451	817,320	情報技術
ONEOK INC	107.5	119	845	92,733	エネルギー
CENTURYLINK INC	253.52	294.52	426	46,806	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	27.2	30.2	1,088	119,366	資本財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
YUM! BRANDS INC	83	89.5	900	98,821	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	30.5	30.5	370	40,594	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13.3	13.3	142	15,595	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	50.5	56.5	285	31,282	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	124	145.5	302	33,129	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,491.01	2,554.01	8,509	933,372	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	10.5	359	39,384	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	46	52.5	423	46,474	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	114	12,559	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	190.5	200	2,402	263,495	金融
ANALOG DEVICES INC	95.49	106.49	1,202	131,923	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	238	291	1,139	124,954	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	72	83	430	47,183	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	230.22	245.22	1,291	141,632	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	135	—	—	—	その他
SKYWORKS SOLUTIONS INC	48	51.5	506	55,524	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	44.5	49.5	594	65,160	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	51	—	—	—	その他
AVERY DENNISON CORP	23	25	325	35,747	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	153.5	165	1,057	116,021	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	165.5	174	1,285	140,956	資本財・サービス
AON PLC	63	69.7	1,419	155,653	金融
AMGEN INC	172.5	173	4,060	445,372	ヘルスケア
TAPESTRY INC	76.5	83.5	224	24,626	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	115.36	121.36	1,122	123,124	資本財・サービス
CELGENE CORP	192	—	—	—	その他
CONSTELLATION BRANDS INC-A	43.3	46.8	870	95,505	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	263	272	1,574	172,732	情報技術
CIT GROUP INC	33	—	—	—	金融
CIMAREX ENERGY CO	25	—	—	—	エネルギー
CME GROUP INC	93.5	101	2,047	224,577	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	98.94	116.94	263	28,922	エネルギー
ECOLAB INC	68.5	75.5	1,409	154,578	素材
EQUIFAX INC	31.5	33.5	467	51,307	資本財・サービス
GAP INC/THE	59.5	59.5	98	10,839	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	336	359.5	2,417	265,127	ヘルスケア
HORMEL FOODS CORP	77.5	83.5	371	40,781	生活必需品
STATE STREET CORP	97.43	109.43	821	90,137	金融
SUNTRUST BANKS INC	120.48	129.48	917	100,602	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	318	340	1,683	184,591	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	131	136	1,114	122,270	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	48.5	48.5	225	24,772	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	34.5	38.5	292	32,050	素材
CARDINAL HEALTH INC	83	90	495	54,321	ヘルスケア
FEDEX CORP	66	69	1,104	121,124	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	126.54	135.04	1,350	148,126	金融
FMC CORP	36	39.5	386	42,439	素材
FLEX LTD	129	147.5	175	19,203	情報技術
CERNER CORP	77.5	93.5	669	73,416	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	26.24	30.24	427	46,842	素材
CITRIX SYSTEMS INC	37	37	417	45,780	情報技術
INTEL CORP	1,205	1,266.5	7,352	806,370	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	102	115	257	28,253	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	91	103.5	640	70,222	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	79.5	94.5	1,647	180,688	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	417	461	321	35,292	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	38.7	40.4	1,295	142,131	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	44	166	18,208	素材

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTUITIVE SURGICAL INC	29.7	32.1	1,903	208,743	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	34.5	34.5	406	44,605	情報技術
SNAP-ON INC	15.5	15.5	248	27,278	資本財・サービス
CARMAX INC	46	49.5	481	52,804	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	45	316	34,751	金融
INGREDION INC	19	19	158	17,331	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	183.78	205.28	1,809	198,515	公益事業
TARGET CORP	132.5	144	1,800	197,439	一般消費財・サービス
DOVER CORP	39	42.5	473	51,965	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	13	14	443	48,668	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	34	39.5	363	39,896	資本財・サービス
CINTAS CORP	23.5	26.2	673	73,869	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	127	138	398	43,697	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	41	344	37,764	生活必需品
CLOROX COMPANY	33	37.5	555	60,966	生活必需品
ENTERGY CORP	47.5	54	628	68,934	公益事業
MICROSOFT CORP	1,892	2,056.5	31,131	3,414,480	情報技術
INCYTE CORP	46	53.5	503	55,251	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	335.69	367.69	2,767	303,550	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	349.88	379.38	4,225	463,498	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	305.5	312	1,482	162,579	情報技術
BLACKROCK INC	31.3	32	1,583	173,701	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	129	149	365	40,136	公益事業
HASBRO INC	31	36	366	40,156	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	68.5	73	475	52,139	生活必需品
KEYCORP	282	299	579	63,588	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	27.5	30	457	50,152	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	384.61	406.61	2,136	234,312	生活必需品
KOHL'S CORP	44.5	49.5	232	25,522	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	13	14	438	48,075	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	120	—	—	—	金融
APACHE CORP	98.6	106.1	236	25,927	エネルギー
CHUBB LTD	120.49	129.49	1,961	215,138	金融
ARROW ELECTRONICS INC	21.5	24	191	20,963	情報技術
ALLSTATE CORP	92	96	1,068	117,243	金融
EBAY INC	249	233.5	829	90,967	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	293	315	3,402	373,165	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	37.5	41.5	325	35,671	素材
XILINX INC	65.5	71.5	663	72,759	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	147.1	—	—	—	その他
DISH NETWORK CORP-A	57.5	64.5	220	24,173	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	52	52	258	28,391	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	57.5	61	1,192	130,778	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	—	—	—	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	64	70.5	285	31,339	情報技術
LENNAR CORP-A	76	81	483	52,993	一般消費財・サービス
LEAR CORP	16.5	18	216	23,752	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	70	70	310	34,011	金融
PROGRESSIVE CORP	154	168	1,227	134,603	金融
PACCAR INC	91.37	100.37	816	89,576	資本財・サービス
PVH CORP	20	20	193	21,269	一般消費財・サービス
BIOMGEN INC	54.6	56.1	1,681	184,474	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	22.2	25.2	633	69,535	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	354.5	342.5	2,925	320,921	一般消費財・サービス
PTC INC	—	31.5	241	26,464	情報技術
PERRIGO CO PLC	34	38	194	21,351	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	81.3	88.8	733	80,487	公益事業
INTUIT INC	63	73.4	1,900	208,419	情報技術

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BORGWARNER INC	56	63	264	29,055	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	65	69	556	61,027	一般消費財・サービス	
BALL CORP	87.34	91.84	606	66,542	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	360.47	392.97	1,699	186,411	ヘルスケア	
ELECTRONIC ARTS INC	78.5	86.5	873	95,831	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	34.5	36.5	517	56,795	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	66	72.5	1,607	176,331	ヘルスケア	
VF CORP	87	95	841	92,255	一般消費財・サービス	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	88.71	100.71	406	44,603	コミュニケーション・サービス	
VIACOM INC-CLASS B	92.71	100.71	242	26,587	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	15.7	17.2	239	26,292	一般消費財・サービス	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	24	26	347	38,135	ヘルスケア	
CARNIVAL CORP	112	118.5	534	58,590	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	1,188.9	1,281.9	5,659	620,743	コミュニケーション・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	61	67	212	23,331	資本財・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	59	67	376	41,313	資本財・サービス	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	90	52	5,774	生活必需品	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	313	353	194	21,294	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	79,569.2 592銘柄	85,908.78 612銘柄	762,122	83,589,601 <62.4%>	
		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
<b>(カナダ)</b>						
IMPERIAL OIL LTD	76	83	276	22,807	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	6	852	70,392	情報技術	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	50.96	59.96	82	6,786	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	63.87	71.87	627	51,820	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	120	132	481	39,806	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	38.5	40.5	554	45,831	金融	
BCE INC	41.3	45.3	289	23,930	コミュニケーション・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	51	57	744	61,536	素材	
SUNCOR ENERGY INC	429.3	444.3	1,840	152,081	エネルギー	
METRO INC/CN	62	77	447	37,012	生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	90	95	675	55,844	金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	318	346	2,592	214,227	金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	118.5	125.5	1,449	119,718	金融	
TORONTO-DOMINION BANK	483	516	3,952	326,517	金融	
GREAT-WEST LIFECO INC	76	83	277	22,938	金融	
ROYAL BANK OF CANADA	383.5	405.5	4,409	364,271	金融	
TOURMALINE OIL CORP	66	—	—	—	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	37	—	—	—	エネルギー	
TC ENERGY CORP	238.5	261.5	1,757	145,186	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	132.29	146.29	678	56,057	エネルギー	
BOMBARDIER INC-B	530	628	123	10,221	資本財・サービス	
BARRICK GOLD CORP	304	514	1,140	94,191	素材	
CAE INC	72	79	281	23,294	資本財・サービス	
THOMSON REUTERS CORP	68.12	58.12	539	44,599	資本財・サービス	
EMPIRE CO LTD 'A'	46	53	188	15,575	生活必需品	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	16	16	92	7,636	素材	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	38.5	46.5	264	21,825	素材	
LINAMAR CORP	13	—	—	—	一般消費財・サービス	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	64	—	—	—	エネルギー	
HYDRO ONE LTD	84	92	230	19,017	公益事業	
LOBLAW COMPANIES LTD	54.6	54.6	390	32,299	生活必需品	
WSP GLOBAL INC	27	30	257	21,249	資本財・サービス	
PARKLAND FUEL CORP	—	44	207	17,165	エネルギー	

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
QUEBECOR INC -CL B	—	53	174	14,423	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	13	72	393	32,491	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	33	40	156	12,908	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	95	106	682	56,417	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	59	72	568	46,946	素材
STARS GROUP INC/THE	—	63	200	16,567	一般消費財・サービス
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	150	279	23,088	公益事業
AIR CANADA	—	41	205	16,954	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	341	379	217	17,973	素材
BANK OF MONTREAL	171	180	1,839	152,017	金融
POWER CORP OF CANADA	94	94	303	25,038	金融
METHANEX CORP	22	17	84	6,942	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	23	28	1,247	103,048	情報技術
NUTRIEN LTD	165.19	165.19	1,035	85,572	素材
AURORA CANNABIS INC	175	198	65	5,431	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	55	62	151	12,555	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	—	55	49	4,103	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	58	323	26,734	素材
CAMECO CORP	106	106	128	10,596	エネルギー
TELUS CORP	54	54	270	22,374	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	62	80	259	21,467	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	140	151	314	25,949	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	16	18	278	23,015	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	248	—	—	—	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	328	351	1,302	107,617	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	7	8	480	39,658	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	87	92	673	55,624	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	20.37	22.37	241	19,968	生活必需品
BLACKBERRY LTD	135	160	117	9,689	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	158.5	174.5	1,057	87,382	金融
ENBRIDGE INC	488	571	2,872	237,295	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	220.5	239.5	1,840	152,066	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	529	560	1,463	120,896	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	87	95	356	29,449	ヘルスケア
GOLDCORP INC	233.59	—	—	—	素材
ENCANA CORP	258	368	191	15,840	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	38	39	1,226	101,360	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	29	33	224	18,539	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	56	63	245	20,299	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	192.5	204.5	2,466	203,780	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	69	73	803	66,386	情報技術
HUSKY ENERGY INC	93.58	93.58	90	7,476	エネルギー
ONEX CORPORATION	22	26	205	16,991	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	116	138	378	31,297	コミュニケーション・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	44	—	—	—	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	45	—	—	—	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	19	24	91	7,574	金融
OPEN TEXT CORP	70	81	468	38,701	情報技術
CI FINANCIAL CORP	70	70	146	12,098	金融
SAPUTO INC	63	71	285	23,552	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	177	193	234	19,373	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	116	256	1,112	91,921	生活必需品
FORTIS INC	110	130	676	55,894	公益事業

銘柄	柄	期首		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
LUNDIN MINING CORP		161	194	139	11,524	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP		133	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		272	314	368	30,456	エネルギー
DOLLARAMA INC		83	90	437	36,130	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I		17	22	110	9,159	公益事業
ALTAGAS LTD		69	79	155	12,858	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC		48	48	103	8,558	不動産
KEYERA CORP		53	60	194	16,066	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		104	128	281	23,265	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		97	—	—	—	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,989.17	11,924.58	55,981	4,625,219	
		89銘柄	86銘柄		<3.5%>	
(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		455	—	—	—	その他
MEDIBANK PRIVATE LTD		728	788	256	19,073	金融
BHP GROUP LTD		847.5	836.5	3,197	237,447	素材
SOUTH32 LTD		1,341	1,516	409	30,392	素材
ALUMINA LTD		623	693	160	11,886	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		245	266.5	919	68,287	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		425	425	413	30,704	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		133	133	133	9,904	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		712.5	794.5	2,056	152,729	金融
WESTPAC BANKING CORP		902.48	973.48	2,386	177,232	金融
SANTOS LTD		452	531	432	32,132	エネルギー
AUSNET SERVICES		500	500	87	6,459	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		770	798.5	1,983	147,272	金融
RIO TINTO LTD		109.5	105	1,017	75,545	素材
ORIGIN ENERGY LTD		462	535	465	34,559	エネルギー
AMCOR LIMITED		314	—	—	—	素材
AURIZON HOLDINGS LTD		543	600	346	25,749	資本財・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		—	34	75	5,634	エネルギー
COLES GROUP LTD		297.45	345.45	561	41,706	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		—	45	122	9,114	情報技術
OIL SEARCH LTD		353	384	285	21,212	エネルギー
SEEK LTD		83	96	222	16,529	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		191	205	383	28,463	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		197.5	234	719	53,443	素材
INCITEC PIVOT LTD		423	498	160	11,943	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		462	501.5	4,053	300,944	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD		71.5	71.5	247	18,347	エネルギー
ORICA LTD		101	115	273	20,305	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		360.5	384.5	487	36,200	金融
CIMIC GROUP LTD		24	28	94	6,993	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD		351	362	1,439	106,868	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD		137	137	155	11,576	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD		484	577	276	20,521	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD		96	116	149	11,119	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		—	240	175	13,008	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD		1,105	1,202	463	34,449	コミュニケーション・サービス
AMP LTD		750	1,020	199	14,806	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		120.5	133.5	386	28,706	素材
MACQUARIE GROUP LTD		85.84	91.84	1,267	94,137	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	152.5	174.5	591	43,948	一般消費財・サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	108	—	—	—	金融	
CSL LTD	120.5	127.5	3,614	268,366	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	297.45	323	1,368	101,614	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	15	16.5	386	28,666	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	144	163	237	17,609	素材	
SUNCORP GROUP LTD	343	382.57	511	38,006	金融	
BORAL LTD	305	358	184	13,662	素材	
ASX LTD	50	58	473	35,188	金融	
COMPUTERSHARE LTD	122.5	139	246	18,298	情報技術	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	60	4,469	一般消費財・サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	595.36	709.36	559	41,556	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	104	132.5	399	29,632	ヘルスケア	
CHALLENGER LTD	139	174	141	10,516	金融	
WORLEY LTD	—	94	141	10,469	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	174	190	387	28,793	公益事業	
BRAMBLES LTD	415	474	594	44,169	資本財・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	14	61	4,576	一般消費財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	38.5	42.5	310	23,029	ヘルスケア	
TPG TELECOM LTD	87	87	60	4,515	コミュニケーション・サービス	
REA GROUP LTD	13.5	16	166	12,397	コミュニケーション・サービス	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	38	199	14,810	金融	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	16.5	—	—	—	一般消費財・サービス	
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,651.08 57銘柄	20,170.2 58銘柄	37,167 <2.1%>	2,759,714	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	375	405	2,205	30,895	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	650	650	3,328	46,625	一般消費財・サービス	
MTR CORP	400	455	1,997	27,984	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	420	455	5,182	72,606	不動産	
SINO LAND CO	900	900	1,056	14,802	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	706.69	771.69	5,486	76,868	資本財・サービス	
WHARF HOLDINGS LTD	320	—	—	—	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	155	1,091	15,298	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	435	470	3,792	53,138	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	359.16	435.07	1,638	22,948	不動産	
HANG LUNG GROUP LTD	210	—	—	—	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	2,481.81	2,901.99	4,329	60,660	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	204	225	3,591	50,309	金融	
WHEELOCK & CO LTD	220	240	1,167	16,358	不動産	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,590	1,830	1,870	26,202	不動産	
WH GROUP LTD	2,225	2,950	2,371	33,228	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	313	337	8,330	116,712	金融	
MINH GROUP LTD	180	—	—	—	一般消費財・サービス	
LI & FUNG LTD	1,520	—	—	—	一般消費財・サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	500	570	914	12,809	不動産	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	76	93	950	13,315	情報技術	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	190	190	439	6,162	一般消費財・サービス	
NWS HOLDINGS LTD	425	425	446	6,251	資本財・サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	175	175	441	6,190	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	326.4	366.4	647	9,065	金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO	170	—	—	—	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	470	580	462	6,484	一般消費財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SWIRE PROPERTIES LTD	288	326	793	11,121	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	696.69	741.69	3,860	54,085	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	180	200	1,060	14,850	公益事業
PCCW LTD	1,170	1,170	552	7,736	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	3,212	3,730	29,243	409,697	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	330	360	1,564	21,914	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	220	662	9,277	生活必需品
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	344	959	13,446	生活必需品
SANDS CHINA LTD	644	720	2,664	37,322	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	—	—	—	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	355	410	2,412	33,804	資本財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	236	—	—	—	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	960	1,075	2,859	40,061	金融
WYNN MACAU LTD	420	420	723	10,132	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	24,758.75 39銘柄	25,296.84 34銘柄	99,098 < 1.0% >	
(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	359	348	898	72,071	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	473	497	1,254	100,657	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	136.7	149.7	137	11,034	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	395	429	288	23,123	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	140	140	108	8,714	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	104	136	140	11,279	不動産
CAPITALAND LTD	689	775	285	22,875	不動産
YANGZJIANG SHIPBUILDING	568	693	71	5,725	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	514	113	9,070	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	27	82	6,635	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	828	937	1,010	81,018	金融
GENTING SINGAPORE LTD	1,530	1,700	157	12,613	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	72	86	136	10,947	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,209.5	2,254.5	762	61,121	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	395	440	181	14,575	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	227	288	63	5,059	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,644	—	—	—	生活必需品
SATS LTD	160	196	97	7,829	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	208	233	206	16,539	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	553	648	152	12,214	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	492	589	240	19,322	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,620.2 21銘柄	11,080.2 20銘柄	6,388 < 0.4% >	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	345	345	162	11,477	公益事業
MERCURY NZ LTD	—	230	110	7,797	公益事業
A2 MILK CO LTD	190	214	332	23,458	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	526.89	239	16,895	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	294	265	18,750	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	201	201	105	7,424	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	151	187	414	29,255	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	88	118	178	12,584	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,735.89 7銘柄	2,115.89 8銘柄	1,807 < 0.1% >	

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	193	—	—	—	その他
TUI AG-DI	118.97	137.97	146	20,775	一般消費財・サービス
BP PLC	5,300	5,750	2,761	390,951	エネルギー
UNILEVER PLC	323.1	317.6	1,453	205,868	生活必需品
BARCLAYS PLC	4,500	4,968	852	120,664	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	440	527	375	53,098	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	421	561	109	15,437	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	24.8	—	—	—	その他
PRUDENTIAL PLC	690	757	1,042	147,538	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,267.91	1,457.91	329	46,693	金融
EVRAZ PLC	—	150	55	7,866	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	49.64	60.64	174	24,676	素材
BAE SYSTEMS PLC	856	943	540	76,560	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,075.66	1,138.66	459	65,101	金融
AVEVA GROUP PLC	—	20	91	12,907	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,309.02	1,410	2,473	350,171	ヘルスケア
INFORMA PLC	320	362	286	40,563	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	115	105.4	119	16,905	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,263	1,455	334	47,300	資本財・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	93	—	—	—	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	253	283	159	22,519	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	26	28	185	26,197	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	—	135	178	25,326	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	21	187	26,537	資本財・サービス
HALMA PLC	—	110	231	32,800	情報技術
GVC HOLDINGS PLC	140	167	142	20,136	一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	330	—	—	—	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	223	—	—	—	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC	27	27	67	9,591	ヘルスケア
JD SPORTS FASHION PLC	—	130	98	14,000	一般消費財・サービス
M&G PLC	—	757	178	25,295	金融
RELX PLC	528.46	555.46	1,040	147,306	資本財・サービス
DIAGEO PLC	653	675	2,136	302,489	生活必需品
RIO TINTO PLC	314.5	322.5	1,354	191,852	素材
STANDARD CHARTERED PLC	813	821	572	81,069	金融
TESCO PLC	2,548	2,817	646	91,498	生活必需品
FRESNILLO PLC	56	—	—	—	素材
SMITH & NEPHEW PLC	235.5	264.5	457	64,826	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,066.25	3,245.25	791	112,070	素材
JOHN WOOD GROUP PLC	180	—	—	—	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	74	81.5	151	21,405	金融
SMITHS GROUP PLC	102.33	113.83	189	26,770	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	—	—	—	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	368.83	419.83	128	18,154	金融
PEARSON PLC	201.63	235.63	152	21,572	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	452.25	542.25	116	16,453	生活必需品
NEXT PLC	35.5	42	283	40,188	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	842	932	162	22,994	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	49.61	38.61	177	25,152	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	88.55	96.05	203	28,872	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	7,021.83	7,661.83	1,175	166,370	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	34.43	36.61	182	25,814	素材

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
百株	百株	千イギリス・ポンド	千円			
KINGFISHER PLC	554.11	624.11	131	18,548	一般消費財・サービス	
WPP PLC	331	384	384	54,397	コミュニケーション・サービス	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	171.27	206.27	176	24,924	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	63.33	71.33	159	22,653	公益事業	
RENTOKIL INITIAL PLC	—	540	240	34,016	資本財・サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	178.5	203	1,231	174,353	生活必需品	
ST JAMES'S PLACE PLC	136	151.5	164	23,349	金融	
SCHRODERS PLC	30.5	34.5	113	16,115	金融	
SSE PLC	264	300	390	55,220	公益事業	
WEIR GROUP PLC/THE	61.5	79.5	110	15,708	資本財・サービス	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	259	310	206	29,267	一般消費財・サービス	
ASTRAZENECA PLC	334	370.5	2,763	391,239	ヘルスケア	
FERGUSON PLC	62.37	70.87	476	67,451	資本財・サービス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,551	1,830	514	72,783	金融	
3I GROUP PLC	253.91	293.91	314	44,569	金融	
ASHTED GROUP PLC	127	136.5	320	45,418	資本財・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	276.14	323.14	243	34,488	情報技術	
NATIONAL GRID PLC	900.34	981.34	873	123,621	公益事業	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	19,199.65	20,814.65	1,272	180,217	金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	262.6	317.6	175	24,795	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	254	288	490	69,452	生活必需品	
CENTRICA PLC	1,526.6	1,761.6	141	20,008	公益事業	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32	36	165	23,375	一般消費財・サービス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	605.1	650.1	1,989	281,665	生活必需品	
BHP GROUP PLC	565.77	605.27	1,035	146,547	素材	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	91	106	272	38,556	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	5,302.5	5,716.5	3,294	466,456	金融	
SHIRE PLC	243.24	—	—	—	その他	
ANGLO AMERICAN PLC	328.83	310.83	629	89,187	素材	
MONDI PLC	93.5	142.5	238	33,805	素材	
WM MORRISON SUPERMARKETS	593	663	131	18,615	生活必需品	
CARNIVAL PLC	48.61	48.61	158	22,389	一般消費財・サービス	
EASYJET PLC	40	40	53	7,577	資本財・サービス	
COMPASS GROUP PLC	422.39	464.89	880	124,703	一般消費財・サービス	
PERSIMMON PLC	85	93	237	33,683	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	2,224	2,461	471	66,749	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	52	58	149	21,179	生活必需品	
BURBERRY GROUP PLC	113.39	121.89	256	36,311	一般消費財・サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	46.36	51.36	257	36,411	一般消費財・サービス	
TRAVIS PERKINS PLC	69	—	—	—	資本財・サービス	
INTERTEK GROUP PLC	44	48	264	37,488	資本財・サービス	
ITV PLC	931	1,021	148	20,976	コミュニケーション・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	83.49	91.99	632	89,506	金融	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,217	1,233	2,726	385,997	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	995.68	1,057.18	2,314	327,737	エネルギー	
MEGGITT PLC	195	241	154	21,941	資本財・サービス	
G4S PLC	378	435	90	12,878	資本財・サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	49.5	55.5	118	16,816	金融	
INVESTEC PLC	183	—	—	—	金融	
ANTOFAGASTA PLC	98	114	98	14,010	素材	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	587.62	708.62	224	31,795	金融	
EXPERIAN PLC	240.54	261.54	670	94,911	資本財・サービス	
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	79,841.11	87,608.13	51,516	7,294,232	
	銘柄数 < 比率 >	96銘柄	93銘柄		< 5.4% >	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	柄	期首		期末		業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円		
<b>(イスラエル)</b>							
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		—	345	548	17,312	金融	
AZRIELI GROUP LTD		10	10	272	8,606	不動産	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		483	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ISRAEL CHEMICALS LTD		176	176	280	8,865	素材	
ELBIT SYSTEMS LTD		6	6	339	10,700	資本財・サービス	
BANK HAPOALIM BM		266	307	848	26,789	金融	
BANK LEUMI LE-ISRAEL		410	452	1,125	35,534	金融	
NICE LTD		16.5	18.5	962	30,360	情報技術	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		30	41	373	11,775	金融	
イスラエル・シケル通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,397.5 8銘柄	1,355.5 8銘柄	4,751	149,944 <0.1%>	
		百株	百株	千スイス・フラン	千円		
<b>(スイス)</b>							
DUFREY AG-REG		8.5	12.5	121	13,367	一般消費財・サービス	
UBS GROUP AG-REG		1,022.5	1,104	1,338	146,636	金融	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2	2.3	142	15,640	素材	
ADECCO GROUP AG-REG		42.5	46.5	287	31,503	資本財・サービス	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		185.2	199.4	6,145	673,486	ヘルスケア	
PARGESA HOLDING SA-BR		9.5	11	86	9,511	金融	
SIKA AG-REG		33.6	38.4	668	73,244	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	0.03	255	28,044	生活必需品	
ABB LTD-REG		487	538	1,176	128,944	資本財・サービス	
SWISS RE AG		84	90	974	106,817	金融	
NESTLE SA-REG		820	869	9,030	989,668	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG		4.5	5.2	438	48,051	金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		10.5	12.6	314	34,424	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		671.2	751.7	985	107,957	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD		59	64	301	33,020	金融	
SGS SA-REG		1.4	1.6	416	45,624	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		5	5.8	138	15,204	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG		12	13	231	25,401	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG		15.5	19.7	298	32,750	情報技術	
ALCON INC		—	124.3	686	75,207	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-BR		8.5	8.5	238	26,082	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		40.22	44.72	1,754	192,260	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG		13	13.9	241	26,474	金融	
CLARIANT AG-REG		57	57	117	12,905	素材	
NOVARTIS AG-REG		574	610.5	5,620	615,924	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.6	0.7	140	15,419	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		139.6	153.1	1,166	127,782	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG		7.1	7.7	398	43,677	コミュニケーション・サービス	
GEBERIT AG-REG		9.9	11.3	606	66,475	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG		2.5	2.6	764	83,742	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG		2.7	2.9	278	30,573	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG		14.2	16.9	385	42,282	ヘルスケア	
LONZA GROUP AG-REG		20.1	22	747	81,876	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG		15.2	15.2	81	8,878	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		127.9	142.9	736	80,745	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		9	10.4	515	56,508	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		14.9	16.7	271	29,758	資本財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
SWISS PRIME SITE-REG CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	百株 20.3 0.29	百株 23.3 0.34	千スイス・フラン 246 259	千円 26,964 28,411	不動産 生活必需品	
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,550.94 38銘柄	5,069.69 39銘柄	38,609	4,231,250 <3.2%>	
<b>(デンマーク)</b>		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	482	506	19,288	311,898	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	188	184	1,684	27,241	金融	
ISS A/S	44	44	684	11,074	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	0.95	836	13,525	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S	17	17	441	7,141	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52.5	56	3,614	58,442	資本財・サービス	
CARLSBERG AS-B	27.5	30	2,926	47,326	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	58	64	2,073	33,530	素材	
COLOPLAST-B	31	33.5	2,684	43,400	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	50.1	62.1	4,585	74,146	資本財・サービス	
DEMANT A/S	26.75	34.25	710	11,491	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.7	2	1,895	30,651	資本財・サービス	
TRYG A/S	33	33	643	10,405	金融	
PANDORA A/S	27.5	31.5	859	13,905	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	25.5	30.5	1,570	25,399	素材	
GENMAB A/S	17	19.5	3,081	49,819	ヘルスケア	
ORSTED A/S	50.5	55	3,437	55,584	公益事業	
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,133 17銘柄	1,203.3 17銘柄	51,019	824,985 <0.6%>	
<b>(ノルウェー)</b>		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	352	417	1,359	16,177	素材	
DNB ASA	261.5	281	4,349	51,763	金融	
ORKLA ASA	208.5	219.5	1,959	23,315	生活必需品	
TELENOR ASA	199	208	3,498	41,632	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	312.23	279.73	4,749	56,522	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	45.6	49.6	1,723	20,510	素材	
MOWI ASA	110.5	128.5	2,937	34,956	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48.5	55.5	962	11,455	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	24	31	736	8,765	コミュニケーション・サービス	
AKER BP ASA	29	29	766	9,120	エネルギー	
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,590.83 10銘柄	1,698.83 10銘柄	23,043	274,220 <0.2%>	
<b>(スウェーデン)</b>		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	19	27	1,128	12,933	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	811.3	856.3	7,389	84,687	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	421	414	6,129	70,241	資本財・サービス	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	18	18	771	8,837	コミュニケーション・サービス	
SKF AB-B SHARES	97.5	105.5	1,929	22,113	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	59.5	66.5	1,636	18,755	一般消費財・サービス	
SWEDISH MATCH AB	46	49	2,247	25,757	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	137	156	2,204	25,261	コミュニケーション・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	430.5	482.5	3,962	45,407	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	410.5	465.5	4,375	50,145	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	235	266	3,317	38,013	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	235.5	235.5	4,352	49,885	一般消費財・サービス	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
SKANSKA AB-B SHS	91.5	102.5	2,168	24,855	資本財・サービス	
SANDVIK AB	298.5	331.5	5,773	66,159	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	123	127	6,428	73,673	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	173.5	184.5	6,474	74,193	資本財・サービス	
SECURITAS AB-B SHS	84.5	95.5	1,516	17,379	資本財・サービス	
TELIA CO AB	770	830	3,440	39,426	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	77	88	2,073	23,759	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	103	112.5	3,483	39,915	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	268.5	293.5	6,674	76,486	資本財・サービス	
LUNDBERGS AB-B SHS	18	22	835	9,570	金融	
LUNDIN PETROLEUM AB	46.5	52.5	1,549	17,760	エネルギー	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	157	168.5	5,071	58,123	生活必需品	
BOLIDEN AB	70	78	1,926	22,078	素材	
EPIROC AB-A	179.5	206.5	2,308	26,457	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	97	116	1,248	14,310	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	114.5	114.5	856	9,812	一般消費財・サービス	
NORDEA BANK ABP	794	897	6,084	69,726	金融	
KINNEVIK AB - B	60.5	73	1,600	18,346	金融	
HEXAGON AB-B SHS	69	72	3,898	44,671	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	46	46	1,021	11,708	金融	
スウェーデン・クロネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,562.3 32銘柄	7,152.8 32銘柄	103,879	1,190,454 <0.9%>	
<b>ユーロ (アイルランド)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	60	68	218	26,463	素材	
AIB GROUP PLC	230	230	68	8,255	金融	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	274.6	274.6	125	15,133	金融	
KINGSPAN GROUP PLC	—	44	215	26,014	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	42.2	45.7	531	64,291	生活必需品	
CRH PLC	227	231	802	96,961	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	22	22	228	27,652	一般消費財・サービス	
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	855.8 6銘柄	915.3 7銘柄	2,190	264,773 <0.2%>	
<b>ユーロ (オランダ)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.	59.98	64.98	252	30,518	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	245.26	264.26	1,113	134,604	ヘルスケア	
NN GROUP NV	80.5	90.5	315	38,107	金融	
UNILEVER NV-CVA	411	—	—	—	その他	
HEINEKEN NV	67	76	714	86,379	生活必需品	
AEGON NV	447.44	536.44	219	26,530	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	334.83	336.33	786	95,057	生活必需品	
AKZO NOBEL N. V.	66	65.38	568	68,682	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	47.5	53	616	74,496	素材	
WOLTERS KLUWER	78	83	540	65,364	資本財・サービス	
ING GROEP NV	1,034.5	1,110.5	1,159	140,174	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	842.5	1,009.5	282	34,113	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	109	120.6	2,978	360,020	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	110.5	117	181	21,903	金融	
ADYEN NV	—	3	208	25,242	情報技術	
UNILEVER NV	—	416	2,238	270,494	生活必需品	
PROSUS NV	—	145	897	108,425	一般消費財・サービス	
VOPAK	19	19	91	11,111	エネルギー	

銘柄	株数	首 株数	当		期 末		業 種 等
			株数	株数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円		
RANDSTAD NV	32	32	169	20,443	資本財・サービス		
HEINEKEN HOLDING NV	31.5	34	295	35,750	生活必需品		
ALTICE EUROPE NV	—	205	110	13,384	コミュニケーション・サービス		
STMICROELECTRONICS NV	185.5	199.5	444	53,768	情報技術		
AIRBUS SE	154.5	165.5	2,207	266,831	資本財・サービス		
EXOR NV	28.8	32.3	224	27,107	金融		
CNH INDUSTRIAL NV	272	298	289	35,036	資本財・サービス		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	285.5	323.5	434	52,469	一般消費財・サービス		
FERRARI NV	31.45	34.95	536	64,797	一般消費財・サービス		
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,974.26 23銘柄	5,835.24 26銘柄	17,878	2,160,816	<1.6%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円		
<b>ユーロ (ベルギー)</b>							
GALAPAGOS NV	—	13	232	28,100	ヘルスケア		
UCB SA	32.5	35.5	261	31,561	ヘルスケア		
KBC GROUP NV	65	74.5	492	59,552	金融		
COLRUYT SA	16	16	75	9,088	生活必需品		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	20	22	202	24,488	金融		
SOLVAY SA	19.5	22	228	27,652	素材		
UMICORE	54	58	226	27,324	素材		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	203.5	216	1,552	187,622	生活必需品		
AGEAS	49.4	52.4	285	34,502	金融		
PROXIMUS	41	41	112	13,567	コミュニケーション・サービス		
TELENET GROUP HOLDING NV	14.5	14.5	59	7,178	コミュニケーション・サービス		
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	515.4 10銘柄	564.9 11銘柄	3,728	450,639	<0.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円		
<b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>							
AROUNDTOWN SA	—	271	213	25,815	不動産		
RTL GROUP	10	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
ARCELORMITTAL	177	203	315	38,097	素材		
EUROFINS SCIENTIFIC	2.9	3.2	152	18,432	ヘルスケア		
SES	97	110	132	16,013	コミュニケーション・サービス		
TENARIS SA	120	133	128	15,514	エネルギー		
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	406.9 5銘柄	720.2 5銘柄	942	113,874	<0.1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円		
<b>ユーロ (フランス)</b>							
JCDECAUX SA	19	19	49	5,970	コミュニケーション・サービス		
TOTAL SA	636.5	679.5	3,237	391,240	エネルギー		
MICHELIN (CGDE)	45	50	544	65,808	一般消費財・サービス		
AIR LIQUIDE SA	112.92	134.77	1,658	200,427	素材		
KERING	19.8	21.8	1,191	144,041	一般消費財・サービス		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	145	156.5	1,370	165,691	資本財・サービス		
BOUYGUES SA	56	67	248	30,025	資本財・サービス		
BNP PARIBAS	299	320.5	1,633	197,435	金融		
PEUGEOT SA	154.5	175.5	384	46,494	一般消費財・サービス		
NATIXIS	253.5	295.5	112	13,546	金融		
THALES SA	28.5	32.3	287	34,712	資本財・サービス		
DANONE	162	176	1,315	158,939	生活必需品		
CARREFOUR SA	158	170	254	30,778	生活必需品		
SUEZ	99.25	99.25	133	16,115	公益事業		
VIVENDI	279.91	268.91	670	80,991	コミュニケーション・サービス		
L'OREAL	67.3	71.7	1,854	224,180	生活必需品		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	130.5	145.5	534	64,625	資本財・サービス	
LEGRAND SA	72.17	80.17	574	69,453	資本財・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	15.5	15.5	61	7,482	生活必需品	
PERNOD RICARD SA	56.17	60.87	1,014	122,636	生活必需品	
SOCIETE BIC SA	7	—	—	—	資本財・サービス	
EURAZEO SE	11.95	12.54	77	9,373	金融	
REXEL SA	78.5	—	—	—	資本財・サービス	
SOCIETE GENERALE SA	200.5	220.5	629	76,111	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	73.5	79.3	3,229	390,364	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	49.5	53.5	207	25,107	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	42.2	47.7	512	61,887	情報技術	
VALEO SA	64	71.5	255	30,901	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	56	64	255	30,893	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	71	88	209	25,270	資本財・サービス	
EIFFAGE	21.4	23.4	231	28,026	資本財・サービス	
SODEXO SA	25	27	285	34,524	一般消費財・サービス	
IPSEN	10	11.5	117	14,246	ヘルスケア	
INGENICO GROUP	16	18	174	21,071	情報技術	
AMUNDI SA	15	17	116	14,115	金融	
TELEPERFORMANCE	15	17.7	380	45,993	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	20	24.5	134	16,315	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA	19	22.5	108	13,090	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	—	8	115	13,932	ヘルスケア	
SEB SA	5.6	6.5	91	11,076	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	54.3	83	1,170	141,442	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	0.7	0.8	98	11,940	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	—	23.64	138	16,785	情報技術	
AXA SA	518	553.5	1,366	165,199	金融	
EDENRED	64	69	310	37,568	資本財・サービス	
RENAULT SA	50	58	252	30,461	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	8.6	9	612	73,966	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	5.5	6.3	73	8,900	生活必需品	
ATOS SE	25	29.6	228	27,575	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SA	33.8	39.8	569	68,786	情報技術	
WENDEL	6.8	7.8	95	11,529	金融	
ORANGE	536.5	583	874	105,692	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	40.5	44.5	176	21,287	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	43	48.5	86	10,504	金融	
SANOFI	296.75	318.75	2,693	325,567	ヘルスケア	
VINCI SA	134.5	145.5	1,440	174,057	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	144.5	164.5	382	46,204	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	301	343	425	51,466	金融	
BIOMERIEUX	11.5	11.5	94	11,404	ヘルスケア	
ENGIE	478.73	521.23	748	90,462	公益事業	
IMERYS SA	9	—	—	—	素材	
EDF	159.5	170.5	158	19,213	公益事業	
SAFRAN SA	88	93.2	1,383	167,216	資本財・サービス	
ILIAD SA	6.5	7.4	85	10,334	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA	17.7	19.2	180	21,826	素材	
ADP	8.1	9.1	161	19,521	資本財・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	47	47	69	8,458	コミュニケーション・サービス	
SCOR SE	41.5	49.5	193	23,326	金融	
GETLINK SE	124	124	189	22,944	資本財・サービス	
BOLLORE	241	241	93	11,301	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,107.65 68銘柄	7,675.23 67銘柄	38,621	4,667,848 <3.5%>	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (ドイツ)</b>					
BAYER AG-REG	246.7	268.2	1,842	222,688	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	42.5	53	139	16,872	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	531.5	593.5	388	46,940	金融
COMMERZBANK AG	263.35	281.35	148	17,889	金融
VOLKSWAGEN AG	8.9	8.9	154	18,624	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	49.7	52.7	924	111,768	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	202	217.5	2,547	307,873	資本財・サービス
E.ON SE	591	642	609	73,696	公益事業
UNIPER SE	53.5	59.5	174	21,070	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	86.5	98.5	722	87,261	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	45	45	131	15,864	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	25.6	—	—	—	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	29.7	31.7	375	45,438	一般消費財・サービス
BASF SE	244.2	261.7	1,785	215,773	素材
K+S AG-REG	48	—	—	—	素材
ALLIANZ SE-REG	116.3	120.4	2,616	316,277	金融
THYSSENKRUPP AG	114.5	114.5	130	15,748	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	46.5	52	498	60,257	生活必需品
RWE AG	141.5	162.5	437	52,850	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	61	66.5	114	13,840	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	10	11.8	91	11,026	資本財・サービス
BRENNTAG AG	39.5	47	227	27,498	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	112.5	122	605	73,193	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	33.2	102	12,338	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	5.3	7.1	79	9,567	資本財・サービス
SAP SE	261.42	279.92	3,456	417,746	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	39.8	41.6	1,084	131,023	金融
SCHAEFFLER AG - PREF	38	—	—	—	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	29	35.5	138	16,775	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	39	45	301	36,493	素材
KION GROUP AG	18.5	18.5	111	13,464	資本財・サービス
WIRECARD AG	30.7	34.7	415	50,242	情報技術
COVESTRO AG	52	52	221	26,710	素材
INNOGY SE	37.3	—	—	—	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG	9.5	10.5	200	24,276	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	40	46.5	312	37,755	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	25	32	153	18,564	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	12.5	138	16,769	ヘルスケア
METRO AG	50	50	73	8,837	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG	13	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	40	45	198	23,941	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	—	14.5	128	15,470	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	26.9	30.9	327	39,530	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	17	19.5	76	9,238	素材
MERCK KGAA	34.5	37.5	397	48,041	ヘルスケア
ADIDAS AG	49.3	51.2	1,447	174,966	一般消費財・サービス
PUMA SE	2.06	23.6	160	19,452	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	28.5	31	272	32,895	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	878	959.5	1,461	176,684	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	58.7	62.7	417	50,438	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	238.5	261	1,336	161,507	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	300.5	371.5	720	87,051	情報技術
HANNOVER RUECK SE	16.1	17.3	291	35,231	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG-REG	263.5	292	988	119,425	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	51	56.4	785	94,919	金融	
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	59.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
LANXESS AG	22	25	151	18,280	素材	
MTU AERO ENGINES AG	14.3	15.3	376	45,470	資本財・サービス	
AXEL SPRINGER SE	12	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	94	106	375	45,415	不動産	
SYMRISE AG	32	39.2	345	41,710	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	188	263	72	8,807	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	13.5	15.5	86	10,490	一般消費財・サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	15.9	—	—	—	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	132	153	723	87,446	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,419.43 63銘柄	6,899.87 57銘柄	32,595	3,939,443 <2.9%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (ポルトガル)</b>						
JERONIMO MARTINS	60	60	86	10,511	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	660	747	274	33,133	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	116.5	139.5	206	24,910	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	836.5 3銘柄	946.5 3銘柄	567	68,555 <0.1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (スペイン)</b>						
TELEFONICA SA	1,250.27	1,320.27	917	110,931	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	82.5	92.5	228	27,591	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,748.12	1,910.12	913	110,384	金融	
IBERDROLA SA	1,621.34	1,703.34	1,520	183,796	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,449.09	1,601.09	161	19,486	金融	
BANKINTER SA	183	183	116	14,040	金融	
REPSOL SA	366.5	418	597	72,192	エネルギー	
GRIFOLS SA	77.5	85	263	31,856	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	4,264.5	4,772.5	1,688	204,015	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	117	123.5	892	107,916	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	90.5	94	221	26,811	公益事業	
MAPFRE SA	254.5	306.5	78	9,479	金融	
CAIXABANK SA	941	1,093	292	35,389	金融	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	152	—	—	—	資本財・サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	67.26	78.76	278	33,630	資本財・サービス	
AENA SME SA	18.5	20	333	40,294	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	—	58	226	27,338	コミュニケーション・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	285	323	912	110,320	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	56	66.5	96	11,641	資本財・サービス	
ENAGAS SA	59	69	156	18,855	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	115	125.5	222	26,923	公益事業	
FERROVIAL SA	134	142	382	46,251	資本財・サービス	
BANKIA SA	301.05	301.05	52	6,398	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,633.63 22銘柄	14,886.63 22銘柄	10,553	1,275,547 <1.0%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (イタリア)</b>						
PRYSMIAN SPA	61.5	68.5	141	17,129	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	313.43	315.43	584	70,641	金融	
MEDIOBANCA SPA	152.65	170.65	173	20,934	金融	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNICREDIT SPA	531.56	576.56	724	87,535	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,827.82	2,629.82	149	18,059	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,469.5	1,719.5	96	11,617	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	3,962.37	4,262.37	980	118,510	金融	
ATLANTIA SPA	134.57	146.57	294	35,641	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	135	160	169	20,478	金融	
MONCLER SPA	47	51.5	204	24,754	一般消費財・サービス	
RECORDATI SPA	26	30.5	116	14,033	ヘルスケア	
ENI SPA	682	725	994	120,166	エネルギー	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	143	162	134	16,221	生活必需品	
PIRELLI & C SPA	110	110	56	6,846	一般消費財・サービス	
LEONARDO SPA	109.75	109.75	116	14,080	資本財・サービス	
ENEL SPA	2,154.34	2,307.34	1,581	191,189	公益事業	
SNAM SPA	616	616	277	33,591	公益事業	
LUXOTTICA GROUP SPA	45	—	—	—	その他	
TERNA SPA	389	428	249	30,157	公益事業	
FINCOBANK SPA	—	180	202	24,495	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,910.49 19銘柄	14,769.49 19銘柄	7,248	876,085 <0.7%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (フィンランド)</b>						
UPM-KYMMENE OYJ	137	156	472	57,165	素材	
NOKIA OYJ	1,467.5	1,585	509	61,520	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	120	120	109	13,250	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	138	170.5	208	25,140	素材	
METSO OYJ	28	28	97	11,776	資本財・サービス	
ELISA OYJ	36.5	41.5	201	24,331	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	116.5	125	458	55,444	金融	
FORTUM OYJ	122.5	138.5	296	35,804	公益事業	
KONE OYJ-B	88	99	562	67,985	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	30.5	36.5	89	10,834	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	34.5	120.5	369	44,681	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	27.5	27.5	108	13,128	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,346.5 12銘柄	2,648 12銘柄	3,483	421,063 <0.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (オーストリア)</b>						
VERBUND AG	—	20	94	11,404	公益事業	
OMV AG	35.5	44.5	230	27,827	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	74	87	282	34,173	金融	
VOESTALPINE AG	28.5	28.5	68	8,284	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	34	34	72	8,756	金融	
ANDRITZ AG	21	21	74	8,984	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	193 5銘柄	235 6銘柄	822	99,430 <0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	51,199.56 236銘柄	56,096.36 235銘柄	118,633	14,338,077 <10.7%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	293,599.53 1,242銘柄	316,681.1 1,252銘柄	—	121,306,145 <90.5%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	期 首		期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
<b>(アメリカ)</b>				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.617	3.867	829	90,938
SIMON PROPERTY GROUP INC	8.137	8.887	1,343	147,388
BOSTON PROPERTIES INC	4	4.25	588	64,579
VORNADO REALTY TRUST	4.347	5.097	329	36,097
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.05	3.15	744	81,698
EQUITY RESIDENTIAL	9.8	10.7	910	99,871
EQUINIX INC	2.088	2.288	1,296	142,249
AMERICAN TOWER CORP	11.45	12.45	2,664	292,261
HOST HOTELS & RESORTS INC	20.043	21.943	383	42,093
KIMCO REALTY CORP	11.1	12.6	272	29,878
INVITATION HOMES INC	8.3	12.7	387	42,526
VICI PROPERTIES INC	—	13.5	333	36,617
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6.279	—	—	—
VENTAS INC	9.15	10.5	612	67,152
WEYERHAEUSER CO	20.064	21.164	624	68,500
AGNC INVESTMENT CORP	12.3	15.3	264	29,064
CROWN CASTLE INTL CORP	10.9	11.75	1,570	172,252
IRON MOUNTAIN INC	6.76	8.21	263	28,923
VEREIT INC	24.4	29.3	285	31,364
SUN COMMUNITIES INC	—	2.75	452	49,679
PROLOGIS INC	16.412	17.812	1,630	178,853
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2.72	3.07	498	54,723
CAMDEN PROPERTY TRUST	2.35	2.9	323	35,480
DUKE REALTY CORP	9.4	10.2	358	39,357
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.7	1.95	608	66,767
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.85	2.2	290	31,867
WELLTOWER INC	9.7	11.45	968	106,206
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12.4	14.35	500	54,897
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.95	4.4	271	29,737
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	3.25	442	48,517
MACERICH CO/THE	2.9	—	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	4.8	355	39,000
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	33.6	43.7	407	44,718
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4.15	4.55	253	27,816
REALTY INCOME CORP	7.55	8.9	682	74,802
PUBLIC STORAGE	4.15	4.37	920	100,979
REGENCY CENTERS CORP	4.05	4.95	321	35,311
SL GREEN REALTY CORP	2.4	2.4	204	22,461
UDR INC	6.8	8.1	389	42,688
WP CAREY INC	4.3	5.1	425	46,662
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	6.4	268	29,503
DIGITAL REALTY TRUST INC	5.5	6.05	731	80,258
EXTRA SPACE STORAGE INC	3.25	3.75	397	43,618
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	13	269	29,600
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	317.917 39銘柄	398.058 42銘柄	25,683 <2.1%>
<b>(カナダ)</b>				
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1.5	2.1	67	5,557
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	2.4	133	10,993
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3.7	3.7	79	6,596
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3.9	4.7	127	10,538
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.1 3銘柄	12.9 4銘柄	407 <0.0%>

銘	柄	期 首		期 末	
		□ 数	□ 数	評 価	額
		千□	千□	外貨建金額	邦貨換算金額
				千オーストラリア・ドル	千円
<b>(オーストラリア)</b>					
LENLEASE GROUP		14.9	17	328	24,374
TRANSURBAN GROUP		68.1	76.5	1,174	87,189
SYDNEY AIRPORT		30.3	33.3	305	22,697
APA GROUP		31.2	35.8	393	29,239
SCENTRE GROUP		143.322	153.922	606	45,029
DEXUS		25.85	33.15	405	30,102
GPT GROUP		47.56	56.16	345	25,644
MIRVAC GROUP		98.8	111.6	376	27,924
STOCKLAND		66	72	363	26,997
GOODMAN GROUP		43.9	50.1	742	55,129
VICINITY CENTRES		89.273	99.273	266	19,754
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	659.205 11 銘柄	738.805 11 銘柄	5,307	394,083 <0.3%>
<b>(香港)</b>					
LINK REIT		57	62.5	5,000	70,050
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		64.5	75	575	8,059
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		99	107	1,228	17,209
香 港 ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	220.5 3 銘柄	244.5 3 銘柄	6,803	95,318 <0.1%>
<b>(シンガポール)</b>					
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		70.1	79.6	159	12,833
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		69.5	76	226	18,165
CAPITALAND MALL TRUST		63.2	77.2	194	15,604
SUNTEC REIT		63	63	115	9,297
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	65.5	154	12,398
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	265.8 4 銘柄	361.3 5 銘柄	851	68,300 <0.1%>
<b>(イギリス)</b>					
LAND SECURITIES GROUP PLC		19.662	21.662	207	29,395
SEGRO PLC		25.75	33.15	296	41,961
HAMMERSON PLC		19.2	—	—	—
BRITISH LAND CO PLC		23.4	25.55	147	20,823
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	88.012 4 銘柄	80.362 3 銘柄	651	92,180 <0.1%>
<b>ユーロ (フランス)</b>					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3.61	3.95	560	67,742
ICADE		0.8	0.95	86	10,431
GECINA SA		1.25	1.4	219	26,531
KLEPIERRE		5.65	6.25	203	24,602
COVIVIO		0.97	1.27	127	15,410
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	12.28 5 銘柄	13.82 5 銘柄	1,197	144,718 <0.1%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,572.814 69 銘柄	1,849.745 73 銘柄	—	3,645,255 <2.7%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(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 S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	6,654	—
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	336	—
SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	190	—
国 FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	479	—
SWISS MKT IX FUTR (スイス)	264	—
EURO STOXX 50 (ドイツ)	993	—

(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12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	121,306,145	90.5
投資信託証券	3,645,255	2.7
コール・ローン等、その他	9,152,768	6.8
投資信託財産総額	134,104,169	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1香港・ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=80.21円、1ニュージーランド・ドル=70.63円、1イギリス・ポンド=141.59円、1イスラエル・シェケル=31.56円、1スイス・フラン=109.59円、1デンマーク・クローネ=16.17円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローネ=11.46円、1ユーロ=120.86円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(127,572,094千円)の投資信託財産総額(134,104,169千円)に対する比率は、95.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	140,417,534,982円
コール・ローン等	6,979,983,687
株式(評価額)	121,306,145,522
投資信託証券(評価額)	3,645,255,546
未収入金	6,783,395,334
未収配当金	214,896,369
差入委託証拠金	1,487,858,524
(B)負債	6,448,920,207
未払金	6,390,634,815
未払解約金	58,281,600
その他未払費用	3,792
(C)純資産総額(A-B)	133,968,614,775
元本	48,893,612,273
次期繰越損益金	85,075,002,502
(D)受益権総口数	48,893,612,273口
1万口当り基準価額(C/D)	27,400円

\* 期首における元本額は43,964,024,902円、当作成期間中における追加設定元本額は10,527,862,672円、同解約元本額は5,598,275,301円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A466,203,951円、ダイワ国内重視バランスファンド30V A(一般投資家私募)12,135,579円、ダイワ国内重視バランスファンド50V A(一般投資家私募)136,414,008円、ダイワ国際分散バランスファンド30V A(一般投資家私募)19,175,184円、ダイワ国際分散バランスファンド50V A(一般投資家私募)467,869,193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)8,549,100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)538,132,530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)1,863,069,978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)538,513,489円、D-I's 外国株式インデックス2,768,783円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 2,115,496円、iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)1,146,595,215円、iFree 8資産バランス816,785,041円、iFree 年金バランス26,201,082円、DCダイワ 外国株式インデックス29,501,748,908円、ダイワ・ライフ・バランス30 576,429,097円、ダイワ・ライフ・バランス50 874,085,645円、ダイワ・ライフ・バランス70 675,316,597円、大和DC海外株式インデックスファンド1,500,453,033円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,017,912円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 14,368,992円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 5,760,550円、ダイワつみたてインデックス外国株式136,727,006円、ダイワつみたてインデックスバランス30 88,638円、ダイワつみたてインデックスバランス50 86,527円、ダイワつみたてインデックスバランス70 530,015円、ダイワ世界バランスファンド40V A184,271,979円、ダイワ世界バランスファンド60V A323,611,524円、ダイワ・バランスファンド35V A2,650,169,104円、ダイワ・バランスファンド25V A(適格機関投資家専用)127,631,309円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式677,239,222円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド111,772,535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)2,632,754,719円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,712,848,524円、ダイワライフスタイル25 18,663,687円、ダイワライフスタイル50 67,445,810円、ダイワライフスタイル75 54,062,311円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,400円です。

## ■損益の状況

当期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,549,233,818円
受取配当金	2,536,822,509
受取利息	2,018,549
その他収益金	11,188,012
支払利息	△ 795,252
(B) 有価証券売買損益	10,836,018,993
売買益	18,159,378,903
売買損	△ 7,323,359,910
(C) 先物取引等損益	573,606,102
取引益	720,048,944
取引損	△ 146,442,842
(D) その他費用	△ 33,986,973
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	13,924,871,940
(F) 前期繰越損益金	63,729,500,967
(G) 解約差損益金	△ 8,614,819,683
(H) 追加信託差損益金	16,035,449,278
(I) 合計 (E + F + G + H)	85,075,002,502
次期繰越損益金 (I)	85,075,002,502

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

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

# ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド

運用報告書 第9期 (決算日 2019年7月5日)

(作成対象期間 2018年7月6日～2019年7月5日)

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

## ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます。) 2. 新興国の企業のDR (預託証券) 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券)
株式組入制限	無制限

## 大和投資信託

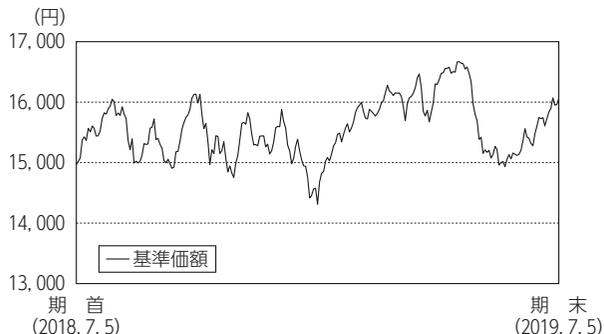
Daiwa Asset Management

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

《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：14,971円 期末：16,061円 騰落率：7.3%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、2018年7月に、米国を中心とした貿易摩擦懸念の後退などからリスク選好の動きが強まる局面があったものの、当作成期首から米中間でくすぶっている貿易問題をにらんだ一進一退の動きとなりました。その後、9月からは米中の貿易摩擦が再燃したことによる景気悪化懸念が強まり、11月には米国の利上げ終了期待で一時的に買戻されたものの、中国大手通信機器メーカーの幹部拘束による米中対立の拡大から、年末までは売りが先行する展開となりました。しかし2019年に入ると、FRB (米国連邦準備制度理事會) の利上げ終了見通しが強まったことで新興国への資金流入が進んだことや、米中貿易協議に対する期待の高まりから急反発しました。その後しばらくは落ち着いた動きとなりましたが、5月には、予想に反して米中貿易摩擦が急激に激化したことで、世界的な景気悪化懸念が広がりました。6月に入ると、G20 (主要20カ国・地域) サミットに向けて米中貿易摩擦が一時的に緩和されたことが好感され、上昇に転じて当作成期末を迎えました。

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

○為替相場

為替相場は、当作成期を通じてみると円高が進みました。

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

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

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。

年月日	基準価額		FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率						
	円	%	円	%	%	%	%	%	%
(期首)2018年7月5日	14,971	—	16,627	—	81.7	0.7	15.8		
7月末	15,933	6.4	17,764	6.8	80.8	0.6	17.0		
8月末	15,382	2.7	17,145	3.1	90.5	1.0	7.2		
9月末	16,065	7.3	17,971	8.1	87.8	1.0	10.0		
10月末	14,990	0.1	16,713	0.5	85.4	0.9	13.0		
11月末	15,599	4.2	17,435	4.9	83.6	0.9	14.9		
12月末	14,577	△ 2.6	16,237	△ 2.3	82.2	0.9	15.9		
2019年1月末	15,671	4.7	17,448	4.9	83.0	1.0	15.3		
2月末	16,155	7.9	18,097	8.8	82.6	1.0	16.1		
3月末	15,834	5.8	17,753	6.8	96.1	1.4	2.1		
4月末	16,339	9.1	18,339	10.3	95.8	0.9	3.1		
5月末	15,132	1.1	17,042	2.5	90.9	1.0	7.6		
6月末	15,834	5.8	17,795	7.0	88.2	1.3	10.0		
(期末)2019年7月5日	16,061	7.3	18,098	8.8	87.4	1.3	10.7		

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 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。

◆ポートフォリオについて

株式組入比率（D R、E T F、株価指数先物を含む。以下同じ。）は、FTSE RAFI エマージング インデックスのリバランス時や大量設定時を除き、当作成期を通じて原則として98%以上で運用を行いました。

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は8.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は7.3%となりました。

未収配当金部分等については株式の組み入れができないため、当作成期を通じて、株式組入比率を基本的に98~99%台で推移させました。その結果、ベンチマークの変動に対するかい離が発生しました。

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

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

《今後の運用方針》

主として、新興国の株式（D Rを含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすE T Fにも一部投資します。なお、株式およびE T Fの組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、株式実質組入比率の維持を目的に新興国株式市場を対象とした株価指数先物取引も利用します。

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 (株式)	11円 ( 7)
(先物・オプション)	( 1)
(投資信託証券)	( 3)
有価証券取引税 (株式)	7 ( 7)
(投資信託証券)	( 0)
その他費用 (保管費用)	31 ( 26)
(その他)	( 5)
合 計	49

(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7月6日から2019年7月5日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 2,744.92 ( )	千アメリカ・ドル 2,836 ( )	百株 1,387.6	千アメリカ・ドル 529
	香港	百株 87,165 ( )	千香港・ドル 64,412 (△ )	百株 20,886.12	千香港・ドル 9,574
	シンガポール	百株 152 ( )	千シンガポール・ドル 21 ( )	百株 —	千シンガポール・ドル —
	台湾	百株 14,150 (△ )	千台湾・ドル 77,288 (△ )	百株 11,691.5	千台湾・ドル 30,375
	トルコ	百株 5,185.7 ( )	千トルコ・リラ 3,991 ( )	百株 —	千トルコ・リラ —
	メキシコ	百株 8,091 ( )	千メキシコ・ペソ 18,483 ( )	百株 307.75	千メキシコ・ペソ 1,409
	チリ	百株 8,227.9 ( )	千チリ・ペソ 147,370 ( )	百株 12.13	千チリ・ペソ 26,294
	インド	百株 5,242.3 ( )	千インド・ルピー 158,823 ( )	百株 431.9	千インド・ルピー 9,917
	インドネシア	百株 13,941 ( )	千インドネシア・ルピア 6,018,593 ( )	百株 818	千インドネシア・ルピア 200,622
	ブラジル	百株 3,712 ( )	千ブラジル・リアル 9,171 (△ )	百株 1,180	千ブラジル・リアル 3,001
国	マレーシア	百株 6,148 ( )	千マレーシア・リンギット 1,470 (△ )	百株 3,109	千マレーシア・リンギット 1,531
	南アフリカ	百株 3,392.4 ( )	千南アフリカ・ランド 30,367 (△ )	百株 525.3	千南アフリカ・ランド 2,336
	タイ	百株 4,854 ( )	千タイ・バーツ 22,535 ( )	百株 672	千タイ・バーツ 3,783
	ポーランド	百株 161.8 ( )	千ポーランド・ズロチ 475 ( )	百株 803.6	千ポーランド・ズロチ 2,657

(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

(2018年7月6日から2019年7月5日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外	千口 736 ( ー )	千アメリカ・ドル 15,309 ( ー )	千口 773 ( ー )	千アメリカ・ドル 16,523 ( ー )
	千口 171.87 ( ー )	千トルコ・リラ 290 ( ー )	千口 — ( ー )	千トルコ・リラ — ( ー )
国	千口 29.1 ( ー )	千メキシコ・ペソ 799 ( △ 36 )	千口 — ( ー )	千メキシコ・ペソ — ( ー )
	千口 84.32 ( ー )	千南アフリカ・ランド 1,292 ( ー )	千口 — ( ー )	千南アフリカ・ランド — ( ー )

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2018年7月6日から2019年7月5日まで)

当 期				期 付			
買	付			売	付		
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	千株 1,223	千円 120,776	円 98	LENOVO GROUP LTD (香港)	千株 428	千円 41,580	円 97
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	1,094	91,600	83	GAZPROM PJSC-SPON ADR (ロシア)	78.05	40,243	515
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	99	87,821	887	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	82	20,700	252
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	1,208	62,394	51	POLSKI KONCERN NAFTOWY Orlen (ポーランド)	6.19	18,300	2,956
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島)	2.6	51,915	19,967	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	22.3	17,776	797
SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR (ロシア)	35.86	50,578	1,410	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF (ブラジル)	39.3	16,388	417
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	450	44,144	98	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	17.5	15,359	877
VALE SA (ブラジル)	29.4	42,337	1,440	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE (ポーランド)	12.26	14,875	1,213
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	7.8	39,718	5,092	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT (台湾)	64.964	14,633	225
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	30	35,267	1,175	CNOOC LTD (香港)	70	13,972	199

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2018年7月6日から2019年7月5日まで)

当 期				期 付			
買	付			売	付		
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	千口 736	千円 1,696,781	円 2,305	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	千口 773	千円 1,832,185	円 2,370
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI (トルコ)	171.87	5,788	33				
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	30.3	5,755	189				
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	29.1	4,598	158				
REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	54.02	4,057	75				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
<b>(アメリカ)</b>						
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	151	164	111	12,068	エネルギー	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	8	34	593	64,085	一般消費財・サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	4	20	237	25,587	コミュニケーション・サービス	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	—	88	76	8,223	一般消費財・サービス	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	168.5	264.5	237	25,602	コミュニケーション・サービス	
JD.COM INC-ADR	10	79	248	26,853	一般消費財・サービス	
NETEASE INC-ADR	1	5	132	14,328	コミュニケーション・サービス	
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	8	36	139	15,030	一般消費財・サービス	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	797.14	893.06	120	12,961	金融	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	—	18.3	45	4,889	素材	
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	32.9	39.5	283	30,595	エネルギー	
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	140.5	155.3	64	7,011	エネルギー	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	67	104.9	236	25,503	素材	
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	120.2	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	107.6	187	279	30,167	生活必需品	
MEGAFON-REG S GDR	61.8	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
RUSHYDRO PJSC-ADR	329.1	606.1	56	6,069	公益事業	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	345.9	704.5	1,097	118,481	金融	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8.6	9.3	192	20,813	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	122.7	158.8	1,363	147,130	エネルギー	
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	380.4	462.7	308	33,263	エネルギー	
GAZPROM PJSC-SPON ADR	2,194.7	1,879.6	1,503	162,262	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	39.3	61.8	103	11,143	素材	
TATNEFT PJSC - PREF	20	45.4	46	5,063	エネルギー	
ALROSA PJSC	315.9	391.8	53	5,794	素材	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	175.09	328.09	48	5,259	金融	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	177	—	—	—	エネルギー	
AEROFLOT PJSC	—	407	70	7,652	資本財・サービス	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,786.33 25銘柄	7,143.65 25銘柄	7,653 <11.1%>	825,844	
<b>(香港)</b>						
		百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	665	950	902	12,508	資本財・サービス	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,030	1,650	973	13,492	資本財・サービス	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	200	240	325	4,510	資本財・サービス	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	125	160	348	4,834	情報技術	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	150	450	609	8,444	一般消費財・サービス	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	—	410	307	4,261	資本財・サービス	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	280	140	513	7,121	生活必需品	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	320	600	612	8,482	素材	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	8,478	12,978	6,800	94,254	エネルギー	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	90	100	407	5,641	公益事業	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	560	760	510	7,078	一般消費財・サービス	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	3,650	—	—	—	一般消費財・サービス	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	—	560	336	4,664	資本財・サービス	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	—	135	377	5,229	資本財・サービス	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	280	610	646	8,961	資本財・サービス	
TENCENT HOLDINGS LTD	48	126	4,536	62,868	コミュニケーション・サービス	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	4,460	4,580	1,781	24,693	コミュニケーション・サービス	
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	920	—	—	—	一般消費財・サービス	
AIR CHINA LTD-H	—	420	341	4,732	資本財・サービス	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	1,260	2,100	1,795	24,885	コミュニケーション・サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	270	410	994	13,780	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	660	1,500	742	10,291	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	600	600	674	9,347	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	4,920	6,860	2,915	40,408	エネルギー
CNOOC LTD	3,750	3,960	5,282	73,217	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	—	640	343	4,754	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	1,620	1,880	883	12,246	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	105	170	839	11,639	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	690	840	432	5,995	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	18,680	30,910	19,473	269,899	金融
CHINA MOBILE LTD	1,065	1,305	9,291	128,781	コミュニケーション・サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	158	330	696	9,650	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,960	3,420	1,532	21,235	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	—	306	282	3,914	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	168	—	—	—	金融
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	1,760	2,790	382	5,297	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	60	100	587	8,135	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,040	1,560	731	10,140	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	680	1,120	1,852	25,675	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	—	220	286	3,976	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	216	276	752	10,424	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	340	540	1,919	26,607	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	110	190	410	5,688	一般消費財・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	200	580	428	5,940	エネルギー
BYD CO LTD-H	40	80	384	5,322	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,740	10,080	3,286	45,545	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	81	151	573	7,942	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,950	1,820	562	7,794	金融
CITIC LTD	640	1,220	1,363	18,904	資本財・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,240	2,150	387	5,363	金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	14,000	24,940	13,916	192,882	金融
LEGEND HOLDINGS CORP-H	148	—	—	—	情報技術
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	320	—	—	—	ヘルスケア
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	47.12	—	—	—	資本財・サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	—	3,860	845	11,716	コミュニケーション・サービス
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	—	740	327	4,543	素材
GUANGDONG INVESTMENT LTD	280	300	481	6,677	公益事業
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	520	780	2,289	31,729	不動産
CRRC CORP LTD - H	—	640	418	5,801	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,030	1,670	1,157	16,040	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,400	1,850	408	5,666	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	335	635	6,118	84,798	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	100	210	819	11,351	不動産
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,980	—	—	—	不動産
BAIC MOTOR CORP LTD-H	—	680	354	4,910	一般消費財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,510.8	2,670.8	1,447	20,063	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	410	1,240	1,485	20,589	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	—	80	443	6,148	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	113	253	795	11,028	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	—	920	283	3,927	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	—	380	326	4,518	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	—	40	438	6,081	一般消費財・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,200	2,020	1,725	23,909	金融

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等		
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千香港・ドル	千円			
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	465	1,000	601	8,329	一般消費財・サービス		
WEICHAI POWER CO LTD-H	—	410	537	7,455	資本財・サービス		
CHINA POWER INTERNATIONAL	1,930	—	—	—	公益事業		
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	350	—	—	—	資本財・サービス		
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD-H	1,000	1,880	505	7,009	素材		
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	266	478	1,474	20,438	金融		
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	—	244	372	5,167	ヘルスケア		
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	700	1,240	2,467	34,200	金融		
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	60	74	601	8,333	公益事業		
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	—	380	266	3,697	素材		
KUNLUN ENERGY CO LTD	620	680	463	6,418	公益事業		
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	236	508	829	11,490	不動産		
CHINA OILFIELD SERVICES-H	—	440	334	4,640	エネルギー		
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	—	1,140	355	4,929	素材		
LENOVO GROUP LTD	3,540	—	—	—	情報技術		
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	—	460	373	5,170	資本財・サービス		
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,400	1,940	1,396	19,359	素材		
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,121	2,961	1,770	24,541	金融		
CHINA EVERGRANDE GROUP	270	380	845	11,718	不動産		
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	700	—	—	—	不動産		
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	320	520	576	7,985	不動産		
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	590	—	—	—	金融		
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3,100	4,650	202	2,803	情報技術		
CHINA MERCHANTS BANK-H	480	765	2,933	40,662	金融		
BANK OF CHINA LTD-H	18,050	30,130	9,942	137,808	金融		
SOHO CHINA LTD	620	—	—	—	不動産		
CITIC SECURITIES CO LTD-H	220	305	474	6,577	金融		
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	720	1,140	409	5,672	金融		
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	412	696	584	8,103	金融		
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	—	670	308	4,280	金融		
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	165	290	872	12,098	不動産		
香港・ドル通貨計	株数	金額	133,987.92	200,266.8	144,002	1,995,870	<26.7%>
	銘柄数	<比率>	82銘柄	91銘柄			
(シンガポール)			百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	325	477	72	5,732			資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計	株数	金額	325	477	72	5,732	<0.1%>
	銘柄数	<比率>	1銘柄	1銘柄			
(台湾)			百株	百株	千台湾・ドル	千円	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	—	160	1,449	5,030			情報技術
TAIWAN CEMENT	660	946	4,342	15,067			素材
ASIA CEMENT CORP	380	550	2,618	9,084			素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	539.64	—	—	—			情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	461.12	661.12	5,388	18,696			生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	446	576	6,019	20,886			素材
NAN YA PLASTICS CORP	471.4	481.4	3,499	12,144			素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	413.9	503.9	5,039	17,485			素材
WALSIN LIHWA CORP	720	930	1,381	4,792			資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	1,066.86	1,306.86	3,221	11,178			素材
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	292.55	—	—	—			一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	486.16	656.16	3,051	10,587			情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	280	340	5,270	18,286			情報技術
ACER INC	750	930	1,757	6,099			情報技術

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
百株	百株	千台湾・ドル	千円				
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	191.41	—	—	—	情報技術		
INVENTEC CORP	650	670	1,708	5,928	情報技術		
TATUNG CO LTD	470	550	1,064	3,692	一般消費財・サービス		
QUANTA COMPUTER INC	480	590	3,599	12,488	情報技術		
AU OPTRONICS CORP	3,530	2,720	2,543	8,824	情報技術		
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	504	684	7,729	26,820	コミュニケーション・サービス		
MEDIATEK INC	210.03	310.03	9,889	34,318	情報技術		
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	80	170	3,808	13,213	情報技術		
HTC CORP	182.57	—	—	—	情報技術		
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	388.22	611.87	1,569	5,445	金融		
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,064.11	1,134.11	5,029	17,453	金融		
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,136.93	1,456.93	6,191	21,486	金融		
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,170	1,720	1,603	5,562	金融		
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	851.2	1,363.34	3,599	12,489	金融		
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,488.28	1,698.28	3,048	10,577	金融		
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,049.93	1,559.93	4,866	16,888	金融		
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	991.78	1,535.75	2,203	7,647	金融		
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,830.41	3,556.77	3,364	11,675	金融		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,040	—	—	—	金融		
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,580.28	2,420.28	5,215	18,098	金融		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	952.58	962.1	2,193	7,611	金融		
LARGAN PRECISION CO LTD	—	10	3,955	13,723	情報技術		
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	100	100	1,755	6,089	情報技術		
TAIWAN MOBILE CO LTD	190	240	2,928	10,160	コミュニケーション・サービス		
WISTRON CORP	1,079.4	621.1	1,509	5,237	情報技術		
INNOLUX CORP	3,780	2,190	1,603	5,562	情報技術		
TPK HOLDING CO LTD	160	—	—	—	情報技術		
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	210	230	1,798	6,241	コミュニケーション・サービス		
PEGATRON CORP	660	470	2,570	8,921	情報技術		
CHAILEASE HOLDING CO LTD	110	142.2	1,884	6,538	金融		
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	600	618	1,282	4,449	金融		
POWERTECH TECHNOLOGY INC	114	214	1,667	5,784	情報技術		
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	140	220	2,365	8,206	エネルギー		
POU CHEN	274.4	374.4	1,465	5,086	一般消費財・サービス		
COMPAL ELECTRONICS	614.53	—	—	—	情報技術		
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,600	2,590	63,196	219,290	情報技術		
HON HAI PRECISION INDUSTRY	3,101.28	2,189.02	17,008	59,020	情報技術		
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	50	80	2,456	8,522	生活必需品		
ASUSTEK COMPUTER INC	87.6	107.6	2,453	8,512	情報技術		
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	630	750	2,550	8,848	資本財・サービス		
UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,920	4,380	6,197	21,506	情報技術		
台湾・ドル通貨計	株数金額	45,230.57	47,281.15	230,911	801,263		
	銘柄数<比率>	53銘柄	48銘柄		<10.7%>		
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円			
TURKIYE GARANTI BANKASI	368	945.5	937	18,064	金融		
AKBANK T. A. S.	408.5	1,226.92	877	16,895	金融		
TURKIYE IS BANKASI-C	411.2	995.1	626	12,074	金融		
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	194.3	439.5	580	11,181	コミュニケーション・サービス		
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	28.7	44.1	509	9,810	エネルギー		
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	197.41	507.91	395	7,610	素材		
HACI OMER SABANCI HOLDING	294.4	631.8	567	10,927	金融		
TURKIYE HALK BANKASI	294.9	722	424	8,176	金融		



ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千インド・ルピー	千円			
VODAFONE IDEA LTD	304.3	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	—	237.9	1,300	2,067	公益事業		
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	—	30.5	3,241	5,154	金融		
TECH MAHINDRA LTD	—	42.2	2,956	4,700	情報技術		
YES BANK LTD	94.5	235.2	2,263	3,599	金融		
TATA MOTORS LTD-A-DVR	87	318.2	2,567	4,082	一般消費財・サービス		
REC LTD	200.2	331.1	5,542	8,812	金融		
COAL INDIA LTD	223.2	375.7	9,433	14,999	エネルギー		
BHARTI INFRATEL LTD	72.4	114.4	3,009	4,785	コミュニケーション・サービス		
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	25.3	79	5,560	8,841	金融		
GAIL INDIA LTD	64.93	104.53	3,217	5,115	公益事業		
HINDALCO INDUSTRIES LTD	170.1	374.5	7,748	12,319	素材		
GRASIM INDUSTRIES LTD	26.4	81.2	7,645	12,156	素材		
WIPRO LTD	97.2	136.53	3,875	6,161	情報技術		
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	54.36	61.56	13,805	21,951	情報技術		
INFOSYS LTD	142	362.4	26,592	42,282	情報技術		
LARSEN & TOUBRO LTD	25.52	41.82	6,572	10,450	資本財・サービス		
TATA MOTORS LTD	227.2	845.2	13,962	22,200	一般消費財・サービス		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	75.7	124.7	28,434	45,211	金融		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	280.4	318.6	40,908	65,044	エネルギー		
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	611.95	741.75	12,394	19,707	エネルギー		
ITC LTD	163.6	236.4	6,563	10,436	生活必需品		
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	53.2	98.9	6,647	10,569	一般消費財・サービス		
HERO MOTOCORP LTD	7.7	15.3	3,987	6,339	一般消費財・サービス		
BHARTI AIRTEL LTD	150.8	386.22	14,010	22,276	コミュニケーション・サービス		
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	55.2	108.4	4,250	6,758	ヘルスケア		
HCL TECHNOLOGIES LTD	39.9	58.1	6,046	9,614	情報技術		
VEDANTA LTD	209.5	860.5	14,718	23,402	素材		
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,548.51 36銘柄	10,744.56 38銘柄	374.109	594.834 <8.0% >		
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円		
UNITED TRACTORS TBK PT	151	284	786,680	6,057	エネルギー		
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,840	3,084	2,235,900	17,216	一般消費財・サービス		
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	—	470	591,025	4,550	素材		
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	635	770	542,850	4,179	生活必需品		
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	5,292	7,956	3,381,300	26,036	コミュニケーション・サービス		
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	790	1,252	1,173,750	9,037	金融		
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	425	515	1,542,425	11,876	金融		
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,739	2,977	2,389,042	18,395	金融		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	2,987	3,015	642,195	4,944	公益事業		
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	4,675	6,605	2,899,595	22,326	金融		
ADARO ENERGY TBK PT	—	4,729	671,518	5,170	エネルギー		
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,534 9銘柄	31,657 11銘柄	16,856,280	129,793 <1.7% >		
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	12	12	56	1,600	公益事業		
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	—	17	163	4,633	金融		
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	—	46	243	6,917	金融		
CIA DE SANEAMENTO DO PA-UNIT	—	16	130	3,707	公益事業		
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	121	139	340	9,668	一般消費財・サービス		
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	863	851	2,330	66,150	エネルギー		
BANCO BRADESCO SA-PREF	527.34	781.6	3,053	86,664	金融		

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	503.24	1,073.36	3,970	112,678	金融	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	157	228	385	10,948	素材	
VALE SA	507.9	801.9	4,143	117,590	素材	
GERDAU SA-PREF	215	332	507	14,415	素材	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	673	641	1,933	54,865	エネルギー	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	646.97	390.97	586	16,632	公益事業	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	309.41	375.41	493	14,010	金融	
BRASKEM SA-PREF A	35	50	182	5,186	素材	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	56	48	179	5,097	公益事業	
BANCO DO BRASIL S. A.	372	376	2,074	58,881	金融	
COSAN SA	26	40	193	5,502	エネルギー	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	79	68	246	6,987	公益事業	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	59	58	280	7,968	公益事業	
EMBRAER SA	127	223	431	12,239	資本財・サービス	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	491	681	491	13,953	素材	
CCR SA	140	242	337	9,587	資本財・サービス	
BRF SA	129	241	824	23,411	生活必需品	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	57	76	375	10,652	公益事業	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	77	77	215	6,107	公益事業	
TIM PARTICIPACOES SA	123.26	200.26	243	6,922	コミュニケーション・サービス	
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	83	117	598	16,990	コミュニケーション・サービス	
LOJAS RENNEN S. A.	38.5	50.05	238	6,775	一般消費財・サービス	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	66	85	139	3,951	一般消費財・サービス	
JBS SA	504	490	1,150	32,651	生活必需品	
SUZANO SA	49	42.45	134	3,825	素材	
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	—	70	169	4,821	金融	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	—	79	154	4,398	公益事業	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	120	150	596	16,917	金融	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	113.08	141.08	204	5,801	不動産	
CIELO SA	99.28	347.28	243	6,899	情報技術	
HYPERA SA	—	53	156	4,441	ヘルスケア	
FIBRIA CELULOSE SA	27	—	—	—	その他	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	45	45	417	11,836	生活必需品	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	—	18	169	4,806	公益事業	
SUL AMERICA SA - UNITS	—	45	183	5,219	金融	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	56	32	59	1,677	公益事業	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	74	82	390	11,095	金融	
KLABIN SA - UNIT	66	98	162	4,608	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	70	292	573	16,283	エネルギー	
LOJAS AMERICANAS SA	19	19	25	717	一般消費財・サービス	
KROTON EDUCACIONAL SA	130	317	366	10,408	一般消費財・サービス	
BANCO BRADESCO S. A.	139.88	202.65	706	20,037	金融	
AMBEV SA	367	650	1,235	35,049	生活必需品	
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額	8,373.86	11,511.01	32,494	922,200	
	銘柄数 < 比率 >	42銘柄	49銘柄		<12.3%>	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円		
MALAYAN BANKING BHD	727	647	581	15,164	金融	
GENTING BHD	204	450	306	7,998	一般消費財・サービス	
PUBLIC BANK BERHAD	272	346	795	20,770	金融	
SIME DARBY BERHAD	699	—	—	—	資本財・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	425	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	297	391	337	8,796	素材	
GENTING MALAYSIA BHD	302	675	222	5,813	一般消費財・サービス	

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円		
IOI CORP BHD	295	—	—	—	生活必需品	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	825	737	390	10,194	金融	
SIME DARBY PLANTATION BHD	278	—	—	—	生活必需品	
TENAGA NASIONAL BHD	575	441	623	16,275	公益事業	
PETRONAS GAS BHD	—	103	178	4,666	公益事業	
DIGI. COM BHD	269	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
SAPURA ENERGY BHD	2,511	6,928	211	5,515	エネルギー	
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,679 13銘柄	10,718 9銘柄	3,647	95,195 <1.3%>	
	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円		
<b>(南アフリカ)</b>						
GOLD FIELDS LTD	208.6	254.9	1,876	14,408	素材	
NEPI ROCKCASTLE PLC	—	49	632	4,856	不動産	
OLD MUTUAL LTD	—	690	1,458	11,202	金融	
VODACOM GROUP LTD	72.4	162.5	1,924	14,780	コミュニケーション・サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	38.4	100.9	1,584	12,168	生活必需品	
NEDBANK GROUP LTD	32.8	100.1	2,471	18,980	金融	
BIDVEST GROUP LTD	24.2	54.3	1,033	7,939	資本財・サービス	
BID CORP LTD	31.7	51.1	1,517	11,656	生活必需品	
NETCARE LTD	188.4	329.3	559	4,296	ヘルスケア	
STANDARD BANK GROUP LTD	166.5	302.9	5,801	44,557	金融	
IMPERIAL LOGISTICS LTD	36.4	—	—	—	資本財・サービス	
SASOL LTD	110	151.9	5,255	40,364	素材	
REMGRO LTD	37.8	75.4	1,407	10,810	金融	
EXXARO RESOURCES LTD	34.8	46	773	5,938	エネルギー	
PICK N PAY STORES LTD	—	85.7	576	4,428	生活必需品	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	41.6	96.4	660	5,070	一般消費財・サービス	
SANLAM LTD	161.7	310.4	2,409	18,503	金融	
TIGER BRANDS LTD	12.5	31.8	725	5,570	生活必需品	
FIRSTRAND LTD	288.5	539	3,554	27,295	金融	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	121.8	276.8	1,284	9,863	一般消費財・サービス	
THE FOSCHINI GROUP LTD	16.8	43.3	771	5,924	一般消費財・サービス	
ABSA GROUP LTD	128.4	251.3	4,257	32,695	金融	
NASPERS LTD-N SHS	5.9	14.2	4,896	37,606	一般消費財・サービス	
INVESTEC LTD	44.4	69.9	638	4,907	金融	
MTN GROUP LTD	282.1	544.1	5,655	43,433	コミュニケーション・サービス	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	187.8	137.8	1,008	7,747	素材	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	20.4	70.3	736	5,656	ヘルスケア	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	72.3	57.9	1,453	11,165	素材	
BARLOWORLD LTD	39.6	60.7	784	6,025	資本財・サービス	
SAPPI LIMITED	88.4	157.1	839	6,446	素材	
TELKOM SA SOC LTD	86.7	108.3	966	7,424	コミュニケーション・サービス	
MONDI LTD	13.2	21.7	689	5,298	素材	
MMI HOLDINGS LTD	166	—	—	—	金融	
SPAR GROUP LIMITED/THE	27.4	47.3	885	6,799	生活必需品	
MR PRICE GROUP LTD	15.9	31.9	628	4,823	一般消費財・サービス	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	159.9	276.4	605	4,646	ヘルスケア	
SIBANYE GOLD LTD	318.7	555.7	886	6,807	素材	
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,282 34銘柄	6,156.3 35銘柄	61,210	470,100 <6.3%>	
	百株	百株	千タイ・パーツ	千円		
<b>(タイ)</b>						
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	73	102	2,029	7,144	金融	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	115	166	7,768	27,346	素材	

銘柄	株数	当株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	135	110	2,068	7,279	金融
KASIKORNBANK PCL-NVDR	97	78	1,458	5,134	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	318	571	7,936	27,937	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	211	302	1,721	6,059	金融
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	165	200	4,240	14,924	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	1,165	1,790	3,490	12,286	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	748	1,233	1,775	6,249	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	282	299	3,961	13,945	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	1,558	2,843	1,421	5,003	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	291	—	—	—	エネルギー
PTT PCL-NVDR	2,790	3,860	18,624	65,558	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	193	347	2,264	7,969	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	257	423	3,616	12,730	生活必需品
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,061	1,034	3,076	10,828	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	331	614	3,868	13,616	素材
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,790 17銘柄	13,972 16銘柄	69,322 <3.3%>	
		百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円
(ポーランド)					
PKO BANK POLSKI SA	81.8	—	—	—	金融
BANK PEKAO SA	31.2	—	—	—	金融
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	101.2	—	—	—	金融
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	227.9	—	—	—	エネルギー
PGE SA	118.7	—	—	—	公益事業
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	51.1	—	—	—	エネルギー
KGHM POLSKA MIEDZ SA	29.9	—	—	—	素材
ポーランド・ズロチ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	641.8 7銘柄	— —	— <—>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	270,005.85 353銘柄	393,868.89 357銘柄	— <87.4%>	

(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	株数	当株数	期末		業種等
			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)					
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	362	325	7,094	765,594	
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	362 1銘柄	325 1銘柄	7,094 <10.3%>	
		千口	千口	千トルコ・リラ	千円
(トルコ)					
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	—	171.87	211	4,071	
トルコ・リラ通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	— —	171.87 1銘柄	211 <0.1%>	

銘 柄	期 首		当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	額
			外貨建金額	邦貨換算金額
			千メキシコ・ペソ	千円
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 38.6	千口 67.7	1,706	9,694
メキシコ・ペソ通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	38.6 1 銘柄	67.7 1 銘柄	1,706 <0.1%>
(南アフリカ) REDEFINE PROPERTIES LTD GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	千口 50.98 29.13	千口 105 59.43	941 1,444	7,233 11,095
南アフリカ・ランド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	80.11 2 銘柄	164.43 2 銘柄	2,386 <0.2%>
合 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	480.71 4 銘柄	729 5 銘柄	— <10.7%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

### (3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外国 MSC1 EMGMKT (アメリカ)	97	—

(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7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	6,526,754	86.9
投資信託証券	797,689	10.6
コール・ローン等、その他	189,280	2.5
投資信託財産総額	7,513,724	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.91円、1香港・ドル=13.86円、1シンガポール・ドル=79.59円、1台湾・ドル=3.47円、1トルコ・リラ=19.26円、1メキシコ・ペソ=5.68円、100チリ・ペソ=15.89円、1インド・ルピー=1.59円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・リアル=28.38円、1マレーシア・リンギット=26.10円、1南アフリカ・ランド=7.68円、1タイ・バーツ=3.52円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (7,451,392千円) の投資信託財産総額 (7,513,724千円) 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7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,524,450,741円
コール・ローン等	90,201,698
株式 (評価額)	6,526,754,319
投資信託証券 (評価額)	797,689,229
未収入金	15,729,525
未収配当金	73,937,325
差入委託証拠金	20,138,645
(B) 負債	56,777,254
未払金	43,699,560
未払解約金	13,060,000
その他未払費用	17,694
(C) 純資産総額 (A - B)	7,467,673,487
元本	4,649,472,217
次期繰越損益金	2,818,201,270
(D) 受益権総口数	4,649,472,217口
1万口当り基準価額 (C/D)	16,061円

\* 期首における元本額は3,533,923,390円、当作成期間中における追加設定元本額は1,440,644,885円、同解約元本額は325,096,058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、新興国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) 8,758,485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) 219,675,950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) 215,920,663円、D-1's 新興国株式インデックス96,643,264円、iFree 新興国株式インデックス1,618,568,955円、iFree 8資産バランス1,129,802,147円、DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド927,126,090円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式369,831,692円、ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド63,144,971円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は16,061円です。

■損益の状況

当期 自 2018年7月6日 至 2019年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	254,355,766円
受取配当金	253,236,848
受取利息	806,212
その他収益金	348,043
支払利息	△ 35,337
(B) 有価証券売買損益	199,834,687
売買益	807,191,923
売買損	△ 607,357,236
(C) 先物取引等損益	17,660,890
取引益	31,604,079
取引損	△ 13,943,189
(D) その他費用	△ 12,639,758
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	459,211,585
(F) 前期繰越損益金	1,756,688,512
(G) 解約差損益金	△ 188,394,942
(H) 追加信託差損益金	790,696,115
(I) 合計 (E + F + G + H)	2,818,201,270
次期繰越損益金 (I)	2,818,201,270

(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。

【注記】

出典：FTSE International Limited (以下、「FTSE」)® FTSE。FTSE® は、ロンドン証券取引所グループ会社が所有する商標であり、ライセンスに基づき FTSE International Limited によって使用されています。Fundamental Index® および RAFI® は Research Affiliates, LLC の登録商標です。FTSE RAFI® エマージング インデックスは Research Affiliates LLC (以下、「RA」) と共同し FTSE International Limited (以下、「FTSE」) によって計算されます。本インデックスに関する知的財産権はすべて FTSE に帰属します。FTSE のインデックス、FTSE Ratings、またはその基礎データに関する瑕疵や不作為については、FTSE 並びにライセンス各社はいずれも一切の責任を負いません。また、書面に基づく FTSE の同意がない限り、FTSE のデータの再配信も許可されません。

Source: FTSE International Limited ("FTSE")® FTSE. "FTSE®" is a trade mark of the London Stock Exchange Group companies and is used by FTSE International Limited under licence. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC. The FTSE RAFI® Emerging Index is calculated by FTSE in conjunction with Research Affiliates LLC. All intellectual property rights in the Index vest in FTSE. Neither FTSE nor its licensors accept any liability for any errors or omissions in the FTSE indices and / or FTSE ratings or underlying data. No further distribution of FTSE Data is permitted without FTSE's express written consent.

# ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

## 運用報告書（全体版） 第3期

（決算日 2019年12月2日）

（作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2日）

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2017年11月30日)	円 10,010	円 0	% 0.1	522.295	% 0.2	% 99.3	% -	百万円 1,379
2 期末(2018年11月30日)	10,025	0	0.1	523.683	0.3	99.4	-	2,161
3 期末(2019年12月 2 日)	10,249	0	2.2	536.068	2.4	99.5	-	2,135

(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。

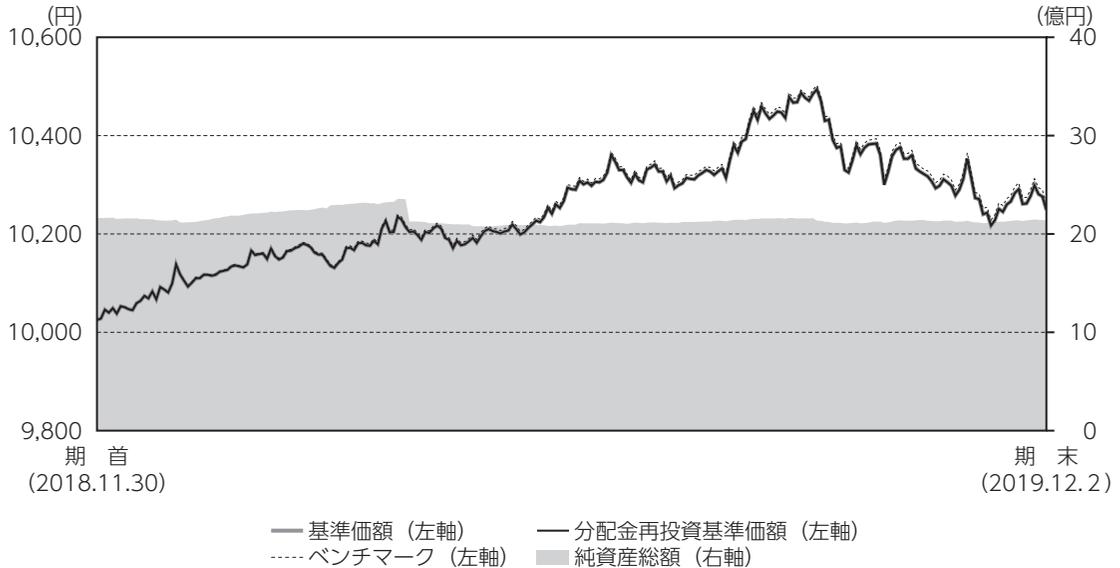
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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：10,025円

期末：10,249円（分配金0円）

騰落率：2.2%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

金利の低下（債券価格は上昇）および債券の利息収入がいずれもプラス要因となり、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。

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス ( D B I ) 総合指数 (ベンチマーク)		公 社 債 率 組 入 比	債 券 先 物 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期首) 2018年11月30日	円 10,025	% -	523.683	% -	% 99.4	% -
12月末	10,099	0.7	527.623	0.8	99.5	-
2019年 1 月末	10,138	1.1	529.658	1.1	99.4	-
2 月末	10,158	1.3	530.781	1.4	99.4	-
3 月末	10,229	2.0	534.623	2.1	99.4	-
4 月末	10,195	1.7	532.961	1.8	99.5	-
5 月末	10,260	2.3	536.316	2.4	99.2	-
6 月末	10,322	3.0	539.597	3.0	99.1	-
7 月末	10,333	3.1	540.217	3.2	99.3	-
8 月末	10,477	4.5	547.729	4.6	99.4	-
9 月末	10,361	3.4	541.725	3.4	99.5	-
10月末	10,312	2.9	539.302	3.0	99.5	-
11月末	10,276	2.5	537.478	2.6	99.0	-
(期末) 2019年12月 2 日	10,249	2.2	536.068	2.4	99.5	-

(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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■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低下しました。

当作成期首より、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。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、長期金利はさらに低下しました。2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから、金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、長期金利は上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■日本債券インデックスマザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■当ファンド

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

### ■日本債券インデックスマザーファンド

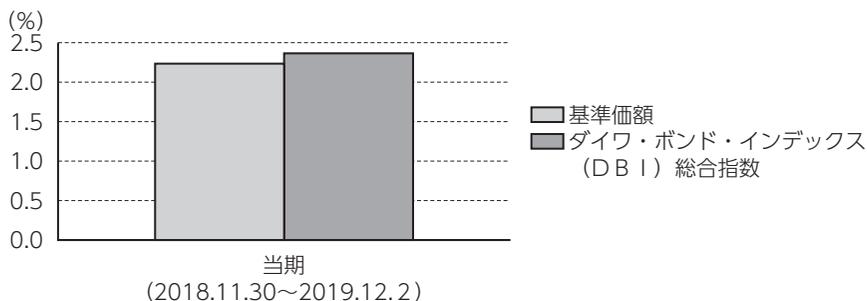
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は2.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.2%となりました。

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

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ～2019年12月2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）	249

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■日本債券インデックスマザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.12.1~2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	11円	0.109%	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10,251円です。
(投 信 会 社)	(7)	(0.071)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(3)	(0.027)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(1)	(0.011)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(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	12	0.114	

(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。

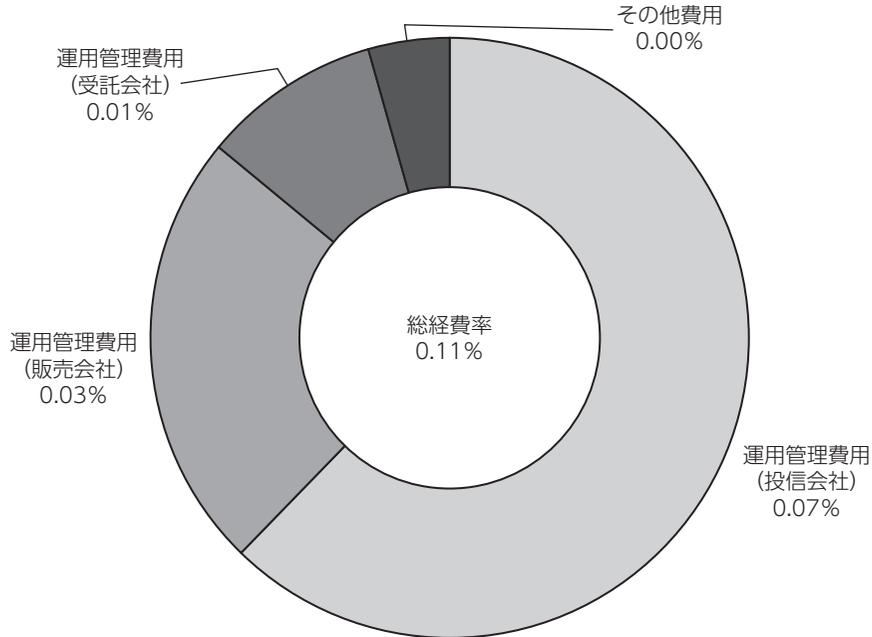
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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前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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.11%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2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	317,594	452,702	371,596	530,063

(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12月1日から2019年12月2日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区 分	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C		
公社債	百万円 32,868	百万円 1,366	% 4.2	百万円 29,973	百万円 1,012	% 3.4
コール・ローン	106,762	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合2.7%

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

(3) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	1,545,313	1,491,311	2,133,023

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	2,133,023	99.8
コール・ローン等、その他	4,783	0.2
投資信託財産総額	2,137,807	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,137,807,196円
コール・ローン等	3,343,283
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,133,023,236
未収入金	1,440,677
(B) 負債	2,663,618
未払解約金	1,433,319
未払信託報酬	1,171,123
その他未払費用	59,176
(C) 純資産総額(A - B)	2,135,143,578
元本	2,083,243,207
次期繰越損益金	51,900,371
(D) 受益権総口数	2,083,243,207口
1万口当り基準価額(C/D)	10,249円

\*期首における元本額は2,156,165,819円、当作成期間中における追加設定元本額は844,707,447円、同解約元本額は917,630,059円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,249円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,969円
受取利息	651
支払利息	△ 3,620
(B) 有価証券売買損益	34,798,212
売買益	49,962,407
売買損	△15,164,195
(C) 信託報酬等	△ 2,459,182
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	32,336,061
(E) 前期繰越損益金	2,036,072
(F) 追加信託差損益金	17,528,238
(配当等相当額)	( 3,184,804)
(売買損益相当額)	( 14,343,434)
(G) 合計(D + E + F)	51,900,371
次期繰越損益金(G)	51,900,371
追加信託差損益金	17,528,238
(配当等相当額)	( 3,184,804)
(売買損益相当額)	( 14,343,434)
分配準備積立金	34,375,102
繰越損益金	△ 2,969

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	32,337,045
(c) 収益調整金	17,528,238
(d) 分配準備積立金	2,038,057
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	51,903,340
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	51,903,340
(h) 受益権総口数	2,083,243,207口

# 日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第20期 (決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2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

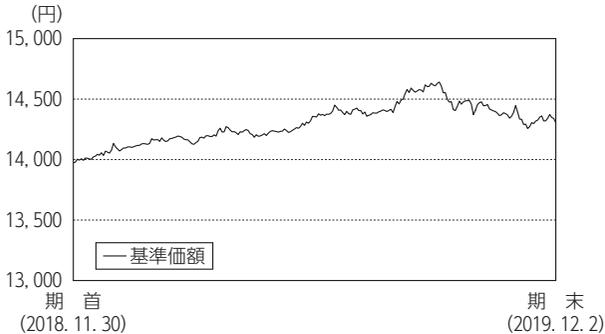
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率 %	(ベンチマーク)	騰落率 %		
(期首) 2018年11月30日	13,974	—	523.683	—	99.6	—
12月末	14,078	0.7	527.623	0.8	99.6	—
2019年1月末	14,134	1.1	529.658	1.1	99.5	—
2月末	14,163	1.4	530.781	1.4	99.5	—
3月末	14,264	2.1	534.623	2.1	99.5	—
4月末	14,218	1.7	532.961	1.8	99.6	—
5月末	14,310	2.4	536.316	2.4	99.3	—
6月末	14,398	3.0	539.597	3.0	99.2	—
7月末	14,415	3.2	540.217	3.2	99.4	—
8月末	14,617	4.6	547.729	4.6	99.5	—
9月末	14,456	3.4	541.725	3.4	99.6	—
10月末	14,390	3.0	539.302	3.0	99.6	—
11月末	14,340	2.6	537.478	2.6	99.1	—
(期末) 2019年12月2日	14,303	2.4	536.068	2.4	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：13,974円 期末：14,303円 騰落率：2.4%

## 【基準価額の主な変動要因】

金利の低下 (債券価格は上昇) および債券の利息収入がいずれもプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

## ◆投資環境について

## ○国内債券市場

国内債券市場では、当作成期を通してみると長期金利は低下しました。

当作成期首より、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。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、長期金利はさらに低下しました。2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU (欧州連合) 離脱交渉の進展期待が高まる中で、長期金利は上昇しました。

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

## ◆ポートフォリオについて

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

## ◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は2.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.4%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差は0.01%程度で、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います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッドへの感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

# 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 (その他)	0 ( 0)
合 計	0

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### 公 社 債

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	31,899,723	( 28,250,264 —)
	地方債証券	556,957	( 607,484 —)
	特殊債券	106,387	( 404,282 —)
	社債券	305,424	( 711,033 —)

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,829,518	124 5年国債 0.1% 2020/6/20	1,343,825
127 5年国債 0.1% 2021/3/20	1,106,169	130 5年国債 0.1% 2021/12/20	1,310,504
140 5年国債 0.1% 2024/6/20	1,020,813	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,219,380
130 5年国債 0.1% 2021/12/20	1,008,762	125 5年国債 0.1% 2020/9/20	943,600
355 10年国債 0.1% 2029/6/20	783,145	126 5年国債 0.1% 2020/12/20	892,662
345 10年国債 0.1% 2026/12/20	739,269	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	860,472
332 10年国債 0.6% 2023/12/20	735,894	345 10年国債 0.1% 2026/12/20	818,945
139 5年国債 0.1% 2024/3/20	710,096	332 10年国債 0.6% 2023/12/20	798,058
353 10年国債 0.1% 2028/12/20	709,640	123 5年国債 0.1% 2020/3/20	782,195
406 2年国債 0.1% 2021/11/1	703,822	339 10年国債 0.4% 2025/6/20	726,611

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

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

作成期 区分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちB B 格 以下組入 比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	65,466,000	71,946,332	87.2	—	58.3	20.2	8.7
地方債証券	4,000,000	4,253,511	5.2	—	2.8	2.1	0.2
特殊債券（除く金融債券）	2,800,000	2,921,624	3.5	—	1.6	1.7	0.2
金融債券	100,000	99,005	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	2,800,000	2,898,205	3.5	—	2.1	1.0	0.4
合 計	75,166,000	82,118,679	99.6	—	64.9	25.1	9.6

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区 分	当 期		年 利 率	末		償還年月日
	銘 柄	額 面 金 額		評 価 額	額 面 金 額	
		千円	%	千円	千円	
<b>国債証券</b>	398 2年国債	250,000	0.1000	250,822	250,822	2021/03/01
	127 5年国債	1,580,000	0.1000	1,585,308	1,585,308	2021/03/20
	313 10年国債	200,000	1.3000	203,756	203,756	2021/03/20
	314 10年国債	260,000	1.1000	264,209	264,209	2021/03/20
	49 20年国債	64,000	2.1000	65,882	65,882	2021/03/22
	50 20年国債	107,000	1.9000	109,867	109,867	2021/03/22
	399 2年国債	100,000	0.1000	100,358	100,358	2021/04/01
	400 2年国債	200,000	0.1000	200,762	200,762	2021/05/01
	128 5年国債	1,000,000	0.1000	1,004,180	1,004,180	2021/06/20
	315 10年国債	221,000	1.2000	225,671	225,671	2021/06/20
	316 10年国債	250,000	1.1000	254,897	254,897	2021/06/20
	51 20年国債	82,000	2.0000	84,754	84,754	2021/06/21
	402 2年国債	150,000	0.1000	150,651	150,651	2021/07/01
	129 5年国債	1,340,000	0.1000	1,346,633	1,346,633	2021/09/20
	317 10年国債	214,000	1.1000	218,879	218,879	2021/09/20
	318 10年国債	200,000	1.0000	204,200	204,200	2021/09/20
	52 20年国債	52,000	2.1000	54,126	54,126	2021/09/21
	405 2年国債	150,000	0.1000	150,756	150,756	2021/10/01
	406 2年国債	700,000	0.1000	703,689	703,689	2021/11/01
	130 5年国債	580,000	0.1000	583,271	583,271	2021/12/20
	319 10年国債	100,000	1.1000	102,597	102,597	2021/12/20
	320 10年国債	230,000	1.0000	235,501	235,501	2021/12/20
	53 20年国債	66,000	2.1000	69,076	69,076	2021/12/20
	54 20年国債	65,000	2.2000	68,163	68,163	2021/12/20
	131 5年国債	1,170,000	0.1000	1,177,534	1,177,534	2022/03/20
	321 10年国債	175,000	1.0000	179,712	179,712	2022/03/20
	322 10年国債	130,000	0.9000	133,201	133,201	2022/03/20
	55 20年国債	140,000	2.0000	147,018	147,018	2022/03/21
	132 5年国債	880,000	0.1000	886,292	886,292	2022/06/20
	323 10年国債	380,000	0.9000	390,393	390,393	2022/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	133 5年国債		0.1000	430,000	433,689	2022/09/20
	325 10年国債		0.8000	310,000	318,494	2022/09/20
	58 20年国債		1.9000	200,000	211,664	2022/09/20
	134 5年国債		0.1000	350,000	353,164	2022/12/20
	326 10年国債		0.7000	30,000	30,808	2022/12/20
	327 10年国債		0.8000	450,000	463,509	2022/12/20
	59 20年国債		1.7000	45,000	47,591	2022/12/20
	60 20年国債		1.4000	10,000	10,484	2022/12/20
	135 5年国債		0.1000	880,000	888,456	2023/03/20
	328 10年国債		0.6000	350,000	359,040	2023/03/20
	61 20年国債		1.0000	100,000	103,909	2023/03/20
	136 5年国債		0.1000	700,000	707,245	2023/06/20
	329 10年国債		0.8000	500,000	517,480	2023/06/20
	62 20年国債		0.8000	95,000	98,321	2023/06/20
	63 20年国債		1.8000	130,000	139,158	2023/06/20
	137 5年国債		0.1000	700,000	707,357	2023/09/20
	330 10年国債		0.8000	612,000	634,809	2023/09/20
	331 10年国債		0.6000	365,000	375,811	2023/09/20
	64 20年国債		1.9000	90,000	97,119	2023/09/20
	138 5年国債		0.1000	600,000	606,600	2023/12/20
	332 10年国債		0.6000	250,000	257,895	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	175,000	189,759	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	185,000	199,848	2023/12/20
	139 5年国債		0.1000	700,000	708,169	2024/03/20
	333 10年国債		0.6000	600,000	620,112	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	59,923	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	132,298	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	120,798	2024/03/20
	140 5年国債		0.1000	600,000	607,140	2024/06/20
	334 10年国債		0.6000	900,000	931,527	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	92,727	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	138,506	2024/06/20
	141 5年国債		0.1000	650,000	658,164	2024/09/20
	335 10年国債		0.5000	690,000	712,183	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	175,000	194,118	2024/09/20
	336 10年国債		0.5000	275,000	284,377	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	300,000	307,176	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	133,220	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	81,413	2024/12/20
	338 10年国債		0.4000	580,000	597,492	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	89,651	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	56,608	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	144,989	2025/03/20
	339 10年国債		0.4000	590,000	608,649	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	68,030	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	56,042	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	59,701	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	700,000	723,149	2025/09/20
	81 20年国債		2.0000	76,000	85,605	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	98,504	2025/09/20

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	341 10年国債	0.3000	440,000	452,491	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	105,800	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	1,000,000	1,016,850	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	66,311	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	92,480	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	63,231	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	700,000	712,271	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	116,233	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	90,145	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	700,000	712,502	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	23,227	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	70,094	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	650,000	662,044	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	359,674	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	700,000	713,426	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	115,853	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	151,568	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	500,000	509,730	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	59,326	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	64,419	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	600,000	611,832	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	47,378	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	376,505	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,050,000	1,070,937	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	118,181	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	270,000	275,319	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	185,198	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	424,056	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	99,011	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	800,000	815,192	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	205,341	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,906	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	103,251	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	690,000	702,558	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	150,668	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	180,699	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	250,000	254,447	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	107,976	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	477,000	563,575	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	610,110	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	65,165	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	312,920	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	460,000	467,286	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	243,392	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	181,104	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	420,000	426,199	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	20,479	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	375,617	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	85,067	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	220,559	2029/12/20

## 日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	2 30年国債		2.4000	24,000	29,961	2030/02/20
	116 20年国債		2.2000	140,000	172,145	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	215,000	262,147	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	37,275	2030/05/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	115,217	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	110,827	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	280,000	327,759	2030/06/20
	121 20年国債		1.9000	170,000	204,984	2030/09/20
	122 20年国債		1.8000	160,000	191,198	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	47,420	2030/11/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	246,258	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	193,000	235,508	2030/12/20
	125 20年国債		2.2000	85,000	105,938	2031/03/20
	126 20年国債		2.0000	110,000	134,615	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	165,000	200,064	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	34,979	2031/05/20
	128 20年国債		1.9000	119,000	144,684	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	230,000	276,995	2031/06/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	169,129	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	150,000	179,446	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	30,762	2031/11/20
	133 20年国債		1.8000	370,000	448,070	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	80,000	97,104	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	110,546	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	200,000	237,874	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	70,324	2032/05/20
	138 20年国債		1.5000	100,000	118,003	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	300,000	357,747	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	300,000	362,250	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	33,024	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	50,393	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	200,000	242,146	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	240,000	293,678	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	51,037	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	251,983	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	300,000	356,031	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	48,650	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	380,000	462,178	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	76,383	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	230,000	280,273	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	94,738	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	150,000	181,167	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	108,499	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	330,000	394,544	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	100,000	134,119	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	272,000	325,660	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	250,000	336,507	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	200,000	237,046	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	130,000	173,678	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	370,000	428,108	2034/12/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	18 30年国債		2.3000	80,000	106,031	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	350,000	405,545	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	75,731	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	400,000	470,232	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	380,000	441,229	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	80,150	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	275,000	310,895	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	170,000	233,166	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	200,000	206,964	2036/03/20
	157 20年国債		0.2000	400,000	400,640	2036/06/20
	24 30年国債		2.5000	92,000	126,902	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	100,000	104,960	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	202,593	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	280,000	298,460	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	246,808	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	210,000	227,360	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	260,000	276,923	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	209,469	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	350,000	372,778	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	290,000	308,858	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	238,790	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	400,000	418,588	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	200,000	209,232	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	278,700	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	300,000	324,528	2038/09/20
	167 20年国債		0.5000	300,000	313,350	2038/12/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	304,125	2039/03/20
	168 20年国債		0.4000	300,000	307,716	2039/03/20
	169 20年国債		0.3000	300,000	301,950	2039/06/20
	31 30年国債		2.2000	300,000	411,516	2039/09/20
	170 20年国債		0.3000	90,000	90,506	2039/09/20
	32 30年国債		2.3000	285,000	398,221	2040/03/20
	33 30年国債		2.0000	311,000	418,179	2040/09/20
	34 30年国債		2.2000	180,000	250,707	2041/03/20
	35 30年国債		2.0000	195,000	264,718	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	350,000	477,319	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	300,000	404,580	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	190,000	252,874	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	192,000	260,417	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	200,000	267,228	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	223,629	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	176,000	231,792	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	200,000	263,710	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	230,000	303,616	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	200,000	255,018	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	140,000	178,655	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	210,000	273,474	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	290,000	363,767	2045/09/20
	49 30年国債		1.4000	100,000	125,663	2045/12/20
	50 30年国債		0.8000	215,000	238,007	2046/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	51 30年国債	0.3000	240,000	235,368	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	300,000	309,129	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	263,812	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	218,000	241,236	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	200,000	221,220	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	300,000	331,677	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	254,483	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	107,356	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	320,000	353,881	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	200,000	215,924	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	180,000	204,030	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	215,612	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	164,067	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	200,000	204,706	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	228,790	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	100,000	99,338	2049/09/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	111,342	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	162,371	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	184,040	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	152,618	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	169,458	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	301,596	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	216,568	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	317,047	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	358,339	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	200,000	202,662	2059/03/20
種別小計	銘 柄 数	256銘柄			
	金 額		65,466,000	71,946,332	
<b>地方債証券</b>	699 東京都公債	1.0200	100,000	101,743	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	101,940	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	102,210	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	102,243	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	102,003	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	102,229	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	102,160	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	102,016	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	102,155	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	102,149	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	102,049	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	102,080	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	102,246	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,413	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	102,935	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	205,212	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	102,625	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,356	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,101	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	205,308	2025/04/16

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	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,818	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,812	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,618	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,847	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	200,895	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,721	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,147	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	119,074	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	116,982	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	120,402	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	119,997	2029/12/14
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	119,584	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	117,730	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	118,079	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	110,833	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	135,281	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	120,503	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	37銘柄	4,000,000	4,253,511	
特殊債券 (除く金融債券)	3 公営企業15年	2.2000	100,000	103,245	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	101,878	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	102,012	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	102,212	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	102,315	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	102,194	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	102,122	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	102,265	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	102,237	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	102,556	2023/02/24
	19 政保政策投資C	0.6680	100,000	102,115	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	102,125	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	102,682	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	102,053	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	102,995	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,357	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,481	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,164	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	204,111	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	109,700	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	110,161	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	118,467	2029/07/31
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	119,825	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	117,581	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	196,229	2036/07/31
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	104,530	2036/12/26
種別小計	銘柄数 金 額	26銘柄	2,800,000	2,921,624	

日本債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			末	
		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>		19 利付商工債	0.1000 %	100,000 千円	99,005 千円	2026/09/18
種 別 小 計	銘 柄 数	1銘柄				
	金 額			100,000	99,005	
<b>普通社債券</b>		44 野村ホールディング	0.7230	100,000	100,715	2021/02/25
		2 イオンFS	0.5720	100,000	100,554	2021/03/18
		9三菱UFJ信託BK 劣	1.6800	100,000	102,173	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,155	2022/06/20
		11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	103,096	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	103,118	2022/08/25
		4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	103,108	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	102,151	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	103,655	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	102,745	2023/12/20
		1 三菱UFJFG 劣後	0.9400	100,000	102,377	2024/06/26
		5 野村不動産HD	0.9240	100,000	103,370	2025/05/30
		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	102,415	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,778	2025/11/13
		4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	103,235	2025/12/18
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,811	2026/08/21
		17 パナソニック	0.4700	100,000	100,878	2026/09/18
		509 関西電力	0.4700	100,000	100,636	2027/05/25
		12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	100,305	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	100,246	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,404	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,337	2028/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	117,722	2029/01/29
		18 エヌティティ都市開	1.0900	100,000	106,548	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	107,356	2029/12/12
		332 北海道電力	0.9070	100,000	104,473	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	101,800	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	121,036	2045/01/27
種 別 小 計	銘 柄 数	28銘柄				
	金 額			2,800,000	2,898,205	
合 計	銘 柄 数	348銘柄				
	金 額			75,166,000	82,118,679	

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	82,118,679	97.2
コール・ローン等、その他	2,340,049	2.8
投資信託財産総額	84,458,729	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12月2日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>84,458,729,704円</b>
コール・ローン等	277,498,394
公社債 (評価額)	82,118,679,960
未収入金	1,861,375,540
未収利息	188,754,567
前払費用	12,421,243
<b>(B) 負債</b>	<b>1,970,494,415</b>
未払金	1,951,218,000
未払解約金	19,276,281
その他未払費用	134
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>82,488,235,289</b>
元本	57,670,399,195
次期繰越損益金	24,817,836,094
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>57,670,399,195口</b>
1万口当り基準価額 (C / D)	14,303円

\* 期首における元本額は56,170,487,793円、当作成期間中における追加設定元本額は19,864,910,379円、同解約元本額は18,364,998,977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) 109,396,910円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募) 596,838,676円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募) 82,263,337円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募) 882,267,553円、DCダイワ日本債券インデックス7,293,354,645円、ダイワ・バランスファンド35VA 11,302,866,367円、ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 1,855,649,526円、ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 265,692,526円、ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用) 369,416,535円、ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド81,822,975円、ダイワファンドラップ 日本債券インデックス21,258,481,478円、ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用) 3,005,941,387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1,491,311,778円、ダイワ・インデックスセレクト 日本債券1,129,962,205円、ダイワ投信倶楽部 日本債券インデックス 6,866,925,426円、ダイワライフスタイル25 450,390,874円、ダイワライフスタイル50 491,002,347円、ダイワライフスタイル75 136,814,650円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,303円です。

## ■損益の状況

当期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>668,724,518円</b>
受取利息	669,001,286
支払利息	△ 276,768
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>1,086,219,610</b>
売買益	1,551,391,130
売買損	△ 465,171,520
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 11,078</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>1,754,933,050</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>22,319,404,672</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>7,944,362,524</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>8,687,860,896</b>
<b>(H) 合計 (D + E + F + G)</b>	<b>24,817,836,094</b>
次期繰越損益金 (H)	24,817,836,094

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

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

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

## 運用報告書 (全体版) 第3期

(決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日~2019年12月2日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2017年11月30日)	円 10,078	円 0	% 0.8	10,111	% 1.1	% 95.4	% 1.5	百万円 2,166
2 期末(2018年11月30日)	9,860	0	△2.2	9,927	△1.8	97.0	0.7	3,598
3 期末(2019年12月 2 日)	10,567	0	7.2	10,687	7.7	98.3	－	3,539

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

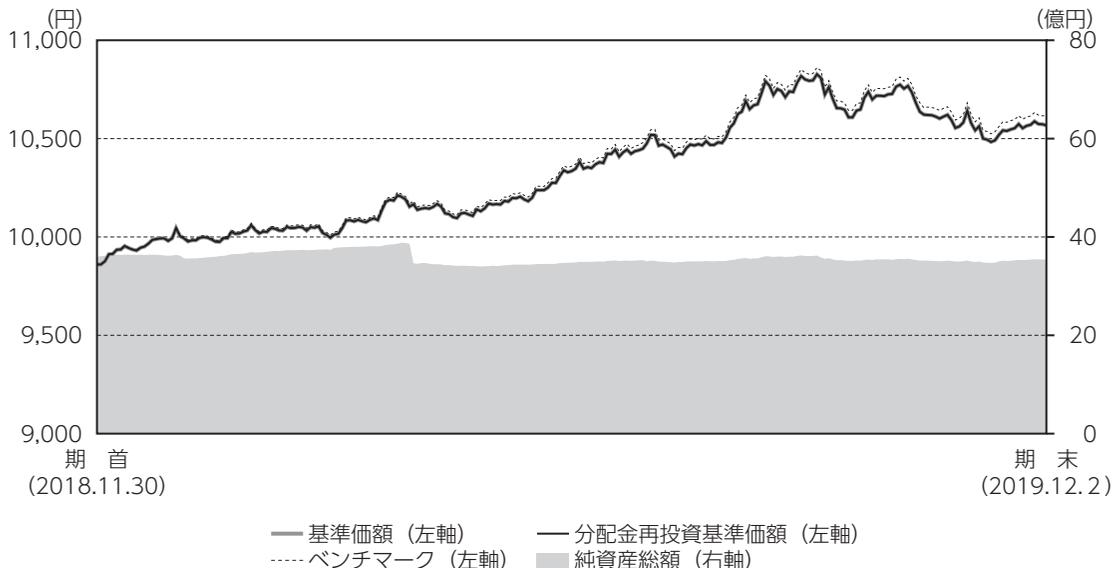
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

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

#### ■基準価額・騰落率

期首：9,860円

期末：10,567円(分配金0円)

騰落率：7.2%(分配金込み)

#### ■基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、債券市場で金利が低下(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。

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期首) 2018年11月30日	円 9,860	% -	9,927	% -	% 97.0	% 0.7
12月末	9,993	1.3	10,064	1.4	94.3	-
2019年 1 月末	10,033	1.8	10,110	1.8	96.7	-
2 月末	10,021	1.6	10,100	1.7	98.4	-
3 月末	10,204	3.5	10,286	3.6	96.8	-
4 月末	10,131	2.7	10,217	2.9	97.6	0.6
5 月末	10,275	4.2	10,368	4.4	94.9	1.2
6 月末	10,436	5.8	10,532	6.1	97.2	0.7
7 月末	10,478	6.3	10,579	6.6	97.1	-
8 月末	10,801	9.5	10,908	9.9	95.1	1.2
9 月末	10,718	8.7	10,828	9.1	97.1	1.0
10月末	10,582	7.3	10,694	7.7	99.3	-
11月末	10,573	7.2	10,688	7.7	96.1	1.6
(期末) 2019年12月 2 日	10,567	7.2	10,687	7.7	98.3	-

(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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通してみると低下しました。

当作成期首より、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、金利は低下しました。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、金利はさらに低下しました。しかし2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから、金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、金利は上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■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

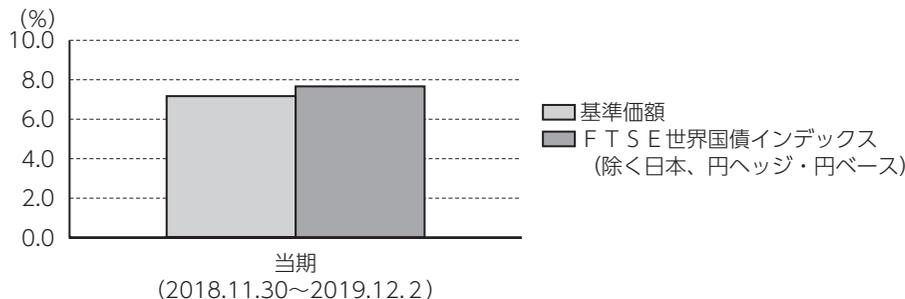
外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

## 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 (F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)) の騰落率は7.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は7.2%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。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

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

### 分配原資の内訳 (1万口当り)

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ～2019年12月2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)	566	

(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 (2018.12.1~2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	27円	0.261%	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10,332円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0.185)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	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	29	0.284	

(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。

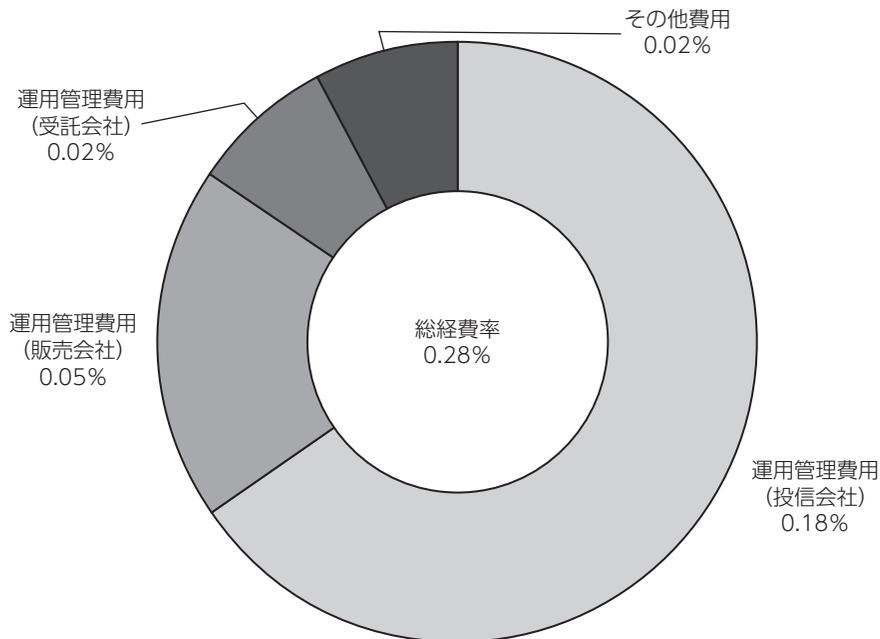
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.28%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2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	549,635	541,857	870,091	858,469

(注) 単位未满是切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	金 額	評 価 額	口 数	金 額	評 価 額
	千口	千円	千円	千口	千円	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	3,783,849	3,463,394	3,535,778			

(注) 単位未满是切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	3,535,778	99.7
コール・ローン等、その他	10,231	0.3
投資信託財産総額	3,546,010	100.0

(注1) 評価額の単位未满是切捨て。

(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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1シンガポール・ドル=80.21円、1イギリス・ポンド=141.59円、1デンマーク・クローネ=16.17円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローネ=11.46円、1メキシコ・ペソ=5.61円、1マレーシア・リンギット=26.24円、1南アフリカ・ランド=7.50円、1ポーランド・ズロチ=28.02円、1ユーロ=120.86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 (90,001,590千円) の投資信託財産総額 (97,492,451千円) に対する比率は、92.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,546,010,774円
コール・ローン等	10,077,643
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド(評価額)	3,535,778,990
未収入金	154,141
(B) 負債	6,857,635
未払解約金	2,047,651
未払信託報酬	4,662,596
その他未払費用	147,388
(C) 純資産総額(A-B)	3,539,153,139
元本	3,349,305,616
次期繰越損益金	189,847,523
(D) 受益権総口数	3,349,305,616口
1万口当り基準価額(C/D)	10,567円

\* 期首における元本額は3,649,169,243円、当作成期間中における追加設定元本額は1,134,630,067円、同解約元本額は1,434,493,694円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,567円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,825円
受取利息	1,150
支払利息	△ 6,975
(B) 有価証券売買損益	207,411,284
売買益	255,252,021
売買損	△ 47,840,737
(C) 信託報酬等	△ 9,618,997
(D) 当期損益金(A + B + C)	197,786,462
(E) 前期繰越損益金	△ 31,275,237
(F) 追加信託差損益金	23,336,298
(配当等相当額)	( 7,222,358)
(売買損益相当額)	( 16,113,940)
(G) 合計(D + E + F)	189,847,523
次期繰越損益金(G)	189,847,523
追加信託差損益金	23,336,298
(配当等相当額)	( 7,222,358)
(売買損益相当額)	( 16,113,940)
分配準備積立金	166,517,050
繰越損益金	△ 5,825

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	162,816,007
(c) 収益調整金	23,336,298
(d) 分配準備積立金	3,701,043
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	189,853,348
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	189,853,348
(h) 受益権総口数	3,349,305,616□

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の決算日（2019年6月17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12月2日）現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

買			付			売			付		
銘	柄	金額									
		千円			千円			千円			千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	3.625% 2021/2/15	2,244,155	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.625% 2020/11/15	3,578,694	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.875% 2020/6/30	2,989,002	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.125% 2021/9/30	1,914,759
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)	1.875% 2020/6/30	2,989,002	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	973,922
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.125% 2021/9/30	1,600,714	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)	1% 2019/11/15	1,146,722	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.875% 2028/5/15	909,594
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.125% 2021/6/30	973,922	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)	1.125% 2019/12/31	870,119	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.125% 2025/5/15	892,485
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.875% 2028/5/15	909,594	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)	2.25% 2024/11/15	782,843	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.875% 2026/6/30	821,003
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.125% 2025/5/15	892,485	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% 2020/3/15	610,810	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2022/11/15	781,068
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.875% 2026/6/30	821,003	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2021/11/15	548,091	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2021/11/15	548,091	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.875% 2024/8/31	765,178
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2022/11/15	781,068	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	2.5% 2020/10/25	535,002	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	2.5% 2020/10/25	535,002	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	3% 2049/2/15	651,376
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.875% 2024/8/31	765,178	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	3.5% 2020/6/1	489,010	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	3.5% 2020/6/1	489,010			
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	3% 2049/2/15	651,376									

(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12月2日現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（89,984,609千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2019年12月2日現在							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
アメリカ	千アメリカ・ドル 378,028	千アメリカ・ドル 401,478	千円 44,034,147	% 47.9	% -	% 21.0	% 16.3	% 10.6
カナダ	千カナダ・ドル 18,134	千カナダ・ドル 20,043	1,656,000	1.8	-	0.8	0.5	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 20,597	千オーストラリア・ドル 24,139	1,792,372	2.0	-	1.4	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 4,742	千シンガポール・ドル 5,057	405,639	0.4	-	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 30,522	千イギリス・ポンド 40,992	5,804,094	6.3	-	5.0	1.0	0.3
デンマーク	千デンマーク・クローネ 20,450	千デンマーク・クローネ 27,140	438,864	0.5	-	0.4	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 14,110	千ノルウェー・クローネ 14,667	174,537	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 32,128	368,191	0.4	-	0.1	0.2	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

区 分		2019年12月2日現在							
		額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
メキシコ	千メキシコ・ペソ 126,030	千メキシコ・ペソ 131,611	千円 738,340	% 0.8	% -	% 0.6	% 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 11,913	312,618	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 66,020	千南アフリカ・ランド 60,540	454,057	0.5	-	0.5	0.0	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 16,615	千ポーランド・ズロチ 17,480	489,795	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 4,838	千ユーロ 5,730	692,635	0.8	-	0.6	0.2	-	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 11,020	千ユーロ 13,827	1,671,137	1.8	-	1.2	0.5	0.2	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 13,636	千ユーロ 16,782	2,028,299	2.2	-	1.6	0.6	-	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 59,760	千ユーロ 72,766	8,794,563	9.6	-	6.5	2.4	0.7	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 35,905	千ユーロ 44,498	5,378,099	5.9	-	3.6	1.8	0.5	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 34,572	千ユーロ 42,762	5,168,275	5.6	-	3.8	1.3	0.6	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 57,367	千ユーロ 67,484	8,156,205	8.9	-	5.4	2.5	1.0	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 4,000	千ユーロ 4,469	540,166	0.6	-	0.4	0.2	-	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 8,330	千ユーロ 10,691	1,292,232	1.4	-	1.0	0.3	0.1	
ユーロ (小計)	229,428	279,013	33,721,614	36.7	-	24.1	9.6	3.0	
合 計	-	-	90,390,273	98.4	-	54.7	28.9	14.8	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年12月2日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲価をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものである。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分		2019年12月2日現在							
		銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2021/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	30,040	30,735	3,371,094	2021/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	13,946	14,046	1,540,640	2022/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	15,000	15,006	1,645,890	2023/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,000	2,024	222,066	2023/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	11,020	11,066	1,213,762	2023/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	11,310	11,666	1,279,531	2023/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	12,905	13,453	1,475,575	2024/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,500	2,611	286,473	2024/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	12,580	13,047	1,431,074	2021/06/30		
United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	22,990	23,155	2,539,647				

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2019年12月2日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	2,800	3,262	357,883	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	4,750	6,299	690,949	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	3,800	4,943	542,173	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	2,700	3,477	381,435	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	4,900	6,983	765,921	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,130	1,539	168,851	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	200	271	29,745	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	2,630	3,234	354,711	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	2,410	3,312	363,306	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	490	695	76,277	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,770	2,565	281,431	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,970	3,472	380,820	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	7,500	8,442	925,935	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,392	152,760	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	3,270	358,678	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	1,268	139,172	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,200	3,913	429,257	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	5,040	5,932	650,685	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	7,810	8,032	881,022	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	15,450	15,488	1,698,792	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	8,300	8,493	931,536	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,570	1,816	199,182	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	9,020	9,178	1,006,695	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	16,720	16,787	1,841,295	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	8,700	8,971	983,958	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,300	2,665	292,389	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,990	218,278	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,165	5,139	563,704	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,070	2,191	240,339	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,750	5,667	621,641	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,000	4,955	543,557	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	15,000	14,858	1,629,636	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,850	5,957	653,401	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,480	2,819	309,279	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,370	3,489	382,757	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,000	5,025	551,180	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	4,075	447,039	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,350	3,502	384,105	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	2,620	287,362	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	7,200	7,354	806,658	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,310	3,679	403,596	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	7,076	776,151	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,800	1,874	205,613	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,000	4,193	459,967	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,500	5,369	588,876	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	7,900	8,596	942,825	2028/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	5,500	5,574	611,365	2021/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,751	192,128	2048/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	5,000	5,561	610,007	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	950	1,187	130,277	2048/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,200	3,742	410,476	2049/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,287	250,893	2049/05/15	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2019年12月2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	1.8750	4,000	4,038	442,931	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,100	2,117	232,288	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	700	698	76,601	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,500	1,555	170,572	2049/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	66銘柄		378,028	401,478	44,034,147	
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	610	848	70,099	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,247	103,030	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	450	680	56,231	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	648	988	81,653	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	770	1,108	91,596	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	411	33,999	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	740	1,043	86,205	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,238	1,236	102,176	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	230	240	19,833	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	300	383	31,654	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	592	616	50,895	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	820	821	67,840	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,959	1,930	159,517	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	898	74,236	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,240	1,210	100,023	2022/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	625	51,638	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	300	301	24,944	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	1,031	85,196	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,000	3,019	249,490	2021/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,400	115,737	2024/09/01
通貨小計	銘柄数 金 額	20銘柄		18,134	20,043	1,656,000	
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,770	1,898	140,984	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,080	1,222	90,795	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,383	1,607	119,322	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,089	1,386	102,981	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	656	714	53,026	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	920	1,102	81,858	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,356	100,751	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	859	1,215	90,269	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,598	1,936	143,771	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	994	73,868	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	241	17,936	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	896	66,534	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,478	109,770	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,158	2,377	176,552	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	575	750	55,714	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	500	574	42,627	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,256	93,295	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,556	189,845	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	500	571	42,465	2030/05/21
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		20,597	24,139	1,792,372	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2019年12月2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	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 203	千シンガポール・ドル 228	千円 18,309	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	1,000	1,043	83,659	2022/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	159	12,792	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	300	332	26,678	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	390	394	31,619	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	89	100	8,073	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	208	16,706	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	120	142	11,418	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	415	33,335	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	375	30,085	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	205	16,504	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	272	21,886	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	857	68,788	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	300	321	25,781	2039/07/01
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		4,742	5,057	405,639	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 750	千イギリス・ポンド 815	115,413	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	960	1,444	204,555	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,025	1,092	154,644	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	249	35,396	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	600	642	91,011	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	720	796	112,750	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,100	1,316	186,384	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	650	684	96,937	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	870	123,267	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	400	488	69,163	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	508	72,007	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,000	1,111	157,439	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	863	1,272	180,151	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	700	983	139,323	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	175	215	30,562	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,565	2,324	329,058	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	200	326	46,271	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	450	866	122,671	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	620	1,057	149,736	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	600	775	109,770	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	411	687	97,282	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,294	183,282	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,378	336,822	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130	1,759	249,130	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,040	1,121	158,813	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	300	447	63,337	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	787	1,527	216,277	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	700	1,105	156,519	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	742	783	110,969	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	1,193	169,007	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,380	1,426	202,031	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,175	1,680	237,873	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,790	1,906	269,950	2023/09/07
United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	748	1,425	201,893	2068/07/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,900	2,100	297,356	2024/09/07	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2019年12月2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	
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	% 3.5000	千イギリス・ポンド 1,540	千イギリス・ポンド 2,309	千円 327,029	2045/01/22
通貨小計	銘 柄 数 額	36銘柄			30,522	40,992	5,804,094	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.5000	5,740	11,111	179,667	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	2,310	2,479	40,090	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	2,670	2,899	46,889	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	2,330	2,654	42,924	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	5,200	5,609	90,698	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	2,200	2,386	38,595	2029/11/15
通貨小計	銘 柄 数 額	6銘柄			20,450	27,140	438,864	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.7500	2,620	2,715	32,319	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	1,610	1,650	19,643	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	1,300	1,394	16,598	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	150	153	1,831	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,430	1,451	17,271	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	3,000	3,092	36,803	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	4,000	4,207	50,069	2028/04/26
	通貨小計	銘 柄 数 額	7銘柄			14,110	14,667	174,537
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.0000	2,780	2,927	33,552	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	1,920	3,041	34,853	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	12,950	14,192	162,651	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	4,150	4,446	50,961	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	2,020	2,324	26,637	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	2,280	2,464	28,238	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.7500	2,550	2,730	31,295	2028/05/12
	通貨小計	銘 柄 数 額	7銘柄			28,650	32,128	368,191
メキシコ	Mexican Bonos		国 債 証 券	5.7500	9,200	8,621	48,364	2026/03/05
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	11,450	12,335	69,201	2047/11/07
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	5,900	6,151	34,509	2024/09/05
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	6,740	6,997	39,255	2023/12/07
	Mexican Bonos		国 債 証 券	10.0000	6,340	7,154	40,134	2024/12/05
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.5000	11,800	12,113	67,958	2027/06/03
	Mexican Bonos		国 債 証 券	10.0000	2,750	3,484	19,549	2036/11/20
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.5000	6,500	7,136	40,035	2029/05/31
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.5000	5,000	5,611	31,479	2038/11/18
	Mexican Bonos		国 債 証 券	6.5000	13,700	13,646	76,554	2021/06/10
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	22,700	23,763	133,314	2031/05/29
	Mexican Bonos		国 債 証 券	6.5000	8,900	8,836	49,575	2022/06/09
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	4,750	4,958	27,816	2042/11/13
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	10,300	10,800	60,591	2034/11/23
	通貨小計	銘 柄 数 額	14銘柄			126,030	131,611	738,340
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.4980	1,760	1,901	49,905	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8920	1,250	1,289	33,842	2027/03/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2019年12月2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	
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8440	600	608	15,972	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.9550	1,150	1,189	31,204	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.7950	1,100	1,120	29,401	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8000	600	613	16,098	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.7360	1,420	1,584	41,581	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.6200	400	404	10,614	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.0590	2,000	2,071	54,357	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.7620	1,000	1,129	29,639	2037/04/07
通貨小計	銘 柄 数 金 額	10銘柄			11,280	11,913	312,618	
南アフリカ					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	10.5000	8,010	8,870	66,527	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.7500	1,200	1,201	9,008	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.5000	2,610	1,788	13,410	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.7500	2,900	2,929	21,967	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	15,900	13,756	103,175	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.5000	5,250	4,605	34,541	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.0000	2,850	2,625	19,694	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	2,300	1,993	14,949	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.2500	9,700	8,774	65,806	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.8750	10,000	9,227	69,208	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	9.0000	5,300	4,769	35,768	2040/01/31
通貨小計	銘 柄 数 金 額	11銘柄			66,020	60,540	454,057	
ポーランド					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	Poland Government Bond		国債証券	5.7500	1,200	1,337	37,468	2022/09/23
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	640	664	18,609	2026/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.0000	2,000	2,019	56,593	2021/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	1.7500	1,520	1,529	42,853	2021/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	1,815	1,885	52,835	2027/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.2500	800	814	22,814	2022/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	3,000	3,083	86,392	2023/01/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	1,400	1,446	40,521	2024/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	5.7500	600	801	22,463	2029/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	4.0000	710	772	21,637	2023/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.7500	1,500	1,587	44,478	2028/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	3.2500	1,430	1,539	43,128	2025/07/25
通貨小計	銘 柄 数 金 額	12銘柄			16,615	17,480	489,795	
ユーロ (アイルランド)					千ユーロ	千ユーロ		
	IRISH TREASURY		国債証券	5.4000	688	894	108,063	2025/03/13
	IRISH TREASURY		国債証券	3.9000	420	480	58,089	2023/03/20
	IRISH TREASURY		国債証券	3.4000	600	697	84,311	2024/03/18
	IRISH TREASURY		国債証券	2.4000	680	841	101,715	2030/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	2.0000	310	403	48,792	2045/02/18
	IRISH TREASURY		国債証券	1.0000	320	344	41,586	2026/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.7000	570	682	82,489	2037/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	0.9000	500	539	65,237	2028/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.3000	150	169	20,439	2033/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.3500	600	677	81,910	2031/03/18
国小計	銘 柄 数 金 額	10銘柄			4,838	5,730	692,635	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2019年12月2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	
ユーロ（オランダ）	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	千ユーロ 580	千ユーロ 857	千円 103,624	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,200	2,016	243,687	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,332	160,990	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	630	1,134	137,170	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,100	1,169	141,358	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	538	65,058	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	290	388	46,959	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	814	98,478	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	740	1,247	150,732	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	480	536	64,888	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	718	86,800	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	670	711	85,959	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	470	509	61,580	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	409	49,466	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	654	79,103	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	627	75,801	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	150	161	19,475	2040/01/15
国小計	銘柄数 金 額	17銘柄		11,020	13,827	1,671,137	
ユーロ（ベルギー）	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	千ユーロ 670	千ユーロ 713	86,221	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	622	688	83,215	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	610	770	93,153	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	645	78,029	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	414	512	61,924	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	270	393	47,499	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	410	49,662	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	785	94,941	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	522	63,129	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	448	54,181	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	700	825	99,751	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	580	626	75,734	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	571	69,121	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	700	764	92,407	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	100	126	15,234	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	500	738	89,277	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	450	769	93,045	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	550	609	73,642	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	665	1,166	140,940	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	300	391	47,374	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	830	100,412	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	444	53,675	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,000	1,100	133,025	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	340	593	71,721	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	911	110,222	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	419	50,753	2034/06/22
国小計	銘柄数 金 額	26銘柄		13,636	16,782	2,028,299	
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	千ユーロ 2,415	千ユーロ 3,331	402,667	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,000	1,532	185,238	2029/04/25

2019年12月2日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	1,700	2,940	355,432	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	1,310	2,209	266,979	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,232	2,457	297,051	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	650	689	83,370	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,065	1,772	214,214	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	1,200	1,427	172,488	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	1,043	1,904	230,176	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	500	1,044	126,295	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	1,040	1,298	156,978	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	3,314	3,559	430,169	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	1,900	2,065	249,683	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,910	2,366	286,018	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	2,195	2,378	287,420	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	1,090	1,774	214,419	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	2,730	2,953	356,917	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	2,200	2,473	298,992	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	2,686	3,400	410,981	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,360	1,510	182,525	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,100	2,205	266,572	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	500	583	70,581	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,800	1,896	229,204	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	1,000	1,150	139,011	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	600	795	96,196	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,000	1,009	121,964	2021/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	2,970	3,081	372,450	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,600	1,999	241,673	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	1,400	1,531	185,136	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	1,300	1,746	211,117	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,200	1,223	147,838	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	500	539	65,213	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	1,300	1,494	180,574	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	2,250	2,429	293,581	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,200	1,226	148,190	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	3,000	3,039	367,351	2022/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	500	605	73,177	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,000	2,112	255,287	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,000	1,004	121,415	2029/11/25
国小計	銘	柄	数					
			39銘柄		59,760	72,766	8,794,563	
ユーロ（ドイツ）					千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.5000	855	1,317	159,260	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	5.6250	800	1,202	145,346	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.2500	896	1,506	182,120	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	1,660	2,756	333,093	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	970	1,685	203,651	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	690	1,183	142,992	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	720	1,335	161,397	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	610	1,218	147,270	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	606	1,052	127,156	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,542	1,638	198,064	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	1,648	2,635	318,562	2044/07/04

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2019年12月2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	1.5000	1,150	1,230	148,695	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	1,460	1,604	193,935	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	500	550	66,524	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	725	1,186	143,409	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	990	1,084	131,046	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,000	2,152	260,163	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,190	1,257	152,041	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	1,100	1,199	145,006	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	883	941	113,775	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,050	1,087	131,458	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	700	738	89,315	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,100	1,185	143,279	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	1,260	1,661	200,749	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	450	486	58,768	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,900	2,014	243,428	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,700	1,714	207,222	2021/04/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,800	1,821	220,143	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,500	1,523	184,114	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,800	1,833	221,646	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	150	153	18,531	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,000	1,025	123,885	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	500	513	62,041	2024/04/05
国小計	銘柄数 金額	33銘柄			35,905	44,498	5,378,099	
ユーロ (スペイン)					千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	6.0000	1,920	2,898	350,269	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.6000	1,400	1,522	184,021	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.9500	610	703	85,005	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.1500	1,365	1,533	185,371	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.9500	1,000	1,118	135,177	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	2,000	2,039	246,518	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.9000	389	536	64,877	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.4500	680	1,090	131,841	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.3000	1,249	1,348	162,920	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.4000	1,250	1,272	153,842	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	600	656	79,397	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.3500	1,320	1,607	194,289	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.4500	1,170	1,279	154,650	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.4000	950	1,036	125,289	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7000	350	469	56,741	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.0500	1,500	1,512	182,816	2021/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.4500	800	878	106,182	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.8500	300	345	41,778	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.6000	1,200	1,221	147,628	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	980	1,601	193,510	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2000	800	1,230	148,758	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.9000	800	1,383	167,149	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7000	943	1,609	194,556	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	724	784	94,854	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.9000	1,000	1,382	167,053	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.8500	600	681	82,354	2022/01/31

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2019年12月2日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,310	千ユーロ 2,724	千円 329,342	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,588	1,872	226,360	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,100	1,563	188,980	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	890	1,659	200,592	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	820	99,206	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,084	2,374	286,935	2024/10/31
国小計	銘柄数 金 額	32銘柄		34,572	42,762	5,168,275	
ユーロ（イタリア）	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,600	千ユーロ 2,276	千円 275,154	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,135	1,602	193,726	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,600	1,745	210,994	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	705	849	102,622	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	957	115,776	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	535	64,667	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	828	100,151	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,400	1,539	186,036	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,200	1,226	148,215	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	750	795	96,121	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,400	1,416	171,222	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	3,000	3,019	364,907	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	600	641	77,483	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,300	1,427	172,517	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	500	543	65,677	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,500	1,539	186,010	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	350	435	52,595	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,550	1,666	201,439	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	714	86,299	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	537	64,908	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,000	2,281	275,700	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,500	2,743	331,597	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	800	965	116,636	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	200	264	31,927	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	1,161	140,318	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	200	215	26,008	2026/07/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,040	2,792	337,476	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,288	1,908	230,632	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,487	179,724	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	950	1,348	162,991	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,652	199,760	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,420	292,508	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,170	2,515	304,074	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,700	2,078	251,169	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,114	1,645	198,890	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,050	1,284	155,287	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	3,250	3,408	411,979	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,320	1,429	172,771	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	780	866	104,734	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	500	573	69,295	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,770	3,195	386,238	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	80	104	12,594	2028/09/01

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2019年12月2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	4.7500	725	1,069	129,298	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.5000	830	969	117,157	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	3.7500	2,110	2,421	292,616	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	3.5000	1,370	1,655	200,051	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	2.1500	700	730	88,231	2021/12/15
国小計	銘柄数	47銘柄			57,367	67,484	8,156,205	
					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	206	24,953	2031/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.8750	800	858	103,794	2025/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	180	189	22,924	2026/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	1.3750	120	151	18,294	2047/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	200	211	25,571	2027/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	1.1250	150	171	20,734	2034/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	500	529	64,033	2028/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	4.0000	200	250	30,257	2025/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	2.7500	120	150	18,201	2028/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	1.6250	980	1,041	125,846	2022/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	2.6250	210	319	38,578	2042/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	2.0000	350	388	46,975	2024/04/15
国小計	銘柄数	12銘柄			4,000	4,469	540,166	
					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	140	153	18,505	2025/10/20
	Austria Government Bond		国債証券	0.7500	490	525	63,556	2026/10/20
	Austria Government Bond		国債証券	1.5000	120	152	18,397	2047/02/20
	Austria Government Bond		国債証券	1.5000	180	243	29,467	2086/11/02
	Austria Government Bond		国債証券	0.5000	400	422	51,074	2027/04/20
	Austria Government Bond		国債証券	0.7500	600	647	78,199	2028/02/20
	Austria Government Bond		国債証券	0.5000	700	740	89,523	2029/02/20
	Austria Government Bond		国債証券	6.2500	380	570	68,935	2027/07/15
	Austria Government Bond		国債証券	3.5000	660	708	85,633	2021/09/15
	Austria Government Bond		国債証券	4.1500	510	850	102,815	2037/03/15
	Austria Government Bond		国債証券	4.8500	700	931	112,581	2026/03/15
	Austria Government Bond		国債証券	3.6500	400	440	53,266	2022/04/20
	Austria Government Bond		国債証券	3.4000	860	962	116,320	2022/11/22
	Austria Government Bond		国債証券	3.8000	620	1,358	164,225	2062/01/26
	Austria Government Bond		国債証券	3.1500	380	628	76,019	2044/06/20
	Austria Government Bond		国債証券	1.7500	680	740	89,531	2023/10/20
	Austria Government Bond		国債証券	2.4000	230	304	36,839	2034/05/23
	Austria Government Bond		国債証券	1.6500	280	308	37,335	2024/10/21
国小計	銘柄数	18銘柄			8,330	10,691	1,292,232	
通貨小計	銘柄数	234銘柄			229,428	279,013	33,721,614	
合計	銘柄数	456銘柄					90,390,273	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年12月2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（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

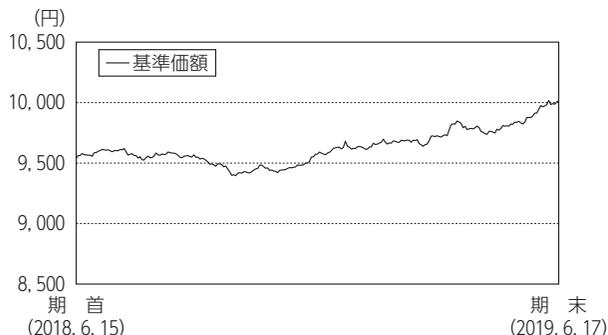
## 大和投資信託

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



《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。

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

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入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。

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

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

		買付額	売付額
外	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 19,752	千南アフリカ・ランド 1,220 ( —)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 4,517	千ポーランド・ズロチ 2,506 ( —)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,770	千ユーロ 502 ( —)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 6,330	千ユーロ 3,256 ( —)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 5,747	千ユーロ 1,288 ( —)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 25,716	千ユーロ 10,591 ( —)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 18,230	千ユーロ 11,944 ( —)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 16,761	千ユーロ 5,374 ( —)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 22,321	千ユーロ 7,321 ( —)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 885	千ユーロ 291 ( —)
国	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 2,999	千ユーロ — ( —)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 100,762	千ユーロ 40,569 ( —)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

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

(注3) 単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2018年6月16日から2019年6月17日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## ■主要な売買銘柄

### 公 社 債

（2018年6月16日から2019年6月17日まで）

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
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）

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	うちB.B格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
		評 価 額		%			5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額						
			千円			%	%	%	
アメリカ	千アメリカ・ドル 366,488	千アメリカ・ドル 381,573	千円 41,461,750	46.6	—	19.5	18.2	8.9	
カナダ	千カナダ・ドル 19,654	千カナダ・ドル 21,696	1,757,455	2.0	—	0.9	0.6	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 20,397	千オーストラリア・ドル 23,311	1,742,068	2.0	—	1.3	0.5	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 3,642	千シンガポール・ドル 3,817	302,610	0.3	—	0.2	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 32,222	千イギリス・ポンド 41,758	5,710,491	6.4	—	5.1	0.9	0.4	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 19,850	千デンマーク・クローネ 25,711	419,606	0.5	—	0.3	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 13,650	千ノルウェー・クローネ 14,251	177,997	0.2	—	0.1	0.0	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 28,650	千スウェーデン・クローネ 32,659	373,950	0.4	—	0.1	0.2	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 98,630	千メキシコ・ペソ 99,114	561,981	0.6	—	0.4	0.1	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 11,280	千マレーシア・リンギット 11,609	302,195	0.3	—	0.3	0.1	—	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 61,020	千南アフリカ・ランド 56,787	417,390	0.5	—	0.4	0.0	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 15,215	千ポーランド・ズロチ 15,891	454,983	0.5	—	0.2	0.2	0.1	
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 4,748	千ユーロ 5,520	672,752	0.8	—	0.5	0.2	0.1	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 11,700	千ユーロ 14,283	1,740,789	2.0	—	1.2	0.7	0.0	

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 区分	額面金額	当期			期末		残存期間別組入比率		
		評価額		組入比率	うちBB格 以下組入 比率	5年以上	2年以上	2年未満	
		外貨建金額	邦貨換算金額						
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 14,870	千ユーロ 17,677	千円 2,154,367	% 2.4	% —	% 1.9	% 0.4	% 0.1	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 57,480	千ユーロ 69,733	8,498,374	9.5	—	6.3	2.5	0.7	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 35,845	千ユーロ 44,336	5,403,291	6.1	—	3.7	1.6	0.7	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 34,672	千ユーロ 42,488	5,178,019	5.8	—	3.9	1.4	0.5	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 55,917	千ユーロ 62,417	7,606,787	8.5	—	5.1	2.5	0.9	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 3,300	千ユーロ 3,713	452,575	0.5	—	0.3	0.2	—	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 8,780	千ユーロ 10,865	1,324,130	1.5	—	1.0	0.4	0.1	
ユーロ (小計)	227,312	271,035	33,031,087	37.1	—	24.0	10.0	3.1	
合計	—	—	86,713,568	97.4	—	52.8	31.1	13.5	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区分	銘柄	種類	年利率	当期			期末		償還年月日
				額面金額	評価額		償還年月日		
					外貨建金額	邦貨換算金額			
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	% 2.6250	千アメリカ・ドル 32,370	千アメリカ・ドル 32,672	千円 3,550,140	2020/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	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		

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					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 金額	56銘柄		366,488	381,573	41,461,750	
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		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 金額	19銘柄			19,654	21,696	1,757,455	
		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 金額	19銘柄			20,397	23,311	1,742,068	
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	226	17,972	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	1,000	1,043	82,739	2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	159	12,611	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	300	324	25,704	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	390	394	31,238	2021/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	89	95	7,551	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	207	16,482	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	120	137	10,918	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	413	32,766	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	350	27,779	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	204	16,172	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	260	20,673	2036/08/01
通貨小計	銘柄数 金額	12銘柄			3,642	3,817	302,610	
		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

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					末		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,725	1,822	249,181	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	249	34,122	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	200	202	27,754	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	720	770	105,322	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,100	1,226	167,738	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,050	1,090	149,148	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	856	117,060	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,000	1,145	156,710	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	863	1,270	173,789	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	700	970	132,780	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	175	217	29,789	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,565	2,276	311,368	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	200	318	43,571	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	450	821	112,275	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	620	1,015	138,894	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	600	773	105,743	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	411	666	91,135	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,283	175,552	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,243	3,812	521,380	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,630	2,471	337,920	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,040	1,136	155,479	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	787	1,437	196,604	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,500	1,556	212,806	2020/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	742	794	108,597	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,380	1,432	195,855	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,425	1,961	268,295	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	2,290	2,447	334,759	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	748	1,327	181,515	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,900	2,107	288,153	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,290	1,859	254,309	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	32銘柄		32,222	41,758	5,710,491	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 5,140	千デンマーク・クローネ 9,758	159,263	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,310	2,518	41,095	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,925	47,744	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,330	2,677	43,693	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,200	5,601	91,419	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,229	36,389	2020/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		19,850	25,711	419,606	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	千ノルウェー・クローネ 2,620	千ノルウェー・クローネ 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		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 金 額	7銘柄			13,650	14,251	177,997	
スウェーデン					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	2,780	3,008	34,445	2020/12/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,920	2,998	34,331	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	12,950	14,531	166,385	2022/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,150	4,525	51,815	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,368	27,114	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,280	2,486	28,472	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,741	31,385	2028/05/12
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄			28,650	32,659	373,950	
メキシコ					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
		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 金 額	14銘柄			98,630	99,114	561,981	
マレーシア					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
		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 金 額	10銘柄			11,280	11,609	302,195	
南アフリカ					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	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

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千南アフリカ・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 金 額	11銘柄			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 金 額	11銘柄			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 金 額	10銘柄			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	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	718	87,555	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	670	710	86,554	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	470	508	61,935	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	409	49,938	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	650	79,322	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	620	75,594	2029/07/15
国 小 計	銘柄数 金 額	17銘柄		11,700	14,283	1,740,789	
ユーロ（ベルギー）				千ユーロ	千ユーロ		
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	670	713	86,975	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,022	1,103	134,456	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	610	732	89,246	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	644	78,517	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	564	641	78,167	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	120	152	18,551	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	411	50,159	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,730	1,850	225,492	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	522	63,665	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	399	48,655	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,280	1,366	166,562	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	553	67,431	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	100	114	13,998	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	500	741	90,316	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	450	750	91,508	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	550	620	75,675	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	534	563	68,698	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	665	1,114	135,800	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	300	396	48,310	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	846	103,207	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	437	53,260	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,000	1,112	135,597	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	340	559	68,184	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	921	112,260	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	407	49,666	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	25銘柄		14,870	17,677	2,154,367	
ユーロ（フランス）				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,415	3,391	413,266	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,000	1,538	187,532	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,700	2,916	355,430	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,310	2,173	264,884	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,532	2,851	347,509	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	650	703	85,693	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,065	1,722	209,862	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,452	177,044	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,043	1,841	224,363	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,040	1,312	159,988	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,270	4,451	542,496	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,314	3,618	440,973	2021/10/25

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末	評 価 額		償 還 年 月 日	
					額 面 金 額	外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額
					千ユーロ	千ユーロ		千円
	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 金 額	33銘柄		57,480	69,733	8,498,374		
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ			
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	855	1,339	163,214	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	1,219	148,607	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,496	2,544	310,058	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,060	1,770	215,712	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	970	1,673	203,897	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	890	1,504	183,403	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	720	1,308	159,453	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	610	1,194	145,591	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	806	1,361	165,986	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,658	202,139	2022/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,548	2,394	291,864	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,243	151,513	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,460	1,624	197,968	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	500	556	67,808	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	725	1,145	139,557	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,094	133,402	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	200	216	26,424	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,263	153,969	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,800	1,974	240,602	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	943	114,990	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	950	982	119,768	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	737	89,871	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	700	752	91,678	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	960	1,209	147,355	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	484	58,986	2028/02/15	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,300	1,367	166,656	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,440	3,482	424,401	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,721	209,816	2021/04/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,829	222,978	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,529	186,440	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	511	62,338	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	150	153	18,759	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,028	125,338	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	514	62,733	2024/04/05
国 小 計	銘柄数 金 額	34銘柄		35,845	44,336	5,403,291	
ユーロ（スペイン）				千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,320	3,540	431,472	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,400	1,531	186,604	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	610	698	85,081	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,865	2,110	257,232	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,000	1,017	124,022	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,000	1,123	136,892	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	389	511	62,394	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	480	713	86,963	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,749	1,889	230,228	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	1,250	1,275	155,420	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	600	657	80,160	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,579	192,440	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	670	732	89,300	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	950	1,036	126,269	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	350	444	54,216	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	3,000	3,026	368,849	2021/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	873	106,436	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	280	457	55,699	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	800	1,206	147,002	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,300	2,186	266,485	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	943	1,563	190,557	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,600	1,715	209,089	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	724	803	97,914	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	600	697	84,972	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,310	2,781	339,028	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,588	1,904	232,146	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,100	1,577	192,260	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	890	1,600	195,086	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	833	101,597	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,084	2,397	292,190	2024/10/31
国 小 計	銘柄数 金 額	30銘柄		34,672	42,488	5,178,019	
ユーロ（イタリア）				千ユーロ	千ユーロ		
	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

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	910	110,921	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	507	61,827	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	810	98,801	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,200	1,189	144,983	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	750	704	85,851	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,400	1,363	166,229	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	3,000	2,982	363,518	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	900	803	97,933	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,300	1,279	155,986	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	500	509	62,036	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,500	1,513	184,439	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	350	368	44,907	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	697	85,055	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	500	60,950	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,000	2,107	256,875	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	200	220	26,922	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	1,063	129,612	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,000	1,012	123,451	2026/07/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	740	936	114,160	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,288	1,750	213,339	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,351	164,707	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,450	1,855	226,183	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	770	891	108,684	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,118	258,139	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,170	2,469	301,008	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,700	2,004	244,295	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,114	1,431	174,443	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	3,050	3,193	389,203	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,850	2,160	263,316	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	3,250	3,439	419,220	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,320	1,439	175,393	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	780	866	105,600	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,770	3,169	386,231	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	80	97	11,940	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,375	1,735	211,484	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	830	943	114,929	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,335	284,570	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,513	184,426	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	700	724	88,319	2021/12/15
国 小 計	銘柄数 金 額	43銘柄		55,917	62,417	7,606,787	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	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

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500%	千ユーロ 120	千ユーロ 150	千円 18,385	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	1.6250	980	1,050	127,989	2022/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	210	308	37,562	2042/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	392	47,796	2024/04/15
国 小 計	銘柄数 金 額	11銘柄			3,300	3,713	452,575	
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	千ユーロ 840	千ユーロ 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 金 額	16銘柄			8,780	10,865	1,324,130	
通貨小計	銘柄数 金 額	219銘柄			227,312	271,035	33,031,087	
合 計	銘柄数 金 額	423銘柄					86,713,568	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外		百万円	百万円
	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	—
国	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。

## 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

### ■投資信託財産の構成

2019年6月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	86,713,568 千円	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。

### ■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。

### ■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
未取利息	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。

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

## 運用報告書 (全体版) 第3期

(決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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			公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込み	騰落 中率			
1期末 (2017年11月30日)	円 10,477	円 0	% 4.8	% 97.9	% -	百万円 1,406
2期末 (2018年11月30日)	10,222	0	△2.4	97.4	-	2,442
3期末 (2019年12月2日)	10,673	0	4.4	97.9	-	2,833

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

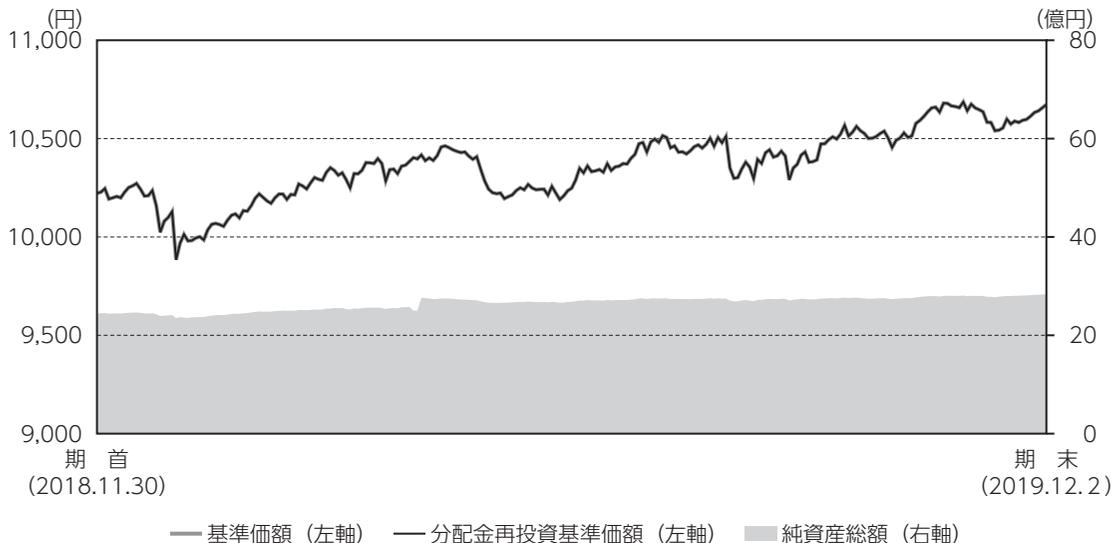
(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：10,222円

期末：10,673円（分配金0円）

騰落率：4.4%（分配金込み）

#### ■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	4.4%	80.0%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	5.8%	19.9%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

主に海外の債券に投資した結果、為替市場で円高が進んだものの、債券の利息収入を獲得したことや債券市場で金利が低下（債券価格は上昇）したことにより、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。

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

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率	債 券 先 物 率
	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2018年11月30日	円 10,222	% -	% 97.4	% -
12月末	10,129	△0.9	98.0	-
2019年 1 月末	10,131	△0.9	97.7	-
2 月末	10,288	0.6	97.7	-
3 月末	10,360	1.4	97.7	-
4 月末	10,344	1.2	98.0	-
5 月末	10,223	0.0	97.7	-
6 月末	10,420	1.9	97.3	-
7 月末	10,479	2.5	97.6	-
8 月末	10,432	2.1	97.7	-
9 月末	10,526	3.0	98.0	-
10月末	10,686	4.5	97.9	-
11月末	10,657	4.3	97.6	-
(期末) 2019年12月 2 日	10,673	4.4	97.9	-

(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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■海外債券市況

海外債券の金利は、当作成期を通してみると低下しました。

先進国の債券市場では、当作成期首より、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、金利は低下しました。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、金利はさらに低下しました。しかし2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから、金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、金利は上昇しました。

新興国の債券市場では、米国の利上げが終了し利下げへと転じる中で、投資家は相対的に高い利回りを求める動きとなり、多くの新興国で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円高が進みました。

先進国の為替相場は、当作成期首より、株価や原油価格が下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。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。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、円安傾向となりました。

新興国の為替相場は、先進国と同様の動きとなり、リスク回避姿勢が強まった局面で下落しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## ベンチマークとの差異について

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

## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ～2019年12月2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）	673

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.12.1~2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	28円	0.272%	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10,365円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0.196)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	6	0.055	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(5)	(0.047)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	34	0.327	

(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。

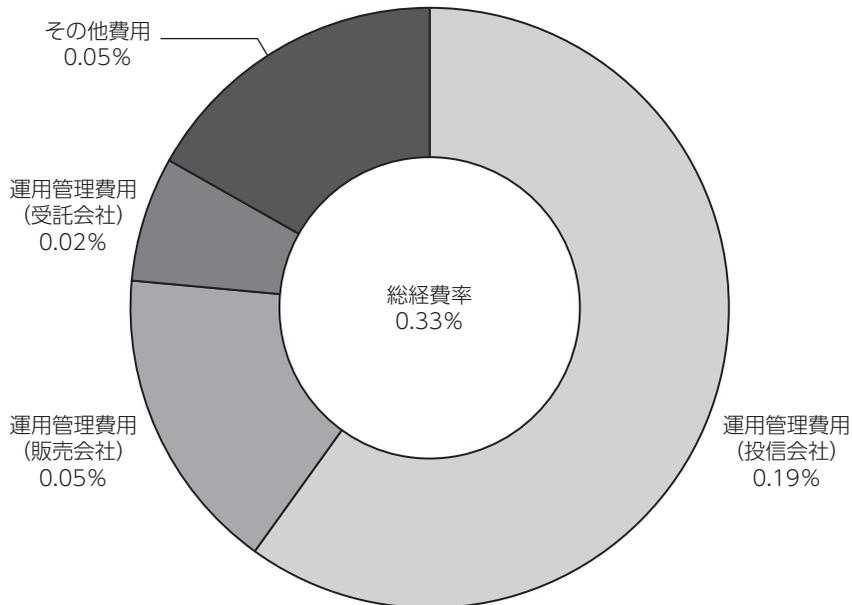
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.33%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	103,329	140,334	72,301	99,377
外国債券インデックス・マザーファンド	165,873	462,188	84,757	236,229

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	368,899	399,927	563,138			
外国債券インデックス・マザーファンド	706,169	787,285	2,267,934			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	563,138	19.8
外国債券インデックス・マザーファンド	2,267,934	79.9
コール・ローン等、その他	8,239	0.3
投資信託財産総額	2,839,312	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1シンガポール・ドル=80.21円、1イギリス・ポンド=141.59円、1トルコ・リラ=19.09円、1デンマーク・クローネ=16.17円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローネ=11.46円、1メキシコ・ペソ=5.61円、1フィリピン・ペソ=2.16円、1アルゼンチン・ペソ=1.83円、100チリ・ペソ=13.55円、100コロンビア・ペソ=3.12円、100インドネシア・ルピア=0.78円、1ブラジル・リアル=25.88円、1チェコ・コルナ=4.73円、1ルーマニア・レイ=25.28円、1ロシア・ルーブル=1.71円、1マレーシア・リンギット=26.24円、1南アフリカ・ランド=7.50円、1タイ・バーツ=3.63円、1ペルー・ソル=32.21円、1ポーランド・ズロチ=28.02円、100ハンガリー・フォリント=36.09円、1ウルグアイ・ペソ=2.90円、1ドミニカ・ペソ=2.07円、1ユーロ=120.86円です。

(注3) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(14,472,156千円)の投資信託財産総額(15,005,644千円)に対する比率は、96.4%です。外国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(188,734,538千円)の投資信託財産総額(194,302,507千円)に対する比率は、97.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,839,312,849円
コール・ローン等	8,239,771
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	563,138,411
外国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	2,267,934,667
(B) 負債	5,566,783
未払解約金	1,663,649
未払信託報酬	3,788,202
その他未払費用	114,932
(C) 純資産総額(A-B)	2,833,746,066
元本	2,655,013,152
次期繰越損益金	178,732,914
(D) 受益権総口数	2,655,013,152口
1万口当り基準価額(C/D)	10,673円

\*期首における元本額は2,389,228,743円、当作成期間中における追加設定元本額は1,008,953,213円、同解約元本額は743,168,804円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,673円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 4,391円
受取利息	613
支払利息	△ 5,004
(B) 有価証券売買損益	115,018,312
売買益	126,346,665
売買損	△ 11,328,353
(C) 信託報酬等	△ 7,428,036
(D) 当期損益金(A+B+C)	107,585,885
(E) 前期繰越損益金	1,203,204
(F) 追加信託差損益金	69,943,825
(配当等相当額)	( 51,512,629)
(売買損益相当額)	( 18,431,196)
(G) 合計(D+E+F)	178,732,914
次期繰越損益金(G)	178,732,914
追加信託差損益金	69,943,825
(配当等相当額)	( 51,512,629)
(売買損益相当額)	( 18,431,196)
分準準備積立金	108,793,480
繰越損益金	△ 4,391

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	86,074,253
(c) 収益調整金	69,943,825
(d) 分配準備積立金	22,719,227
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	178,737,305
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	178,737,305
(h) 受益権総口数	2,655,013,152口

## ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2019年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2019年12月2日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1		171,554	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1		256,274
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1		154,212	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2020/6/11		95,472
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1		153,255	Colombian TES (コロンビア) 11% 2020/7/24		81,630
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2027/1/1		140,748	Poland Government Bond (ポーランド) 1.5% 2020/4/25		64,024
Poland Government Bond (ポーランド) 2.75% 2028/4/25		127,513	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/4/1		60,982
Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2026/7/25		105,568	Poland Government Bond (ポーランド) 2020/7/25		55,580
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/1/1		104,537	Peru Government Bond (ペルー) 7.84% 2020/8/12		53,754
Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2024/4/25		103,150	Poland Government Bond (ポーランド) 5.25% 2020/10/25		51,162
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21		87,569	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1		49,897
Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2031/5/29		81,790	MALAYSIAN GOVERNMENT (マレーシア) 3.659% 2020/10/15		45,081

(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12月2日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（10,492,913千円）の内容です。

#### (1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2019年12月2日現在							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
トルコ	千トルコ・リラ 30,190	千トルコ・リラ 28,651	千円 546,954	% 3.7	% -	% 1.4	% 1.8	% 0.5
メキシコ	千メキシコ・ペソ 231,750	千メキシコ・ペソ 242,981	1,363,124	9.2	-	6.0	2.4	0.8
フィリピン	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 15,183	32,795	0.2	-	-	-	0.2
チリ	千チリ・ペソ 2,525,000	千チリ・ペソ 2,880,205	390,267	2.6	-	2.0	0.2	0.4
コロンビア	千コロンビア・ペソ 26,715,000	千コロンビア・ペソ 28,476,503	888,466	6.0	-	3.9	2.1	0.0
インドネシア	千インドネシア・ルピア 177,449,000	千インドネシア・ルピア 185,830,589	1,449,478	9.8	-	6.9	2.3	0.6
ブラジル	千ブラジル・レアル 54,310	千ブラジル・レアル 54,998	1,423,364	9.6	-	3.3	4.4	1.9
チェコ	千チェコ・コルナ 113,500	千チェコ・コルナ 117,861	557,486	3.8	-	2.5	1.0	0.3

区 分	2019年12月2日現在								
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 14,940	千ルーマニア・レイ 15,230	千円 385,038	% 2.6	% -	% 0.8	% 1.3	% 0.5	
ロシア	千ロシア・ルーブル 697,410	千ロシア・ルーブル 740,848	1,266,850	8.6	-	4.8	3.3	0.5	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 33,480	千マレーシア・リンギット 34,711	910,818	6.2	-	3.6	2.1	0.5	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 185,090	千南アフリカ・ランド 168,627	1,264,703	8.6	-	7.8	0.7	-	
タイ	千タイ・バーツ 338,960	千タイ・バーツ 381,900	1,386,299	9.4	-	6.3	3.0	-	
ペルー	千ペルー・ソル 13,400	千ペルー・ソル 15,584	501,979	3.4	-	3.2	0.2	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 43,580	千ポーランド・ズロチ 45,601	1,277,752	8.6	-	4.2	2.9	1.6	
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 1,454,800	千ハンガリー・フォリント 1,651,785	596,129	4.0	-	1.9	1.8	0.4	
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 8,100	千ウルグアイ・ペソ 7,602	22,047	0.1	-	0.0	0.1	-	
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 11,273	23,336	0.2	0.2	0.2	-	-	
合 計	-	-	14,286,895	96.7	0.2	58.8	29.7	8.2	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年12月2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12月2日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
トルコ	Turkey Government Bond		国 債 証 券	9.5000	千トルコ・リラ 1,660	千トルコ・リラ 1,590	千円 30,366	2022/01/12
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	8.5000	790	730	13,951	2022/09/14
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	7.1000	2,780	2,422	46,249	2023/03/08
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.4000	680	642	12,271	2024/03/20
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	9.0000	1,630	1,461	27,903	2024/07/24
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	8.0000	2,690	2,286	43,644	2025/03/12
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.7000	1,610	1,596	30,479	2021/02/17
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.6000	2,570	2,402	45,869	2026/02/11
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	9.2000	2,010	1,928	36,823	2021/09/22
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	11.0000	2,400	2,364	45,141	2022/03/02
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	11.0000	2,970	2,804	53,543	2027/02/24
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.7000	1,900	1,851	35,353	2022/08/17
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.5000	1,700	1,562	29,827	2027/08/11
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	12.2000	1,400	1,408	26,885	2023/01/18
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	12.4000	2,000	2,028	38,714	2028/03/08
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	16.2000	1,400	1,567	29,930	2023/06/14
通貨小計	銘 柄 数	16銘柄			30,190	28,651	546,954	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2019年12月2日現在								
区分	銘柄	種類	年 利率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	13,900	千メキシコ・ペソ	千円	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	9,500	千メキシコ・ペソ	千円	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	千メキシコ・ペソ	千円	2021/12/09	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,000	千メキシコ・ペソ	千円	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	22,750	千メキシコ・ペソ	千円	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	20,350	千メキシコ・ペソ	千円	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	23,230	千メキシコ・ペソ	千円	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	千メキシコ・ペソ	千円	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	11,230	千メキシコ・ペソ	千円	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	14,100	千メキシコ・ペソ	千円	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	21,950	千メキシコ・ペソ	千円	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,950	千メキシコ・ペソ	千円	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	19,450	千メキシコ・ペソ	千円	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	17,820	千メキシコ・ペソ	千円	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,130	千メキシコ・ペソ	千円	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 金額	15銘柄		231,750	242,981	1,363,124		
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	4.9500	15,000	千フィリピン・ペソ	千円	2021/01/15	
通貨小計	銘柄数 金額	1銘柄		15,000	15,183	32,795		
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	425,000	千チリ・ペソ	千円	2021/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	550,000	千チリ・ペソ	千円	2026/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	千チリ・ペソ	千円	2035/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	千チリ・ペソ	千円	2043/01/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	320,000	千チリ・ペソ	千円	2030/09/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	千チリ・ペソ	千円	2023/03/01	
通貨小計	銘柄数 金額	6銘柄		2,525,000	2,880,205	390,267		
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	千コロンビア・ペソ	千円	2027/06/28	
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	千コロンビア・ペソ	千円	2021/04/14	
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	千コロンビア・ペソ	千円	2023/03/21	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,335,000	千コロンビア・ペソ	千円	2022/05/04	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	4,550,000	千コロンビア・ペソ	千円	2024/07/24	
	Colombian TES	国債証券	6.0000	4,090,000	千コロンビア・ペソ	千円	2028/04/28	
	Colombian TES	国債証券	7.5000	3,810,000	千コロンビア・ペソ	千円	2026/08/26	
	Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	千コロンビア・ペソ	千円	2030/09/18	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	千コロンビア・ペソ	千円	2032/06/30	
	Colombian TES	国債証券	6.2500	2,300,000	千コロンビア・ペソ	千円	2025/11/26	
	Colombian TES	国債証券	7.2500	1,700,000	千コロンビア・ペソ	千円	2034/10/18	
	通貨小計	銘柄数 金額	11銘柄		26,715,000	28,476,503	888,466	
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	千インドネシア・ルピア	千円	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	千インドネシア・ルピア	千円	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	千インドネシア・ルピア	千円	2032/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	千インドネシア・ルピア	千円	2038/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	千インドネシア・ルピア	千円	2024/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,000,000	千インドネシア・ルピア	千円	2039/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	9,000,000	千インドネシア・ルピア	千円	2029/05/15	

2019年12月2日現在								
区分	銘柄	種類	年 利率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	4,000,000	3,960,840	30,894	2030/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	4,000,000	4,007,040	31,254	2025/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	2,200,000	2,210,626	17,242	2035/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	1,600,000	1,762,720	13,749	2021/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	4,700,000	5,663,171	44,172	2025/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	4,180,000	5,152,686	40,190	2030/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	9,210,000	9,534,560	74,369	2021/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,445,645	26,876	2031/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000	11,046,009	86,158	2026/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,033,337	39,260	2032/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	10,344,358	80,685	2027/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	8,660,000	8,836,923	68,928	2022/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	10,910,000	10,699,327	83,454	2023/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000	8,141,286	63,502	2028/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	6,975,000	6,452,712	50,331	2033/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,020,000	12,912,124	100,714	2034/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	14,055,640	109,633	2024/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	7,820,000	8,759,885	68,327	2029/03/15	
通貨小計	銘柄数 金額	25銘柄		177,449,000	185,830,589	1,449,478		
ブラジル				千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル			
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,030	5,299	137,155	2021/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	8,210	9,129	236,269	2023/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	6,390	7,331	189,745	2025/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	7,250	8,519	220,491	2027/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,400	2,878	74,500	2029/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	6,030	5,582	144,486	2021/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	7,200	6,460	167,208	2022/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	4,200	3,647	94,410	2022/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	7,600	6,147	159,096	2023/07/01	
通貨小計	銘柄数 金額	9銘柄		54,310	54,998	1,423,364		
チェコ				千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ			
	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	8,200	8,541	40,402	2021/09/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	12,600	13,732	64,952	2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	10,300	48,720	2024/05/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	10,200	11,157	52,773	2022/09/12	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	17,046	80,630	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	10,900	10,644	50,350	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	12,000	11,406	53,950	2030/05/15	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	9,900	9,572	45,276	2023/10/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	13,000	12,004	56,782	2027/02/10	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	13,456	63,647	2029/07/23	
通貨小計	銘柄数 金額	10銘柄		113,500	117,861	557,486		
ルーマニア				千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ			
	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,517	38,366	2023/04/26	
	Romania Government Bond	国債証券	5.9500	940	973	24,619	2021/06/11	
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,184	29,954	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,130	1,127	28,502	2021/03/22	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	1,200	1,304	32,983	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,080	27,320	2022/12/19	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2019年12月2日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Romania Government Bond		国 債 証 券	3.2500	千ルーマニア・レイ 1,600	千ルーマニア・レイ 1,552	千円 39,254	2024/04/29
	Romania Government Bond		国 債 証 券	3.4000	1,700	1,692	42,787	2022/03/08
	Romania Government Bond		国 債 証 券	4.2500	1,500	1,517	38,371	2023/06/28
	Romania Government Bond		国 債 証 券	4.0000	1,000	1,008	25,502	2021/10/27
	Romania Government Bond		国 債 証 券	5.0000	1,200	1,240	31,352	2029/02/12
	Romania Government Bond		国 債 証 券	4.8500	1,000	1,029	26,021	2026/04/22
通貨小計	銘 柄 数 金 額	12銘柄			14,940	15,230	385,038	
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.6000	千ロシア・ルーブル 14,880	千ロシア・ルーブル 15,253	26,083	2021/04/14
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	8.1500	41,760	46,351	79,261	2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.6000	32,910	34,474	58,952	2022/07/20
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.0000	14,400	14,847	25,390	2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.0500	46,160	48,500	82,935	2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.0000	24,300	25,124	42,962	2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.5000	29,300	30,108	51,485	2021/08/18
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	8.5000	31,000	36,332	62,128	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.7500	56,100	60,891	104,124	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.4000	39,000	40,688	69,577	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.7000	47,000	51,805	88,587	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.1000	35,600	37,033	63,326	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.0000	49,000	50,139	85,738	2021/12/15
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	6.5000	38,000	38,594	65,996	2024/02/28
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.2500	45,000	47,839	81,805	2034/05/10
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	6.9000	39,000	40,667	69,541	2029/05/23
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.9500	36,000	39,455	67,469	2026/10/07
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.4000	38,000	39,926	68,274	2024/07/17
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.1500	22,000	23,038	39,395	2025/11/12
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.6500	18,000	19,773	33,811	2030/04/10
通貨小計	銘 柄 数 金 額	20銘柄			697,410	740,848	1,266,850	
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	3.9480	千マレーシア・リンギット 2,000	千マレーシア・リンギット 2,039	53,505	2022/04/14
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	4.2580	1,800	1,897	49,802	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	4.0940	2,000	2,066	54,217	2023/11/30
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	4.3690	1,700	1,813	47,579	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	4.1300	1,500	1,577	41,398	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	3.6550	1,700	1,730	45,413	2024/10/15
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	3.7260	1,400	1,427	37,453	2026/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.1600	1,350	1,372	36,018	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.7330	2,500	2,550	66,919	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.1810	1,740	1,810	47,496	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.9550	1,850	1,913	50,198	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8000	1,400	1,431	37,562	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.9000	1,300	1,340	35,186	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.6200	1,200	1,213	31,843	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.0590	1,420	1,470	38,593	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8990	2,120	2,190	57,479	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.7620	1,700	1,920	50,387	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.7570	1,400	1,427	37,457	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.9060	2,000	2,066	54,229	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8850	1,400	1,450	38,073	2029/08/15
通貨小計	銘 柄 数 金 額	20銘柄			33,480	34,711	910,818	

2019年12月2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	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	10.5000	千南アフリカ・ランド 30,050	千南アフリカ・ランド 33,277	千円 249,580	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	6.2500	10,220	7,247	54,353	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	6.5000	9,880	6,768	50,765	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	7.0000	11,440	9,531	71,484	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	7.7500	13,880	14,018	105,141	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.7500	23,520	20,349	152,621	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.5000	14,500	12,720	95,400	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.0000	15,100	13,912	104,346	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.7500	13,100	11,352	85,147	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.2500	15,300	13,839	103,797	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.8750	14,100	13,011	97,583	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	9.0000	14,000	12,597	94,482	2040/01/31
通貨小計	銘 金	柄 数 額			185,090	168,627	1,264,703	
タイ	Thailand Government Bond		国 債 証 券	4.8750	千タイ・パーツ 26,050	千タイ・パーツ 33,565	121,841	2029/06/22
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.6250	19,300	20,821	75,582	2023/06/16
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.8500	20,610	23,453	85,137	2025/12/12
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.6500	30,600	32,055	116,360	2021/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.6500	22,700	27,276	99,013	2031/06/20
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	1.8750	21,200	21,505	78,064	2022/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.4000	25,100	30,537	110,849	2036/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.1250	23,400	24,388	88,531	2026/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.0000	26,000	26,531	96,310	2022/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.7750	29,000	35,533	128,986	2032/06/25
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.8750	21,000	25,041	90,901	2046/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.4000	22,000	22,901	83,132	2023/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.8750	26,000	28,780	104,472	2028/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.3000	16,000	19,480	70,714	2038/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	1.4500	10,000	10,027	36,399	2024/12/17
通貨小計	銘 金	柄 数 額			338,960	381,900	1,386,299	
ペルー	Peru Government Bond		国 債 証 券	5.7000	千ペルー・ソル 730	千ペルー・ソル 813	26,216	2024/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	6.3500	1,970	2,281	73,472	2028/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	6.1500	1,850	2,080	67,012	2032/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	5.9400	1,900	2,139	68,897	2029/02/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	5.4000	1,000	1,037	33,415	2034/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	8.2000	1,965	2,470	79,584	2026/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	6.9000	2,065	2,463	79,353	2037/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	6.9500	1,920	2,298	74,028	2031/08/12
通貨小計	銘 金	柄 数 額			13,400	15,584	501,979	
ポーランド	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 2,210	千ポーランド・ズロチ 2,462	69,003	2022/09/23
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	6,240	6,475	181,445	2026/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.0000	2,260	2,282	63,950	2021/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	1.7500	4,230	4,256	119,257	2021/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	3,640	3,781	105,961	2027/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.2500	3,200	3,256	91,259	2022/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	3,000	3,083	86,392	2023/01/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	3,500	3,615	101,303	2024/04/25

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2019年12月2日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond		国債証券	2.7500	1,700	1,814	50,837	2029/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	5.7500	1,820	1,968	55,155	2021/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	4.0000	2,530	2,751	77,102	2023/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.7500	5,700	6,032	169,017	2028/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	3.2500	3,550	3,821	107,066	2025/07/25
通貨小計	銘	柄	数					
	金	額	額					
			13		43,580	45,601	1,277,752	
ハンガリー	Hungary Government Bond		国債証券	3.0000	98,500	108,698	39,229	2024/06/26
	Hungary Government Bond		国債証券	3.0000	170,000	188,861	68,160	2027/10/27
	Hungary Government Bond		国債証券	2.5000	89,000	93,223	33,644	2021/10/27
	Hungary Government Bond		国債証券	1.7500	140,000	145,927	52,665	2022/10/26
	Hungary Government Bond		国債証券	2.7500	130,000	141,983	51,241	2026/12/22
	Hungary Government Bond		国債証券	0.5000	60,000	60,401	21,798	2021/04/21
	Hungary Government Bond		国債証券	6.7500	88,000	125,118	45,155	2028/10/22
	Hungary Government Bond		国債証券	3.0000	120,000	131,829	47,577	2030/08/21
	Hungary Government Bond		国債証券	2.5000	160,000	171,752	61,985	2024/10/24
	Hungary Government Bond		国債証券	6.0000	131,800	160,611	57,964	2023/11/24
	Hungary Government Bond		国債証券	7.0000	125,000	147,106	53,090	2022/06/24
	Hungary Government Bond		国債証券	5.5000	142,500	176,272	63,616	2025/06/24
通貨小計	銘	柄	数					
	金	額	額					
			12		1,454,800	1,651,785	596,129	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond		国債証券	9.8750	5,300	5,196	15,070	2022/06/20
	Uruguay Government International Bond		国債証券	8.5000	2,800	2,406	6,977	2028/03/15
通貨小計	銘	柄	数					
	金	額	額					
			2		8,100	7,602	22,047	
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond		国債証券	9.7500	11,000	11,273	23,336	2026/06/05
通貨小計	銘	柄	数					
	金	額	額					
			1		11,000	11,273	23,336	
合 計	銘	柄	数					
	金	額	額					
			208				14,286,895	

(注1) 邦貨換算金額は、2019年12月2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20期 (決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2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

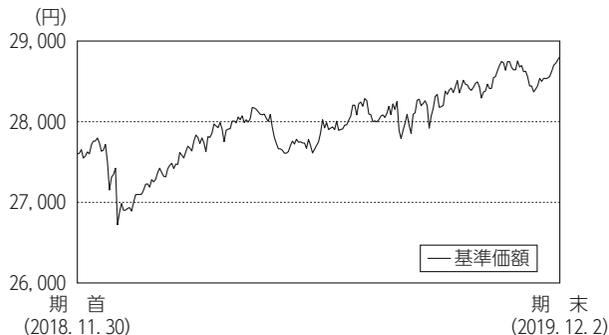
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2018年11月30日	27,598	—	27,840	—	98.3	—
12月末	27,423	△ 0.6	27,597	△ 0.9	98.6	—
2019年1月末	27,253	△ 1.3	27,618	△ 0.8	98.2	—
2月末	27,636	0.1	27,940	0.4	98.2	—
3月末	28,006	1.5	28,200	1.3	98.4	—
4月末	27,927	1.2	28,146	1.1	98.4	—
5月末	27,705	0.4	28,117	1.0	98.2	—
6月末	28,067	1.7	28,358	1.9	98.3	—
7月末	28,151	2.0	28,429	2.1	98.0	—
8月末	28,338	2.7	28,650	2.9	98.2	—
9月末	28,474	3.2	28,848	3.6	98.4	—
10月末	28,753	4.2	29,007	4.2	98.3	—
11月末	28,767	4.2	29,059	4.4	98.2	—
(期末) 2019年12月2日	28,807	4.4	29,079	4.5	98.4	—

- (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、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：27,598円 期末：28,807円 騰落率：4.4%

【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、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、当作成期を通してみると低下しました。

当作成期首より、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、金利は低下しました。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、金利はさらに低下しました。しかし2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから、金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU(欧州連合)離脱交渉の進展期待が高まる中で、金利は上昇しました。

○ 為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると円高となりました。

当作成期首より、株価や原油価格が下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。2019年1月に入ると、FRB(米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。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU(欧州連合)離脱交渉の進展期待が高まる中で、円安傾向となりました。

◆ 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

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

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.4%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 (保管費用)	7 ( 7)
(その他)	( 0)
合 計	7

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

(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況  
公 社 債

(2018年12月 1 日から2019年12月 2 日まで)

		買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	千アメリカ・ドル 245,163	千アメリカ・ドル 145,650 ( —)
	カナダ	千カナダ・ドル 13,049	千カナダ・ドル 10,735 ( —)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 7,870	千オーストラリア・ドル 4,835 ( —)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 2,128	千シンガポール・ドル 930 ( —)
	イギリス	千イギリス・ポンド 10,667	千イギリス・ポンド 7,560 ( —)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 9,790	千デンマーク・クローネ 12,592 ( —)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 4,460	千ノルウェー・クローネ — ( —)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 6,090	千スウェーデン・クローネ 1,428 ( —)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 60,253	千メキシコ・ペソ 41,228 ( —)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 6,155	千マレーシア・リンギット 2,409 ( —)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 26,117	千南アフリカ・ランド 5,816 ( —)

		買 付 額	売 付 額
外 国	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 10,324	千ポーランド・ズロチ 5,442 ( —)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,797	千ユーロ 1,689 ( —)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 3,520	千ユーロ 2,577 ( —)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 4,744	千ユーロ 2,191 ( —)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 29,328	千ユーロ 16,185 ( —)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 16,941	千ユーロ 12,885 ( —)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 15,235	千ユーロ 10,441 ( —)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 26,499	千ユーロ 15,340 ( —)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,163	千ユーロ 1,412 ( —)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 2,884	千ユーロ 1,837 ( —)
ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 102,115	千ユーロ 64,561 ( —)	

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2028/11/15	834,759	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15	498,874
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2029/5/15	768,259	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) 1.625% 2029/8/15	750,065	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) 2.625% 2029/2/15	734,613	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) 3.375% 2048/11/15	611,832	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) 2.25% 2021/4/30	596,079	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2020/5/15	428,195
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2049/5/15	570,800	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% 2023/11/30	560,746	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2020/11/15	395,218
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2021/9/30	554,385	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.5% 2020/10/25	386,822
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	548,827	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2020/5/25	378,099

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

### (1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

区 分	当 期			未				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
			千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 788,539	千アメリカ・ドル 827,399	90,749,185	47.6	—	20.7	17.6	9.4
カナダ	千カナダ・ドル 39,501	千カナダ・ドル 43,364	3,582,815	1.9	—	0.9	0.7	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 42,734	千オーストラリア・ドル 49,725	3,692,093	1.9	—	1.4	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 8,763	千シンガポール・ドル 9,383	752,624	0.4	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 64,723	千イギリス・ポンド 85,751	12,141,510	6.4	—	5.0	1.0	0.3
デンマーク	千デンマーク・クローネ 43,861	千デンマーク・クローネ 58,110	939,640	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 33,232	千ノルウェー・クローネ 34,453	409,991	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 48,465	千スウェーデン・クローネ 54,601	625,736	0.3	—	0.2	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 264,060	千メキシコ・ペソ 276,731	1,552,461	0.8	—	0.5	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 31,473	千マレーシア・リンギット 33,021	866,480	0.5	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 155,177	千南アフリカ・ランド 139,978	1,049,840	0.6	—	0.5	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 36,091	千ポーランド・ズロチ 37,959	1,063,629	0.6	—	0.2	0.2	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 率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 8,773	千ユーロ 10,203	千円 1,233,215	% 0.6	% —	% 0.5	% 0.1	% —
	オランダ	千ユーロ 23,278	千ユーロ 28,849	3,486,703	1.8	—	1.2	0.6	0.1
	ベルギー	千ユーロ 28,635	千ユーロ 36,287	4,385,678	2.3	—	1.7	0.5	0.1
	フランス	千ユーロ 124,587	千ユーロ 151,726	18,337,689	9.6	—	6.5	2.3	0.8
	ドイツ	千ユーロ 79,375	千ユーロ 96,372	11,647,594	6.1	—	3.7	1.8	0.7
	スペイン	千ユーロ 70,321	千ユーロ 86,239	10,422,888	5.5	—	3.8	1.3	0.4
	イタリア	千ユーロ 119,626	千ユーロ 138,773	16,772,188	8.8	—	5.2	2.6	1.0
	フィンランド	千ユーロ 7,553	千ユーロ 8,500	1,027,361	0.5	—	0.3	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 17,305	千ユーロ 21,435	2,590,703	1.4	—	0.9	0.4	0.1
	小計	479,453	578,388	69,904,023	36.7	—	23.9	9.6	3.2
合 計	—	—	187,330,033	98.4	—	54.3	30.3	13.8	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(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、価格情報会社よりデータを入力しています。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ア メ リ カ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	千アメリカ・ドル 4,076	千アメリカ・ドル 4,170	千円 457,409	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,605	285,728	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,553	280,066	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,168	237,845	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,249	356,384	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,467	270,660	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,544	279,122	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,168	8,171	896,242	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,403	482,995	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,704	516,014	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,711	516,790	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,234	574,108	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,509	275,220	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,020	221,641	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,463	599,187	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,655	181,602	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,740	190,883	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,841	311,665	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,094	558,778	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	7,907	7,967	873,908	2021/04/30
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,745	301,108	2021/05/31	

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			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,510	384,979	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,360	258,946	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	762	83,591	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,071	117,476	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	827	90,778	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	940	103,133	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	910	99,874	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	950	104,258	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	773	1,001	109,852	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,373	150,683	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,091	1,486	163,023	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,326	1,798	197,212	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	747	1,082	118,722	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	746	81,831	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	718	78,799	2038/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,249	1,535	168,454	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,513	166,032	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,477	162,019	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,663	182,407	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	2,010	2,852	312,892	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	2,037	223,516	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	2,061	226,072	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,998	219,222	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,542	278,887	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,891	207,421	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,745	191,490	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,693	185,736	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,897	208,105	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,550	170,110	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,457	269,566	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,630	2,899	317,979	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,826	3,309	363,035	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,898	4,387	481,239	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,064	3,879	425,508	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,625	507,278	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,117	5,224	572,975	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,657	4,472	490,561	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,859	313,674	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,367	698,340	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,929	4,624	507,250	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,308	143,524	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,654	400,850	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,177	238,848	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,089	667,930	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,846	4,435	486,516	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,899	317,970	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,200	351,051	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,420	265,485	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,841	640,713	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,978	436,358	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,813	198,907	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,900	318,147	2022/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,922	649,606	2025/05/15	

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	4,435	486,538	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,620	287,423	2022/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,844	311,964	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,858	313,516	2022/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,201	241,456	2022/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,843	640,959	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,073	4,610	505,707	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,462	270,071	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,482	272,229	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,022	660,496	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	4,298	471,509	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,577	282,685	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,093	339,301	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,357	697,260	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,044	333,923	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,068	555,948	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,114	341,625	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,339	585,641	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,571	282,073	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,627	397,895	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,285	360,376	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,262	4,247	465,848	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,983	327,277	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,115	232,068	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,029	6,994	767,139	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,440	267,643	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,070	227,126	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,623	397,431	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,687	294,791	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,500	274,263	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,478	271,841	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,975	326,364	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,322	583,802	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,507	384,697	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,665	402,009	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,666	402,135	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,744	300,977	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,379	260,928	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,482	272,322	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	3,013	330,490	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,500	6,619	726,002	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,976	326,466	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,500	274,241	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,350	3,809	417,776	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,538	278,393	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,405	263,805	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,014	220,917	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,561	280,945	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,340	5,529	606,506	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,025	331,810	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,541	278,763	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	4,128	452,787	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,025	331,810	2022/02/28	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,346	257,309	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	7,550	7,704	845,026	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,917	319,958	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,958	653,552	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	4,075	447,009	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,018	331,017	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,046	334,153	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,010	330,194	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,800	5,891	646,226	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,011	330,349	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,437	267,385	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,119	671,171	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,920	320,282	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,064	336,107	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,800	4,224	463,342	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,201	351,193	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,021	221,757	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,519	276,297	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,500	1,533	168,144	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,528	277,284	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,707	626,048	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	3,893	427,035	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,600	394,943	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,003	219,761	2020/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,272	358,897	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,881	316,028	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,307	253,109	2021/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,581	392,816	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,300	6,782	743,885	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,516	276,009	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,403	373,337	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,707	296,996	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,848	312,399	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,600	4,197	460,365	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,200	3,228	354,085	2021/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,982	327,140	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,040	333,476	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,500	2,523	276,758	2021/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,011	549,617	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,072	775,742	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,000	3,040	333,472	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,593	284,438	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,018	221,416	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,774	413,940	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,595	284,674	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	5,000	5,071	556,258	2021/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,587	283,753	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,171	347,880	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,350	367,441	2021/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	4,550	4,730	518,885	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,302	800,934	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,200	4,904	537,958	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,545	279,179	2021/08/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,661	291,872	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,746	410,949	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,807	417,610	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	3,567	391,238	2021/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,680	293,950	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,138	344,205	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,066	336,351	2021/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,683	294,312	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,187	459,317	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,093	448,981	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	7,300	8,120	890,610	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,800	6,001	658,243	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,526	277,057	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,200	350,990	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	5,000	5,240	574,745	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,800	2,855	313,160	2021/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,035	442,589	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,685	404,240	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,597	284,932	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,054	334,962	2022/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,077	776,254	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,055	335,117	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,027	332,083	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,138	453,869	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,633	288,872	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,600	5,379	590,060	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,029	332,290	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,616	287,007	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,399	372,885	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,559	390,432	2022/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,580	283,067	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,700	3,753	411,728	2022/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,440	377,353	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,850	5,547	608,415	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,900	7,256	795,872	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,591	393,926	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,912	319,388	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,000	2,013	220,893	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,513	385,361	2022/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,074	337,213	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,516	385,737	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,697	515,233	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,000	4,038	442,931	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,000	4,014	440,277	2022/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,700	4,706	516,155	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,518	385,887	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,018	221,432	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,900	6,799	745,735	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,500	3,489	382,755	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,850	4,891	536,474	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,100	3,090	339,011	2021/08/31

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期				未		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,738	300,335	2026/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,930	431,042	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,992	328,177	2022/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,100	5,087	557,947	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,483	272,357	2026/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,981	326,957	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,900	2,880	315,947	2022/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,980	326,878	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,550	2,543	278,973	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,500	4,468	490,124	2026/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,993	328,293	2029/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,000	2,073	227,430	2049/11/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	243銘柄		788,539	827,399	90,749,185		
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	425	591	48,840	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	586	853	70,555	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,351	111,663	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,704	140,828	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,695	140,121	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,962	162,137	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	978	80,870	2021/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,801	148,831	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	2,200	181,846	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,251	103,414	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,466	121,157	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,297	1,656	136,851	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,202	99,384	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,369	1,370	113,260	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,837	1,816	150,062	2021/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,480	2,444	201,940	2021/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,198	98,981	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,440	1,405	116,156	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,750	1,723	142,416	2022/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,250	103,276	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,610	133,035	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	1,017	84,069	2023/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	890	991	81,923	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,305	107,837	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,237	102,235	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	301	24,949	2021/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,050	1,051	86,888	2021/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,400	115,737	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	399	32,990	2021/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	550	537	44,425	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	795	65,686	2021/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	600	592	48,991	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,200	2,196	181,447	2022/02/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	33銘柄		39,501	43,364	3,582,815		

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千オーストラリア・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	2,596	192,758	2021/05/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,447	181,759	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,402	178,422	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,297	244,830	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,692	199,901	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,304	2,760	205,002	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,698	3,050	226,523	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,780	132,199	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,148	3,814	283,223	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,527	113,401	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	807	974	72,372	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	842	1,103	81,902	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,672	3,038	225,619	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,078	2,289	170,007	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,633	121,311	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,848	137,247	2021/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,800	3,215	238,714	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,550	1,622	120,506	2022/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,400	2,789	207,104	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,770	3,168	235,256	2030/05/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	390	478	35,492	2041/05/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,140	1,192	88,532	2031/06/21		
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄		42,734	49,725	3,692,093		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	868	69,631	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	456	36,642	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	662	53,132	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	398	31,925	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	500	40,132	2021/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	452	36,287	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	698	56,049	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	618	733	58,807	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	325	357	28,686	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	544	43,669	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	781	62,723	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	257	20,630	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	460	457	36,722	2021/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	502	40,325	2022/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	300	314	25,254	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	452	36,329	2023/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	589	47,291	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	190	193	15,494	2024/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	150	160	12,890	2039/07/01	
	通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		8,763	9,383	752,624	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,821	1,979	280,223	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,500	354,001	2021/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,531	358,398	2065/07/22	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	当 期 末			償 還 年 月 日
					評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	千 円	
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド			
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,561	221,028	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	2,320	2,319	328,475	2022/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,390	1,489	210,842	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,650	1,824	258,387	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,430	1,711	242,300	2057/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,510	1,590	225,192	2027/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,000	2,017	285,618	2023/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	2,300	2,502	354,392	2028/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	930	1,135	160,806	2071/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,900	1,940	274,729	2024/04/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	370	419	59,439	2049/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	962	136,229	2054/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,300	1,322	187,220	2029/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	100	100	14,230	2025/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,225	173,498	2021/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,399	198,104	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,883	266,704	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,815	257,072	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	3,017	427,250	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,380	337,088	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	3,288	465,606	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,558	503,789	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,591	225,395	2027/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,946	3,253	460,610	2042/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,330	1,897	268,612	2030/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,697	381,965	2049/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,251	318,799	2039/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,490	211,038	2022/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,510	2,251	318,798	2034/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,374	2,666	377,591	2060/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,490	352,615	2040/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	803	848	120,092	2021/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,646	374,713	2052/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,318	328,228	2022/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,066	2,953	418,252	2044/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,068	292,873	2023/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,641	3,124	442,392	2068/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,392	1,538	217,853	2024/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	3,185	451,045	2045/01/22	
通貨小計	銘柄数	42銘柄						
	金額			64,723	85,751	12,141,510		
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ			
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	12,162	23,542	380,681	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	7,550	8,103	131,030	2021/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,262	85,102	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,513	7,420	119,984	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,521	137,791	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,090	4,437	71,752	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	800	822	13,296	2022/11/15	
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額			43,861	58,110	939,640		

		当 期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	千ノルウェー・クローネ 6,998	千ノルウェー・クローネ 7,254	千円 86,324	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,204	5,335	63,492	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,393	52,286	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,484	41,463	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,389	40,340	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,556	42,323	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,681	43,810	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,250	3,357	39,950	2029/09/06
	通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		33,232	34,453	409,991
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	千スウェーデン・クローネ 9,095	千スウェーデン・クローネ 9,578	109,770	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	6,581	75,426	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,277	106,319	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,527	86,266	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,595	6,438	73,781	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	6,138	70,347	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,550	4,872	55,841	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,900	4,186	47,982	2029/11/12
	通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		48,465	54,601	625,736
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 15,290	千メキシコ・ペソ 14,327	80,379	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	13,300	14,328	80,382	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	13,000	13,088	73,423	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	13,300	13,866	77,791	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	5,000	4,977	27,924	2023/03/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	20,633	21,421	120,172	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	26,990	151,417	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	26,468	27,171	152,433	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	11,244	63,083	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	19,544	21,457	120,376	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	12,194	13,684	76,772	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	26,326	26,222	147,108	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,624	76,435	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	24,599	24,424	137,023	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	18,654	19,472	109,238	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	9,944	10,427	58,497	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		264,060	276,731	1,552,461	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 573	千マレーシア・リンギット 576	15,134	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	836	21,946	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,272	33,402	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,948	51,119	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,604	42,104	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,374	36,056	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	882	23,161	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	754	19,790	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	646	16,963	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,012	26,562	2023/03/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 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		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,447	37,988	2033/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,186	1,209	31,746	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	682	17,897	2043/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,099	28,852	2024/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	871	22,864	2021/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	762	19,997	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,182	31,031	2022/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	869	22,826	2035/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,331	34,933	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	1,037	27,233	2046/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	670	17,593	2026/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	355	9,340	2021/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	900	916	24,051	2022/03/10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	776	20,384	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	890	919	24,130	2027/11/16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050	1,186	31,121	2037/04/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,234	32,390	2025/03/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	800	815	21,404	2023/04/20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	700	768	20,174	2033/11/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	685	17,994	2038/06/08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	671	17,624	2026/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	910	943	24,747	2029/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,100	1,268	33,285	2048/07/06	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	404	10,620	2024/06/14	
通貨小計	銘柄数	34銘柄						
	金 額			31,473	33,021	866,480		
南アフリカ				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド			
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	21,934	24,289	182,172	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,612	8,234	61,756	2036/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,626	34,696	2021/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,100	45,750	2041/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	9,999	8,330	62,480	2031/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	8,439	8,523	63,925	2023/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	21,552	18,646	139,850	2048/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	11,021	9,668	72,511	2037/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	14,862	13,693	102,701	2030/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	12,644	10,957	82,183	2044/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	10,743	9,717	72,881	2032/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	10,166	9,380	70,357	2035/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	8,679	7,809	58,572	2040/01/31	
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金 額			155,177	139,978	1,049,840		
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ			
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,572	72,095	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,504	98,195	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,147	60,186	2021/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	3,069	86,017	2021/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,981	83,546	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,361	66,162	2022/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,850	2,929	82,073	2023/01/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,570	2,654	74,385	2024/04/25	

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,040	2,177	61,004	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	800	784	21,991	2021/05/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	1,900	1,944	54,472	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,104	30,961	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,172	32,850	2021/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625	2,855	79,997	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,750	2,910	81,543	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,788	78,143	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				36,091	37,959	1,063,629	
					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	1,469	177,645	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	576	69,706	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	705	85,295	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	941	113,831	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	531	64,210	2022/03/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	781	1,017	122,925	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,153	139,445	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	658	79,594	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	350	354	42,870	2022/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	539	65,237	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	700	789	95,386	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	200	225	27,303	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	700	769	92,996	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	400	469	56,767	2050/05/15
国小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				8,773	10,203	1,233,215	
					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	688	83,263	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,831	221,364	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,555	2,612	315,777	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	900	108,840	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,549	2,790	337,266	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,555	188,007	2021/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,548	187,107	2022/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,564	189,132	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,504	181,857	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,549	2,610	315,519	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,693	204,669	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,343	162,404	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,420	171,662	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,215	146,952	2022/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,200	1,300	157,226	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,432	173,132	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,150	1,254	151,614	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	1,149	138,969	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	400	429	51,935	2040/01/15
国小計	銘柄数	19銘柄						
	金額				23,278	28,849	3,486,703	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,489	180,036	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,274	1,410	170,444	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	758	957	115,755	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,392	168,256	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	944	1,168	141,198	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	440	640	77,406	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	490	503	60,836	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,506	182,078	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,096	132,571	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	460	665	80,398	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	353	42,750	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,640	1,771	214,144	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	550	629	76,033	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	800	873	105,608	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	600	756	91,406	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,520	304,614	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,915	352,333	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	971	117,425	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,935	354,787	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,575	190,406	2021/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,307	158,073	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,497	181,016	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	980	1,450	175,339	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,472	177,988	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	953	1,663	201,032	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,715	207,355	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,045	126,376	2034/06/22
国 小 計	銘柄数	27銘柄						
	金 額				28,635	36,287	4,385,678	
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	1,985	2,605	314,873	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	4,173	504,376	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,023	4,633	559,975	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,855	586,882	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,483	541,907	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,664	3,319	401,212	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,427	414,288	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,624	4,366	527,791	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,097	4,872	588,902	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,084	5,631	680,597	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	2,438	294,774	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,929	474,859	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	4,150	4,457	538,685	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	3,946	477,026	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,699	4,583	553,917	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	2,918	352,761	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,438	3,968	479,592	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,620	437,583	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,470	419,405	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,087	5,174	625,346	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,399	3,774	456,180	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,292	3,457	417,884	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,601	2,814	340,115	2025/11/25

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
						千ユーロ	千円	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,420	5,162	623,936	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,737	3,937	475,853	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,969	3,414	412,726	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,037	1,375	166,260	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,770	2,795	337,842	2021/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,300	3,424	413,834	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,060	490,773	2022/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,870	2,337	282,456	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,735	330,600	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,250	3,023	365,396	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,446	295,676	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,100	4,424	534,746	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,417	292,213	2021/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,150	2,470	298,641	2034/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,950	3,184	384,917	2028/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,452	296,381	2024/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,418	171,430	2022/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,500	3,027	365,888	2050/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,500	2,640	319,109	2029/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,246	271,512	2025/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,808	218,548	2029/11/25
国 小 計	銘柄数 金 額	44銘柄			124,587	151,726	18,337,689	
ユ ー ロ ( ド イ ツ )					千ユーロ	千ユーロ		
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,251	151,283	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,367	2,106	254,630	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,047	247,451	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,250	1,818	219,780	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,599	193,300	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,404	290,554	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	3,083	372,660	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,551	429,183	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,272	274,599	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,599	3,194	386,040	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,374	2,385	288,306	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,415	291,973	2021/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,778	214,895	2021/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,487	179,757	2021/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	2,965	358,452	2022/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,361	285,407	2022/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,438	3,899	471,270	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,743	210,661	2022/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,508	182,314	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,953	236,061	2023/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,757	212,398	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,718	207,689	2024/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,609	4,270	516,074	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,745	210,998	2024/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,659	200,585	2024/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,319	280,318	2025/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,327	281,313	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,311	279,349	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,952	356,816	2026/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期				未		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,689	204,148	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,478	299,585	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,750	2,306	278,818	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	1,620	195,896	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	2,014	243,428	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,544	307,528	2029/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,966	237,671	2029/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	382	46,183	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	704	85,157	2020/12/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	403	48,739	2021/03/12
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,203	2021/06/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	505	61,109	2021/09/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	202	24,485	2021/12/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,591	192,351	2021/04/09
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,416	171,222	2021/10/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,160	1,178	142,381	2022/04/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,139	258,587	2022/10/07
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	730	746	90,184	2023/04/14
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,947	235,381	2023/10/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	2,310	279,187	2024/04/05
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,234	149,206	2024/10/18
国 小 計	銘柄数 金 額	50銘柄			79,375	96,372	11,647,594	
ユーロ (スペイン)					千ユーロ	千ユーロ		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,352	3,550	429,080	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,445	2,659	321,379	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,365	285,954	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	2,013	243,359	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,938	234,261	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,781	215,333	2021/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,552	2,141	258,843	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,150	1,844	222,967	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,030	2,190	264,794	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	2,080	2,118	255,994	2022/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,500	2,737	330,821	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,850	2,253	272,300	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,242	270,968	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,300	1,307	158,030	2021/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,000	1,022	123,547	2022/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,600	1,745	211,013	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,743	210,753	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,400	1,428	172,623	2023/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	2,074	250,663	2028/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,200	1,210	146,253	2021/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,900	2,086	252,184	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,100	1,267	153,187	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	900	914	110,530	2024/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,200	2,239	270,651	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	3,233	390,773	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,544	307,557	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,708	2,952	356,863	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,028	245,204	2024/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,873	3,197	386,430	2041/07/30

区 分		当 期				未		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,761	333,711	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,726	329,501	2021/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,716	328,260	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,246	271,496	2022/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,076	371,829	2023/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,242	270,977	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,516	304,086	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,422	292,774	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,310	279,196	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,388	288,725	2024/10/31
国 小 計	銘柄数	39銘柄						
	金 額				70,321	86,239	10,422,888	
					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	1,475	178,337	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,579	190,888	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,378	408,277	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,979	239,215	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,629	1,961	237,123	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,676	202,651	2022/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,756	212,299	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,797	217,285	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,023	244,574	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,557	188,284	2022/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,583	191,351	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,410	291,366	2023/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,786	1,870	226,042	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,686	203,887	2021/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	979	118,422	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,068	2,115	255,737	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,568	189,567	2023/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,366	165,181	2021/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,034	125,006	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,700	1,866	225,599	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,641	198,346	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,376	166,378	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,250	1,282	155,008	2022/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,450	1,802	217,895	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,700	1,828	220,933	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,700	1,734	209,583	2022/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,900	1,978	239,131	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,492	180,330	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,000	2,148	259,633	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	900	919	111,126	2023/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,350	163,168	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,500	1,503	181,697	2021/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,550	1,767	213,668	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,400	1,508	182,324	2023/10/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,500	1,646	198,958	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,200	1,251	151,201	2021/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,000	1,206	145,795	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,250	1,651	199,547	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,050	1,073	129,776	2022/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,205	266,605	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,200	1,264	152,804	2024/07/01

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,000	1,075	130,044	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	700	813	98,333	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,400	1,402	169,547	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	735	88,895	2023/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	700	688	83,162	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	300	297	35,963	2027/01/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,754	3,769	455,592	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,220	510,149	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	2,055	3,055	369,334	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,546	428,582	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,631	438,844	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	2,905	351,198	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,034	3,001	362,782	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,609	315,424	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,589	312,927	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	3,017	364,750	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,532	306,138	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,248	271,779	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,470	298,554	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,235	270,162	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,900	229,643	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,710	3,126	377,872	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,139	379,397	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,162	261,340	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,613	2,380	287,667	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,562	309,691	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,823	220,370	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,525	305,236	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,341	282,992	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,661	200,789	2021/12/15
国小計	銘柄数 金 額	71銘柄		119,626	138,773	16,772,188	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	449	54,373	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	299	36,198	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	433	52,343	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	24,674	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	400	504	60,982	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	770	781	94,401	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	317	38,356	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	423	51,145	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	529	64,033	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	530	64,061	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	24,698	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	834	100,909	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	485	58,626	2021/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	488	59,004	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	312	331	40,065	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	477	57,718	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	618	74,768	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	587	70,999	2024/04/15
国小計	銘柄数 金 額	18銘柄		7,553	8,500	1,027,361	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	954	115,396	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,208	146,051	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	534	677	81,869	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	200	270	32,742	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	917	110,901	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	580	612	74,058	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	940	113,689	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	406	49,125	2022/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,000	1,078	130,333	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,200	1,269	153,468	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	300	306	37,053	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,238	149,662	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,435	173,473	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,273	2,123	256,635	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,164	140,726	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	878	106,134	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	975	117,943	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	388	850	102,773	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,031	124,632	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,044	126,265	2023/10/20
Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	1,021	123,491	2034/05/23	
Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,028	124,272	2024/10/21	
国 小 計	銘柄数	22銘柄					
	金 額			17,305	21,435	2,590,703	
通 貨 小 計	銘柄数	304銘柄					
	金 額			479,453	578,388	69,904,023	
合 計	銘柄数	765銘柄					
	金 額					187,330,033	

(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

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	187,330,033	96.4
コール・ローン等、その他	6,972,473	3.6
投資信託財産総額	194,302,507	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1シンガポール・ドル=80.21円、1イギリス・ポンド=141.59円、1デンマーク・クローネ=16.17円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローネ=11.46円、1メキシコ・ペソ=5.61円、1マレーシア・リンギット=26.24円、1南アフリカ・ランド=7.50円、1ポーランド・ズロチ=28.02円、1ユーロ=120.86円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (188,734,538千円) の投資信託財産総額 (194,302,507千円) に対する比率は、97.1%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

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
<b>(A)資産</b>	<b>198,068,481,215円</b>
コール・ローン等	2,812,084,902
公社債（評価額）	187,330,033,946
未収入金	6,597,692,675
未収利息	1,281,708,922
前払費用	46,960,770
<b>(B)負債</b>	<b>7,603,880,942</b>
未払金	7,600,474,286
未払解約金	3,405,669
その他未払費用	987
<b>(C)純資産総額（A－B）</b>	<b>190,464,600,273</b>
元本	66,118,107,712
次期繰越損益金	124,346,492,561
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>66,118,107,712口</b>
1万口当り基準価額（C／D）	<b>28,807円</b>

\*期首における元本額は61,445,933,589円、当作成期間中における追加設定元本額は8,771,520,025円、同解約元本額は4,099,345,902円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 653,486,435円、ダイワ国内重視バランスファンド30V A（一般投資家私募）22,093,366円、ダイワ国内重視バランスファンド50V A（一般投資家私募）128,330,909円、ダイワ国際分散バランスファンド30V A（一般投資家私募）41,751,987円、ダイワ国際分散バランスファンド50V A（一般投資家私募）442,528,295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）31,239,348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）413,208,724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）1,427,469,459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）787,285,961円、D－1's 外国債券インデックス2,452,065円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 314,458円、iFree 外国債券インデックス600,033,543円、iFree 8資産バランス772,093,354円、iFree 年金バランス14,937,740円、DCダイワ外国債券インデックス45,506,848,020円、ダイワ・ライフ・バランス30 786,129,849円、ダイワ・ライフ・バランス50 407,847,078円、ダイワ・ライフ・バランス70 255,622,913円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）420,775,557円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）323,134,588円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）107,264,235円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 9,559,864円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 21,464,206円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,128,858円、ダイワつみたてインデックス外国債券59,508,551円、ダイワつみたてインデックスバランス30 125,482円、ダイワつみたてインデックスバランス50 40,800円、ダイワつみたてインデックスバランス70 199,958円、ダイワ世界バランスファンド40V A 198,065,881円、ダイワ世界バランスファンド60V A 149,085,433円、ダイワ・バランスファンド35V A 4,935,026,873円、ダイワ・バランスファンド25V A（適格機関投資家専用）282,957,531円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券144,999,465円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド32,445,382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）1,312,096,170円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,710,869,559円、ダイワライフスタイル25 34,837,008円、ダイワライフスタイル50 61,720,946円、ダイワライフスタイル75 17,127,861円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は28,807円です。

## ■損益の状況

当期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

項 目	当 期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>4,146,652,356円</b>
受取利息	4,148,461,403
支払利息	△ 1,809,047
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>3,627,775,822</b>
売買益	12,242,413,117
売買損	△ 8,614,637,295
<b>(C)その他費用</b>	<b>△ 44,112,764</b>
<b>(D)当期損益金（A＋B＋C）</b>	<b>7,730,315,414</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>108,133,819,877</b>
<b>(F)解約差損益金</b>	<b>△ 7,388,774,492</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>15,871,131,762</b>
<b>(H)合計（D＋E＋F＋G）</b>	<b>124,346,492,561</b>
次期繰越損益金（H）	<b>124,346,492,561</b>

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

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

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第9期（決算日 2019年7月5日）

（作成対象期間 2018年7月6日～2019年7月5日）

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ない ます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

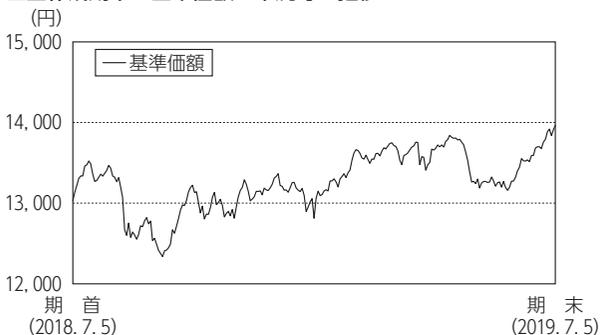
## 大和投資信託

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/>

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



【運用経過】

【基準価額・騰落率】

期首：13,029円 期末：13,964円 騰落率：7.2%

【基準価額の主な変動要因】

為替相場において、多くの新興国通貨の対円為替レートが下落したことはマイナス要因となったものの、ほぼすべての投資対象国の債券価格が上昇（金利は低下）したことや、投資している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。

◆ 投資環境について

○ 新興国債券市況

新興国債券価格は、おおむね上昇しました。

新興国債券市況は、2018年8月に、対米関係の悪化を起因としたトルコの金利が急上昇したことが新興国市場全体の投資家心理を悪化させ、多くの国で金利が上昇しました。個別国では、外国投資家による国債保有比率が高いインドネシアや米国により経済制裁が強化されたロシア、政権交代後に財政再建への期待感がはく落した南アフリカなどの金利が大きく上昇しました。10月には世界的に株価が下落し、新興国の金利は先進国に連動して低下しました。個別国では、ブラジルでボルソナロ氏が新大統領に当選し、新政権および年金改革への期待感から金利が低下しました。また、2018年末にかけて原油価格が下落したことも、新興国の経常赤字拡大懸念の後退を通して金利の低下要因となりました。2019年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）による利上げ姿勢が後退しました。米ドル高観測による新興国市場からの資金流出懸念が後退したことや、多くの新興国でインフレ率が鈍化傾向となったことも、金利低下要因となりました。6月以降は、F R B が利下げ姿勢に転じる中で世界的に金利低下が進みました。当作成期を通してみると、財政難とインフレ悪化が止まらず格付会社の S & P グローバル・レーティングから格下げされたアルゼンチンのみ、金利が上昇しました。

○ 為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で下落しました。

新興国通貨の対円為替相場は、2018年8月に、対米関係の悪化により急落したトルコ・リラをきっかけに投資家心理が悪化し、多くの新興国通貨が下落しました。2018年末にかけては、世界的に株価が下落しリスク回避的な局面となった一方で、原油価格が下落したことが新興国の経常赤字拡大懸念の後退を通して下支え要因となり、新興国通貨は横ばい圏で推移しました。2019年1月は、世界的にリスク選好的な局面となり、新興国通貨は上昇しました。しかし5月末にかけては、選挙イベントを控えた国が複数あったことや、米中貿易摩擦の激化に伴う新興国経済への悪影響も懸念され、新興国通貨は下落しました。6月以降は、F R B（米国連邦準備制度理事会）が利下げ姿勢に転じる中、緩和的な金融環境を背景に新興国通貨は上昇しました。当作成期を通してみると、対米関係の悪化と統一地方選挙が懸念されたトルコや財政難とインフレ悪化が止まらず格下げされたアルゼンチン、政権交代後に財政再建への期待感がはく落し格下げ懸念がくすぶり続けた南アフリカ、政権交代の結果投資活動の後退が懸念されたマレーシアなどを中心に、多くの通貨が対円で下落しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

年 月 日	基準 価 額		J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼンギング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) (ベンチマーク)		公社債 組 入 率 比
	円	騰落率 %	円	騰落率 %	
(期首) 2018年 7月 5日	13,029	—	13,861	—	96.8
7 月 末	13,403	2.9	14,248	2.8	96.8
8 月 末	12,536	△ 3.8	13,331	△ 3.8	96.3
9 月 末	13,138	0.8	14,019	1.1	96.2
10 月 末	12,921	△ 0.8	13,780	△ 0.6	95.6
11 月 末	13,312	2.2	14,197	2.4	94.1
12 月 末	13,057	0.2	13,895	0.3	96.0
2019年 1 月 末	13,412	2.9	14,227	2.6	96.3
2 月 末	13,708	5.2	14,613	5.4	96.0
3 月 末	13,476	3.4	14,348	3.5	95.5
4 月 末	13,534	3.9	14,453	4.3	96.9
5 月 末	13,195	1.3	14,154	2.1	96.6
6 月 末	13,791	5.8	14,711	6.1	93.5
(期末) 2019年 7月 5日	13,964	7.2	14,926	7.7	96.8

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

◆ポートフォリオについて

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

◆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7.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は7.2%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金や売買に伴う費用などが主な要因です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	20 ( 20)
(その他)	( 0)
合 計	20

(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

(2018年7月6日から2019年7月5日まで)

		買付額	売付額
外	トルコ	千トルコ・リラ 7,639	千トルコ・リラ 5,250 ( —)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 76,169	千メキシコ・ペソ 26,441 ( —)
	アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 6,669	千アルゼンチン・ペソ 6,451 ( —)
国	チリ	千チリ・ペソ 1,148,452	千チリ・ペソ — ( —)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 9,785,348	千コロンビア・ペソ 3,686,009 ( —)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 55,536,950	千インドネシア・ルピア — ( —)

		買付額	売付額
外	ブラジル	千ブラジル・レアル 28,504	千ブラジル・レアル 19,925 ( —)
	チェコ	千チェコ・コルナ 39,807	千チェコ・コルナ 7,881 ( —)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 5,210	千ルーマニア・レイ 1,483 ( —)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 229,067	千ロシア・ルーブル 32,583 ( —)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 14,024	千マレーシア・リンギット 4,536 ( —)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 52,422	千南アフリカ・ランド 8,005 ( —)
	タイ	千タイ・バーツ 110,162	千タイ・バーツ 22,390 ( —)
国	ペルー	千ペルー・ソル 6,644	千ペルー・ソル 1,614 ( —)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 16,348	千ポーランド・ズロチ 5,100 ( —)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 564,222	千ハンガリー・フォリント 106,258 ( —)
	ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 2,970	千ウルグアイ・ペソ — ( —)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2018年7月6日から2019年7月5日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	千円		千円
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	170,516	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1	409,512
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1	153,255	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/1/1	99,865
Poland Government Bond (ポーランド) 2.75% 2028/4/25	143,097	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2020/6/11	95,472
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/1/1	125,167	Colombian TES (コロンビア) 11% 2020/7/24	81,630
Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2024/4/25	103,150	Poland Government Bond (ポーランド) 1.5% 2020/4/25	64,024
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2027/1/1	88,531	Thailand Government Bond (タイ) 2.55% 2020/6/26	63,804
Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2031/5/29	81,790	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/4/1	60,982
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/7/1	81,275	Poland Government Bond (ポーランド) 2020/7/25	56,566
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.125% 2024/5/15	79,575	Mexican Bonos (メキシコ) 5% 2019/12/11	53,765
Colombian TES (コロンビア) 6% 2028/4/28	77,072	Peru Government Bond (ペルー) 7.84% 2020/8/12	53,754

(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	残存期間別組入比率		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
				千円	%	%	%	%	%
トルコ	千トルコ・リラ 29,980	千トルコ・リラ 24,815		477,938	3.6	—	1.3	2.1	0.2
メキシコ	千メキシコ・ペソ 215,750	千メキシコ・ペソ 222,721		1,265,060	9.6	—	6.7	2.0	0.9
フィリピン	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 15,165		31,998	0.2	—	—	—	0.2
アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 22,900	千アルゼンチン・ペソ 15,796		40,755	0.3	0.3	0.2	0.1	—
チリ	千チリ・ペソ 2,425,000	千チリ・ペソ 2,777,994		441,423	3.4	—	2.4	0.3	0.6
コロンビア	千コロンビア・ペソ 23,515,000	千コロンビア・ペソ 25,920,991		873,537	6.6	—	5.4	1.2	0.0
インドネシア	千インドネシア・ルピア 162,949,000	千インドネシア・ルピア 170,153,775		1,310,184	10.0	—	6.7	3.0	0.3
ブラジル	千ブラジル・レアル 45,910	千ブラジル・レアル 46,309		1,314,271	10.0	—	3.0	4.9	2.1
チェコ	千チェコ・コルナ 106,000	千チェコ・コルナ 111,477		532,862	4.0	—	2.6	1.2	0.2
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 11,940	千ルーマニア・レイ 12,167		314,040	2.4	—	0.5	1.5	0.4
ロシア	千ロシア・ルーブル 592,410	千ロシア・ルーブル 601,259		1,022,140	7.8	—	4.9	2.7	0.2
マレーシア	千マレーシア・リンギット 28,520	千マレーシア・リンギット 29,243		763,243	5.8	—	3.7	1.8	0.3
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 149,790	千南アフリカ・ランド 139,961		1,074,904	8.2	—	7.6	0.6	—
タイ	千タイ・バーツ 289,960	千タイ・バーツ 316,626		1,114,523	8.5	—	5.4	3.1	—

区 分	額 面 金 額	当 期			未 期			
		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
ペルー	千ペルー・ソル 11,900	千ペルー・ソル 13,658	千円 447,603	% 3.4	% —	% 3.4	% —	% —
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 37,550	千ポーランド・ズロチ 39,162	1,123,563	8.5	—	3.4	4.2	0.9
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 1,321,300	千ハンガリー・フォリント 1,487,362	560,438	4.3	—	1.9	1.9	0.5
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 8,100	千ウルグアイ・ペソ 7,774	23,868	0.2	—	0.1	0.1	—
合計	—	—	12,732,357	96.8	0.3	59.2	30.6	6.9

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千トルコ・リラ	千円	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	1,660	1,404	27,042	2022/01/12
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	642	12,374	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,084	40,142	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	1,390	1,080	20,805	2023/09/27
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	555	10,697	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,252	24,124	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	1,490	1,050	20,235	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,610	1,447	27,878	2021/02/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	2,059	39,664	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	9.2000	2,010	1,729	33,303	2021/09/22
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	2,098	40,418	2022/03/02
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,365	45,560	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,627	31,346	2022/08/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	1,700	1,321	25,454	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,244	23,978	2023/01/18
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	1,000	856	16,494	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	2,000	1,994	38,415	2023/06/14
通貨小計	銘柄数 金 額	17銘柄		29,980	24,815	477,938	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	10,400	9,575	54,386	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	9,500	9,860	56,005	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	9,975	56,663	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,000	10,331	58,681	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	16,250	16,716	94,947	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	18,350	20,643	117,255	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	23,230	23,510	133,540	2027/06/03

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分		当 期				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	
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,128	51,849	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	11,230	12,141	68,966	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	14,100	15,337	87,115	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	21,950	21,582	122,588	2021/06/10
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,950	23,594	134,019	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	19,450	19,045	108,180	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,820	13,970	79,354	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,130	7,307	41,506	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			215,750	222,721	1,265,060		
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	4.9500	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 15,165	31,998	2021/01/15
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			15,000	15,165	31,998		
アルゼンチン		REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	18.2000	千アルゼンチン・ペソ 4,700	千アルゼンチン・ペソ 3,217	8,299	2021/10/03
		REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	1,400	985	2,542	2023/10/17
		REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	16,800	11,594	29,912	2026/10/17
通貨小計	銘柄数	3銘柄						
	金 額			22,900	15,796	40,755		
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 425,000	千チリ・ペソ 438,961	69,750	2021/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	470,000	510,316	81,089	2026/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	500,000	590,405	93,815	2035/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	564,352	89,675	2043/01/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	320,000	361,078	57,375	2030/09/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	261,455	41,545	2023/03/01
		Chile Government International Bond	国債証券	5.5000	50,000	51,425	8,171	2020/08/05
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金 額			2,425,000	2,777,994	441,423		
コロンビア		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ 90,000	千コロンビア・ペソ 113,989	3,841	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	99,413	3,350	2021/04/14
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	44,004	1,482	2023/03/21
		Colombian TES	国債証券	7.0000	4,335,000	4,600,388	155,033	2022/05/04
		Colombian TES	国債証券	10.0000	3,450,000	4,211,208	141,917	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	3,590,000	3,663,271	123,452	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	3,310,000	3,709,583	125,012	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	3,091,311	104,177	2030/09/18
		Colombian TES	国債証券	7.0000	2,200,000	2,392,786	80,636	2032/06/30
		Colombian TES	国債証券	6.2500	2,000,000	2,103,020	70,871	2025/11/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	1,700,000	1,892,015	63,760	2034/10/18
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			23,515,000	25,920,991	873,537		

区 分		当 期				未		
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	8,706,555	67,040	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000	4,403,000	33,903	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	2,800,000	2,794,148	21,514	2032/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,198,968	55,432	2038/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,562,500	81,331	2024/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,000,000	5,318,100	40,949	2039/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	9,000,000	9,639,450	74,223	2029/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000	2,541,240	19,567	2020/11/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	1,600,000	1,777,984	13,690	2021/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	4,700,000	5,611,424	43,207	2025/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	4,180,000	5,145,872	39,623	2030/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	9,210,000	9,491,549	73,084	2021/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,435,963	26,456	2031/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000	10,931,807	84,174	2026/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,007,735	38,559	2032/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	10,238,889	78,839	2027/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	8,660,000	8,720,360	67,146	2022/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	8,910,000	8,578,369	66,053	2023/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000	8,095,524	62,335	2028/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	6,975,000	6,411,978	49,372	2033/05/15	
Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,020,000	12,886,882	99,228	2034/03/15		
Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	13,961,355	107,502	2024/03/15		
Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	7,820,000	8,694,119	66,944	2029/03/15		
通貨小計	銘柄数 金 額	23銘柄		162,949,000	170,153,775	1,310,184		
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,030	5,318	150,951	2021/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	9,910	10,955	310,920	2023/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,990	5,666	160,808	2025/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,550	6,423	182,297	2027/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,500	1,766	50,146	2029/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,030	4,490	127,451	2021/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	7,700	6,642	188,502	2022/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	4,200	3,499	99,317	2022/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	2,000	1,546	43,876	2023/07/01	
	通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		45,910	46,309	1,314,271	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	6,500	6,679	31,930	2020/09/12	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	8,200	8,636	41,282	2021/09/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	12,600	13,784	65,889	2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	10,425	49,833	2024/05/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	10,200	11,233	53,694	2022/09/12	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	17,067	81,583	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	10,900	10,545	50,407	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	10,000	9,461	45,223	2030/05/15	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	2,900	2,792	13,349	2023/10/25	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

		当 期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	8,000	7,321	34,995	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	13,529	64,672	2029/07/23
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		106,000	111,477	532,862	
				千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,523	39,318	2023/04/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.9500	940	980	25,298	2021/06/11
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,177	30,389	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,130	1,125	29,048	2021/03/22
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	1,200	1,310	33,835	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,075	27,762	2022/12/19
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	800	771	19,911	2024/04/29
	Romania Government Bond	国債証券	3.4000	1,700	1,683	43,444	2022/03/08
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,513	39,063	2023/06/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.0000	1,000	1,006	25,968	2021/10/27
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		11,940	12,167	314,040	
				千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	14,880	15,025	25,543	2021/04/14
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	41,760	44,119	75,003	2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	21,910	22,227	37,786	2022/07/20
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,357	24,407	2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	36,160	35,825	60,903	2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,300	24,212	41,161	2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	29,300	29,580	50,287	2021/08/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	24,000	26,274	44,665	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	56,100	57,938	98,495	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	39,000	39,526	67,195	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	47,000	48,484	82,424	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	35,600	35,606	60,530	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	49,000	48,928	83,179	2021/12/15
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	31,000	30,301	51,513	2024/02/28
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	25,000	24,782	42,130	2034/05/10
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	39,000	38,131	64,824	2029/05/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	36,000	37,620	63,954	2026/10/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	28,000	28,315	48,135	2024/07/17
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		592,410	601,259	1,022,140	
				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	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	2,000	2,032	53,045	2022/04/14
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,200	1,251	32,668	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,051	53,537	2023/11/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,000	1,056	27,564	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,500	1,562	40,779	2029/07/09
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,350	1,373	35,851	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,500	2,519	65,757	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,799	46,965	2024/07/15

		当 期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,350	1,382	36,095	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	1,740	1,749	45,673	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	900	913	23,852	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,300	1,328	34,669	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,210	31,586	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,420	1,461	38,141	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,120	2,165	56,524	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,100	1,204	31,429	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,418	37,027	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,046	53,411	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	700	714	18,660	2029/08/15
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金 額			28,520	29,243	763,243	
南アフリカ				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	22,050	24,956	191,663	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	10,220	7,561	58,072	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	9,880	7,119	54,677	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	9,640	8,290	63,670	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	9,880	10,030	77,031	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	21,020	19,201	147,469	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	14,500	13,318	102,286	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	12,100	11,465	88,056	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	13,100	12,020	92,319	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	10,300	9,645	74,073	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	10,100	9,696	74,472	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	7,000	6,654	51,110	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			149,790	139,961	1,074,904	
タイ				千タイ・バーツ	千タイ・バーツ		
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	23,050	28,806	101,399	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	19,300	20,674	72,775	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	20,610	23,152	81,495	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	30,600	32,022	112,718	2021/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	22,700	26,329	92,679	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	21,200	21,299	74,973	2022/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	21,100	24,442	86,036	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	23,400	23,809	83,807	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	26,000	26,239	92,361	2022/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	25,000	29,514	103,890	2032/06/25
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	21,000	21,584	75,976	2046/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	14,000	14,382	50,625	2023/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	13,000	14,015	49,333	2028/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	9,000	10,354	36,448	2038/06/17
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			289,960	316,626	1,114,523	
ペルー				千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	1,130	1,232	40,373	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,970	2,230	73,101	2028/08/12

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分		当 期			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		
			%	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル	千円		
		Peru Government Bond	国債証券	6.1500	1,850	2,048	67,137	2032/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.9400	1,900	2,087	68,394	2029/02/12
		Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,950	63,911	2026/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9000	1,565	1,844	60,455	2037/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,920	2,265	74,229	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金 額				11,900	13,658	447,603	
					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	2,210	2,488	71,398	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,640	3,722	106,809	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,260	2,281	65,461	2021/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.7500	2,230	2,242	64,330	2021/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,890	2,953	84,725	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,257	93,453	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,078	88,307	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,500	3,604	103,406	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	500	521	14,974	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.2500	1,720	1,806	51,819	2020/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,820	1,992	57,168	2021/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,530	2,758	79,148	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,700	5,940	170,442	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,350	2,513	72,117	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額				37,550	39,162	1,123,563	
					千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
ハンガリー		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	106,926	40,289	2024/06/26
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	184,815	69,638	2027/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	89,000	93,122	35,088	2021/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	144,593	54,482	2022/10/26
		Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	85,000	90,762	34,199	2026/12/22
		Hungary Government Bond	国債証券	0.5000	60,000	60,197	22,682	2021/04/21
		Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	70,000	97,699	36,812	2028/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	110,000	116,488	43,893	2024/10/24
		Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	99,500	109,614	41,302	2020/11/12
		Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	159,833	60,225	2023/11/24
		Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	148,112	55,808	2022/06/24
		Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	175,196	66,014	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額				1,321,300	1,487,362	560,438	
					千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		
ウルグアイ		Uruguay Government International Bond	国債証券	9.8750	5,300	5,300	16,273	2022/06/20
		Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,473	7,594	2028/03/15
通貨小計	銘柄数	2銘柄						
	金 額				8,100	7,774	23,868	
合 計	銘柄数	205銘柄						
	金 額						12,732,357	

(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

2019年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	12,732,357 千円	96.2 %
コール・ローン等、その他	499,427	3.8
投資信託財産総額	13,231,784	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.91円、1トルコ・リラ=19.26円、1メキシコ・ペソ=5.68円、1フィリピン・ペソ=2.11円、1アルゼンチン・ペソ=2.58円、100チリ・ペソ=15.89円、100コロンビア・ペソ=3.37円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・レアル=28.38円、1チェコ・コルナ=4.78円、1ルーマニア・レイ=25.81円、1ロシア・ルーブル=1.70円、1マレーシア・リンギット=26.10円、1南アフリカ・ランド=7.68円、1タイ・バツ=3.52円、1ペルー・ソル=32.77円、1ポーランド・ズロチ=28.69円、100ハンガリー・フォリント=37.68円、1ウルグアイ・ペソ=3.07円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(13,036,626千円)の投資信託財産総額(13,231,784千円)に対する比率は、98.5%です。

■損益の状況

当期 自 2018年7月6日 至 2019年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	658,483,885円
受取利息	658,559,097
支払利息	△ 75,212
(B) 有価証券売買損益	187,224,871
売買益	659,351,073
売買損	△ 472,126,202
(C) その他費用	△ 16,268,956
(D) 当期損益金 (A + B + C)	829,439,800
(E) 前期繰越損益金	2,139,061,421
(F) 解約差損益金	△ 149,726,616
(G) 追加信託差損益金	917,215,632
(H) 合計 (D + E + F + G)	3,735,990,237
次期繰越損益金 (H)	3,735,990,237

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	13,354,726,633円
コール・ローン等	304,731,164
公社債 (評価額)	12,732,357,205
未収入金	123,772,800
未収利息	174,925,380
前払費用	18,940,084
(B) 負債	194,935,749
未払金	185,719,445
未払解約金	9,205,504
その他未払費用	10,800
(C) 純資産総額 (A - B)	13,159,790,884
元本	9,423,800,647
次期繰越損益金	3,735,990,237
(D) 受益権総口数	9,423,800,647口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,964円

\* 期首における元本額は7,061,638,177円、当作成期間中における追加設定元本額は2,809,346,655円、同解約元本額は447,184,185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、新興国債券インデックスファンド (FOfs 用) (適格機関投資家専用) 10,901,188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) 197,680,907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) 397,273,648円、D-1's 新興国債券インデックス58,210,820円、i F r e e 新興国債券インデックス2,174,989,386円、i F r e e 8資産バランス1,280,749,979円、DCダイワ新興国債券インデックスファンド5,093,189,137円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券178,990,558円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド31,815,024円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,964円です。

# ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

## 運用報告書（全体版） 第3期

（決算日 2019年12月2日）

（作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2日）

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率			
1 期末 (2017年11月30日)	円 9,372	円 0	% △ 6.3	3,189.89	% △ 6.1	% 98.0	% 1.6	百万円 564
2 期末 (2018年11月30日)	10,585	0	12.9	3,610.49	13.2	98.2	1.5	1,027
3 期末 (2019年12月 2 日)	13,333	0	26.0	4,562.74	26.4	98.1	1.8	1,183

(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。

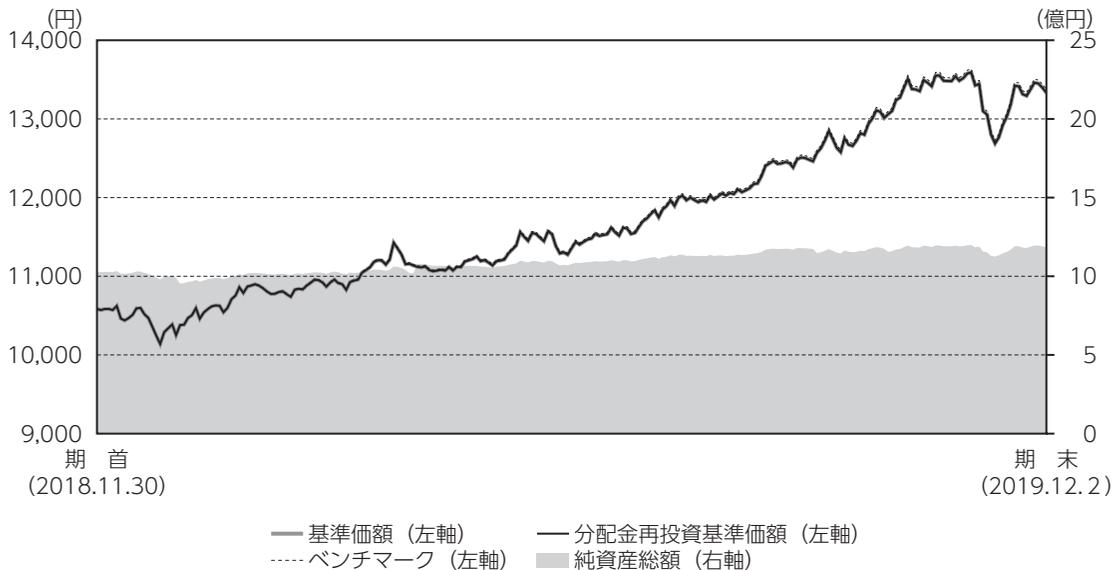
(注3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：10,585円

期末：13,333円（分配金0円）

騰落率：26.0%（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、日米の長期金利が低下したことなどを背景に、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券 組入比率	不動産投信指数 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2018年11月30日	円 10,585	% -	3,610.49	% -	% 98.2	% 1.5
12月末	10,388	△ 1.9	3,543.83	△ 1.8	98.3	1.4
2019年 1 月末	10,868	2.7	3,709.11	2.7	97.9	1.4
2 月末	10,921	3.2	3,728.00	3.3	97.7	1.5
3 月末	11,277	6.5	3,851.10	6.7	98.1	1.5
4 月末	11,192	5.7	3,822.76	5.9	98.3	1.4
5 月末	11,384	7.5	3,889.57	7.7	98.5	1.4
6 月末	11,552	9.1	3,947.76	9.3	98.6	1.3
7 月末	12,053	13.9	4,120.33	14.1	98.6	1.3
8 月末	12,504	18.1	4,275.94	18.4	98.7	1.3
9 月末	13,090	23.7	4,477.77	24.0	98.0	1.9
10月末	13,520	27.7	4,625.77	28.1	98.1	1.8
11月末	13,396	26.6	4,584.30	27.0	98.1	1.8
(期末) 2019年12月 2 日	13,333	26.0	4,562.74	26.4	98.1	1.8

(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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■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、米国の金融政策姿勢が緩和的になったことなどにより日米の長期金利が低下したことやリート各社の好調な決算などを背景に、上昇しました。その後も、各国の長期金利が低水準で推移したことにより国内リート市場の相対的に高い配当利回りに注目が集まり、上昇しました。2019年11月上旬には、日米通商問題への懸念が弱まったことを背景に株式市場のリスク選好が強まり長期金利が急上昇したことから、下落に転じました。しかしその後、長期金利の上昇が落ち着くと再び上昇し、当作成期末を迎えました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■当ファンド

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

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

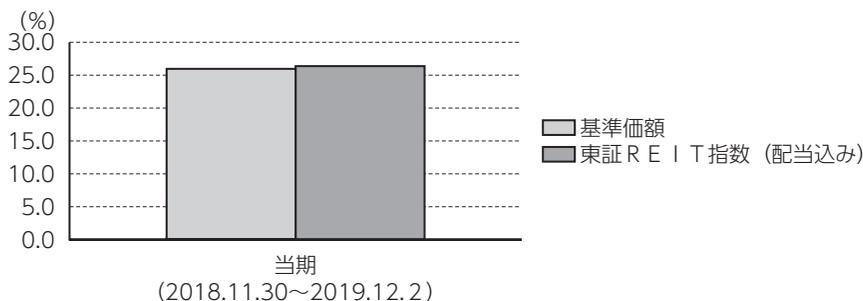
ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度としました。

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は26.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は26.0%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

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

### 分配原資の内訳 (1万口当り)

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ~2019年12月2日	
当期分配金 (税込み) (円)	—	
対基準価額比率 (%)	—	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	3,425	

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2018.12.1~2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	27円	0.229%	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11,739円です。
(投 信 会 社)	(18)	(0.152)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(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	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	28	0.235	

(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。

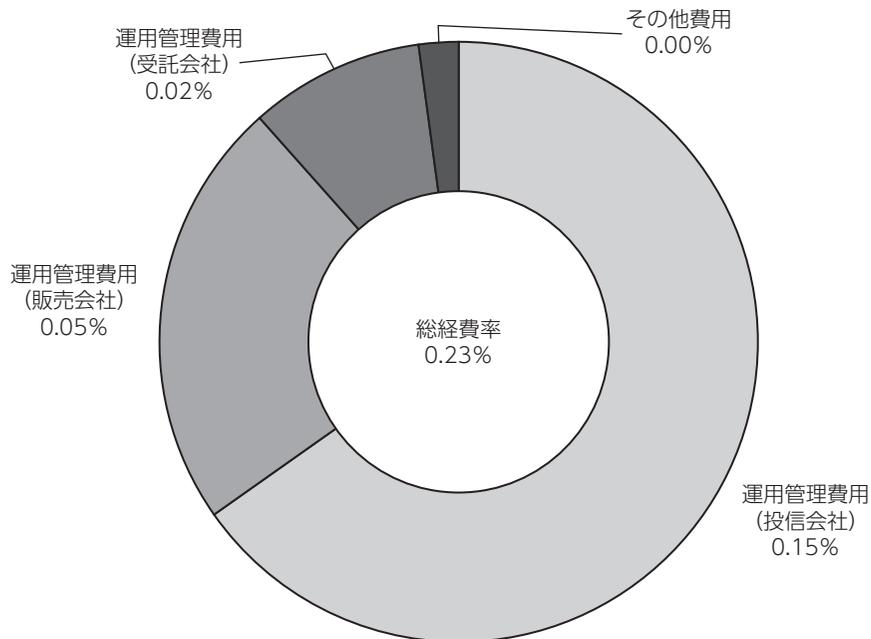
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.23%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2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	55,388	159,474	88,363	258,154

(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12月1日から2019年12月2日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区 分	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	うち利害 関係人との 取引状況 D	D/C		
投資信託証券	百万円 108,794	6.0	百万円 15,289	2.0		
不動産投信指数 先物取引	21,407	-	18,883	-		
コール・ローン	832,888	-	-	-		

(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12月1日から2019年12月2日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ-REITマザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
投資信託証券	百万円 1,944	百万円 280	百万円 7,004

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

種 類	当 期
	ダイワJ-REITマザーファンド 買 付 額
投資信託証券	百万円 3,255

(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12月1日から2019年12月2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)	1.7%

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

\*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券オフィス投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人です。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ダイワJ-REITマザーファンド	千口 382,670	千口 349,695	千円 1,183,301

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワJ-REITマザーファンド	千円 1,183,301	% 99.7
コール・ローン等、その他	3,688	0.3
投資信託財産総額	1,186,989	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12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,186,989,659円
コール・ローン等	2,438,639
ダイワJ-REITマザーファンド(評価額)	1,183,301,020
未収入金	1,250,000
(B) 負債	3,089,278
未払解約金	1,727,469
未払信託報酬	1,329,842
その他未払費用	31,967
(C) 純資産総額(A - B)	1,183,900,381
元本	887,949,644
次期繰越損益金	295,950,737
(D) 受益権総口数	887,949,644口
1万口当り基準価額(C/D)	13,333円

\*期首における元本額は970,641,025円、当作成期間中における追加設定元本額は281,360,657円、同解約元本額は364,052,038円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は13,333円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,870円
受取利息	424
支払利息	△ 2,294
(B) 有価証券売買損益	224,575,011
売買益	258,902,518
売買損	△ 34,327,507
(C) 信託報酬等	△ 2,556,191
(D) 当期損益金(A + B + C)	222,016,950
(E) 前期繰越損益金	60,725,171
(F) 追加信託差損益金	13,208,616
(配当等相当額)	( 21,398,266)
(売買損益相当額)	(△ 8,189,650)
(G) 合計(D + E + F)	295,950,737
次期繰越損益金(G)	295,950,737
追加信託差損益金	13,208,616
(配当等相当額)	( 21,398,266)
(売買損益相当額)	(△ 8,189,650)
分配準備積立金	282,743,991
繰越損益金	△ 1,870

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	222,017,335
(c) 収益調整金	21,398,266
(d) 分配準備積立金	60,726,656
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	304,142,257
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	304,142,257
(h) 受益権総口数	887,949,644口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2019年9月17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12月2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12月1日から2019年12月2日まで)

買				売					
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
日本ビルファンド		9.183	7,050,947	767,826	日本ビルファンド		1.348	1,046,373	776,241
ジャパンリアルエステイト		9.481	6,445,438	679,826	ジャパンリアルエステイト		1.391	958,527	689,092
野村不動産マスターF		33.174	5,752,578	173,406	アドバンス・レジデンス		2.602	880,416	338,361
ユナイテッド・アーバン投資法人		22.272	4,249,572	190,803	野村不動産マスターF		4.078	749,772	183,857
日本プロロジスリート		15.981	4,182,419	261,712	A P I 投資法人		1.33	682,367	513,058
大和ハウスリート投資法人		14.981	4,039,683	269,653	ユナイテッド・アーバン投資法人		3.111	622,907	200,227
日本リテールファンド		17.92	4,035,619	225,201	オリックス不動産投資		2.772	608,771	219,614
オリックス不動産投資		18.892	3,987,957	211,092	日本リテールファンド		2.63	602,008	228,900
インヴェンシブル投資法人		63.94	3,896,089	60,933	日本プロロジスリート		1.972	546,284	277,020
ジャパン・ホテル・リート投資法人		38.416	3,251,185	84,631	大和ハウスリート投資法人		1.67	481,877	288,549

(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12月2日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（111,967,387千口）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12月2日現在		
	口数	評価額	比率
<b>不動産投信</b>	千口	千円	%
エスコンジャパンリート	3.396	430,612	0.1
サンケイリアルエステート	4.795	596,018	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	10.994	7,497,908	2.0
MCUBS MidCity投資法人	42.447	4,991,767	1.3
森ビルズリート	38.066	6,722,455	1.8
産業ファンド	40.708	6,773,811	1.8
アドバンス・レジデンス	31.381	11,061,802	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	20.591	4,392,060	1.2
A P I 投資法人	16.579	9,433,451	2.5
G L P 投資法人	82.406	11,981,832	3.2
コンフォリア・レジデンシャル	13.776	4,759,608	1.3
日本プロロジスリート	47.537	13,866,542	3.7
星野リゾート・リート	5.034	2,884,482	0.8
Oneリート投資法人	5.157	1,789,479	0.5
イオンリート投資	35.706	5,380,894	1.4

ファンド名	2019年12月2日現在		
	口数	評価額	比率
	千口	千円	%
ヒューリックリート投資法	28.138	5,683,876	1.5
日本リート投資法人	10.747	5,163,933	1.4
インバスコ・オフィス・Jリート	212.562	4,495,686	1.2
日本ヘルスケア投資法	1.604	349,511	0.1
積水ハウス・リート投資	96.741	9,345,180	2.5
トーセイ・リート投資法人	7.202	960,746	0.3
ケネディクス商業リート	12.779	3,590,899	0.9
ヘルスケア&メディカル投資	7.057	939,286	0.2
サムティ・レジデンシャル	6.623	772,904	0.2
野村不動産マスターF	103.183	20,574,690	5.4
いちごホテルリート投資	5.481	741,031	0.2
ラサールロジポート投資	30.762	5,118,796	1.4
スターアジア不動産投	10.98	1,267,092	0.3
マリモ地方創生リート	2.845	380,661	0.1
三井不ロジパーク	8.147	3,951,295	1.0

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

ファンド名	2019年12月2日現在		
	口数	評価額	比率
	千口	千円	%
大江戸温泉リート	5.621	533,432	0.1
さくら総合リート	7.158	682,157	0.2
投資法人みらい	35.889	2,178,462	0.6
森トラスト・ホテルリート投	7.763	1,147,371	0.3
三菱地所物流ＲＥＩＴ	6.513	2,286,063	0.6
ＣＲＥロジスティクスファンド	4.644	646,444	0.2
ザイマックス・リート	4.802	657,393	0.2
タカラレーベン不動産投	9.39	1,130,556	0.3
伊藤忠アドバンスロジ	5.118	601,365	0.2
日本ビルファンド	32.04	26,304,840	6.9
ジャパンリアルエステイト	33.086	24,582,898	6.5
日本リテールファンド	62.532	15,520,442	4.1
オリックス不動産投資	65.924	15,881,091	4.2
日本プライムリアルティ	20.944	10,346,336	2.7
プレミア投資法人	29.884	4,853,161	1.3
東急リアル・エステート	22.183	4,642,901	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人	22.975	3,331,375	0.9
ユナイテッド・アーバン投資法人	74.289	15,816,128	4.2
森トラスト総合リート	23.646	4,672,449	1.2
インヴィンシブル投資法人	145.13	9,346,372	2.5
フロンティア不動産投資	11.752	5,541,068	1.5
平和不動産リート	20.604	2,857,774	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	21.618	6,018,451	1.6
福岡リート投資法人	17.111	3,177,512	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	10.235	8,351,760	2.2
いちごオフィスリート投資法人	25.619	2,935,937	0.8
大和証券オフィス投資法人	7.637	6,231,792	1.6
阪急阪神リート投資法人	14.945	2,546,628	0.7
スタートアップロシード投資法人	5.152	1,040,188	0.3
大和ハウスリート投資法人	44.606	13,221,218	3.5
ジャパン・ホテル・リート投資法人	106.585	9,528,699	2.5
日本賃貸住宅投資法人	37.215	4,004,334	1.1
ジャパンエクセレント投資法人	29.628	5,469,328	1.4
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	1,915,662 371,984,252 63銘柄	<98.2%>

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別		2019年12月2日現在	
		買建額	売建額
国内	東証ＲＥＩＴ	百万円 6,871	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

## 運用報告書 第31期（決算日 2019年9月17日）

（作成対象期間 2019年3月16日～2019年9月17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。

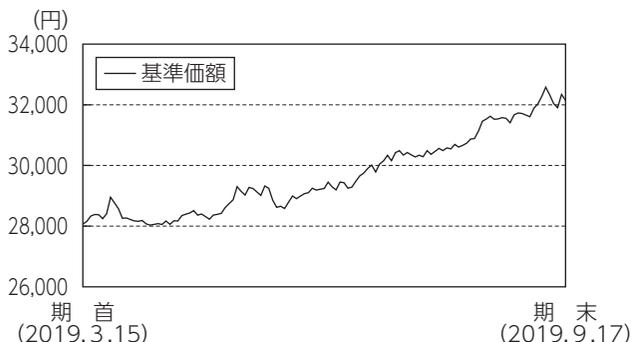
運用方針	東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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	不動産投信
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率	証券	先物
		%		%	組入比率	比率
(期首)2019年3月15日	28,065	-	3,782.23	-	98.4	1.5
3月末	28,572	1.8	3,851.10	1.8	98.3	1.5
4月末	28,363	1.1	3,822.76	1.1	98.5	1.4
5月末	28,855	2.8	3,889.57	2.8	98.6	1.4
6月末	29,286	4.4	3,947.76	4.4	98.6	1.3
7月末	30,564	8.9	4,120.33	8.9	98.6	1.3
8月末	31,714	13.0	4,275.94	13.1	98.7	1.3
(期末)2019年9月17日	32,146	14.5	4,334.17	14.6	97.8	1.9

(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：28,065円 期末：32,146円 騰落率：14.5%

【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、米国の金融政策姿勢が緩和的になったことなどから日米長期金利が低下したことやリート各社の好調な決算などを背景に上昇しました。その後も、各国の長期金利が低水準で推移したことにより、国内リート市場の相対的に高い配当利回りに注目が集まり、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%程度となりました。

◆ 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14.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は14.5%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

(2019年3月16日から2019年9月17日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内	383.453	56,776,123	21.552 ( - )	4,378,125 ( - )

(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

(2019年3月16日から2019年9月17日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	10,374	8,131	-	-

(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

(2019年3月16日から2019年9月17日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	□ 数	金 額	平均単価	銘	柄	□ 数	金 額	平均単価
		千□	千円	円			千□	千円	円
日本ビルファンド		4.891	3,691,518	754,757	アドバンス・レジデンス		1.604	542,800	338,404
ジャパンリアルエステイト		5.049	3,361,131	665,702	A P I 投資法人		0.806	403,071	500,088
インヴィンシブル投資法人		46.08	2,801,309	60,792	日本ビルファンド		0.334	259,403	776,656
野村不動産マスターF		15.726	2,664,749	169,448	ジャパンリアルエステイト		0.344	240,637	699,528
日本プロロジスリート		9.752	2,451,022	251,335	プレミアム投資法人		1.565	230,508	147,289
ユナイテッド・アーバン投資法人		12.382	2,277,365	183,925	いちごオフィスリート投資法人		1.776	183,330	103,226
日本リテールファンド		9.545	2,084,532	218,390	野村不動産マスターF		0.858	160,665	187,255
オリックス不動産投資		10.062	2,048,221	203,560	オリックス不動産投資		0.687	152,092	221,386
積水ハウス・リート投資		23.764	1,937,901	81,547	ユナイテッド・アーバン投資法人		0.775	150,764	194,534
大和ハウスリート投資法人		6.801	1,779,164	261,603	日本リテールファンド		0.651	140,984	216,565

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
不動産投信	千口	千円	%
エスコンジャパンリート	3.169	370,139	0.1
サンケイリアルエステート	4.474	537,327	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	10.259	6,791,458	2.0
MCUBS MidCity投資法人	36.622	4,193,219	1.2
森ヒルズリート	35.52	5,949,600	1.8
産業ファンド	37.985	5,804,108	1.7
アドバンス・レジデンス	28.584	9,890,064	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	19.214	3,906,206	1.2
API投資法人	15.47	8,183,630	2.4
GLP投資法人	76.895	10,380,825	3.1
コンフォリア・レジデンシャル	12.855	4,428,547	1.3
日本プロロジスリート	44.357	12,588,516	3.7
星野リゾート・リート	4.698	2,673,162	0.8
Oneリート投資法人	4.812	1,448,412	0.4
イオンリート投資	33.32	4,548,180	1.3
ヒューリックリート投資法	25.094	4,787,935	1.4
日本リート投資法人	10.028	4,417,334	1.3
インバスコ・オフィス・Jリート	198.345	4,032,353	1.2
日本ヘルスケア投資法	1.497	282,034	0.1
積水ハウス・リート投資	90.27	8,160,408	2.4
トーセイ・リート投資法人	5.677	724,385	0.2
ケネディクス商業リート	11.316	3,199,033	0.9
ヘルスケア&メディカル投資	6.585	883,048	0.3
サムティ・レジデンシャル	6.18	731,094	0.2
野村不動産マスターF	96.282	18,601,682	5.5
いちごホテルリート投資	5.115	641,932	0.2
ラサールロジポート投資	25.62	3,945,480	1.2
スターアジア不動産投	10.246	1,170,093	0.3
マリモ地方創生リート	2.655	323,113	0.1
三井不ロジパーク	7.602	3,287,865	1.0
大江戸温泉リート	5.245	471,001	0.1
さくら総合リート	6.68	631,928	0.2
投資法人みらい	33.489	1,982,548	0.6
森トラスト・ホテルリート投	7.244	1,010,538	0.3
三菱地所物流REIT	4.931	1,533,541	0.5
CREロジスティクスファンド	4.334	555,185	0.2
ザイマックス・リート	4.481	585,218	0.2
タカラレーベン不動産投	8.762	997,991	0.3
伊藤忠アドバンスロジ	4.776	517,240	0.2
日本ビルファンド	29.897	23,738,218	7.0
ジャパンリアルエステイト	30.873	22,135,941	6.6
日本リテールファンド	58.35	12,626,940	3.7
オリックス不動産投資	61.514	14,037,494	4.2

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
日本プライムリアルティ	19.543	9,664,013	2.9
プレミアム投資法人	27.885	4,330,540	1.3
東急リアル・エステート	20.699	4,230,875	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	21.438	3,207,124	1.0
ユナイテッド・アーバン投資法人	69.32	13,981,844	4.1
森トラスト総合リート	22.065	4,337,979	1.3
インヴァンシブル投資法人	135.423	8,545,191	2.5
フロンティア不動産投資	10.966	4,945,666	1.5
平和不動産リート	19.226	2,583,974	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	20.172	5,406,096	1.6
福岡リート投資法人	15.967	2,870,866	0.9
ケネディクス・オフィス投資法人	9.551	7,793,616	2.3
いちごオフィスリート投資法人	23.906	2,500,567	0.7
大和証券オフィス投資法人	7.126	5,829,068	1.7
阪急阪神リート投資法人	13.945	2,213,071	0.7
スターツプロシード投資法人	4.808	949,099	0.3
大和ハウスリート投資法人	41.622	12,178,597	3.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人	99.456	8,145,446	2.4
日本賃貸住宅投資法人	34.726	3,444,819	1.0
ジャパンエクセレント投資法人	27.646	4,774,464	1.4
合 計	□ 数、金額	1,776,812	329,637,896
	銘柄数<比率>	63銘柄	<97.8%>

※エスコンジャパンリート、サンケイリアルエステート、産業ファンド、アドバンス・レジデンス、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト、API投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、日本プロロジスリート、Oneリート投資法人、イオンリート投資法人、日本ヘルスケア投資法人、積水ハウス・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、CREロジスティクスファンド、オリックス不動産投資、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、フロンティア不動産投資、平和不動産リート、ケネディクス・オフィス投資法人、大和証券オフィス投資法人、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	百万円	百万円
東証REIT	6,524	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年9月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	329,637,896	97.5
コール・ローン等、その他	8,521,698	2.5
投資信託財産総額	338,159,595	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9月17日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>338,534,311,099円</b>
コール・ローン等	4,171,596,398
投資信託証券(評価額)	329,637,896,450
未収入金	996,626,276
未収配当金	3,335,471,175
差入委託証拠金	392,720,800
<b>(B) 負債</b>	<b>1,386,372,198</b>
未払金	743,729,991
未払解約金	256,867,000
差入委託証拠金代用有価証券	385,775,000
その他未払費用	207
<b>(C) 純資産総額(A－B)</b>	<b>337,147,938,901</b>
元本	104,880,003,327
次期繰越損益金	232,267,935,574
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>104,880,003,327口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	32,146円

\* 期首における元本額は87,996,565,708円、当作成期間中における追加設定元本額は18,459,021,162円、同解約元本額は1,575,583,543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6,381,574,883円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン(毎月分配型)88,864,840,940円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン(年1回決算型)319,766,000円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 145,142円、i F r e e J - R E I Tインデックス109,527,418円、i F r e e 8資産バランス611,651,366円、DC・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン4,894,692,227円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 2,194,046円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 4,628,999円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,397,452円、ダイワ・ノーロード J - R E I Tファンド63,669,199円、ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス1,228,326,303円、ダイワ J - R E I Tインデックス(ダイワSMA専用)802,807,199円、ダイワファンドラップオンライン J - R E I Tインデックス359,752,631円、ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T1,235,029,522円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は32,146円です。

■損益の状況

当期 自2019年3月16日 至2019年9月17日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>5,385,992,056円</b>
受取配当金	5,386,969,870
その他収益金	145,645
支払利息	△ 1,123,459
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>34,197,888,824</b>
売買益	35,169,322,506
売買損	△ 971,433,682
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>555,595,320</b>
取引益	612,811,320
取引損	△ 57,216,000
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 31,165</b>
<b>(E) 当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>40,139,445,035</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>158,962,073,258</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 3,091,834,557</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>36,258,251,838</b>
<b>(I) 合計(E + F + G + H)</b>	<b>232,267,935,574</b>
次期繰越損益金(I)	232,267,935,574

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

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

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

## 運用報告書 (全体版) 第3期

(決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日~2019年12月2日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 組入比率	証券 比率	不動産 先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込み	期中 騰落 率	(参考指数)	期中 騰落 率				
1 期末(2017年11月30日)	円 10,301	円 0	% 3.0	10,550	% 5.5	% 0.3	% 97.6	% 0.5	百万円 451
2 期末(2018年11月30日)	10,317	0	0.2	10,866	3.0	0.8	98.9	1.0	767
3 期末(2019年12月 2 日)	11,735	0	13.7	12,751	17.3	2.1	96.5	2.9	839

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

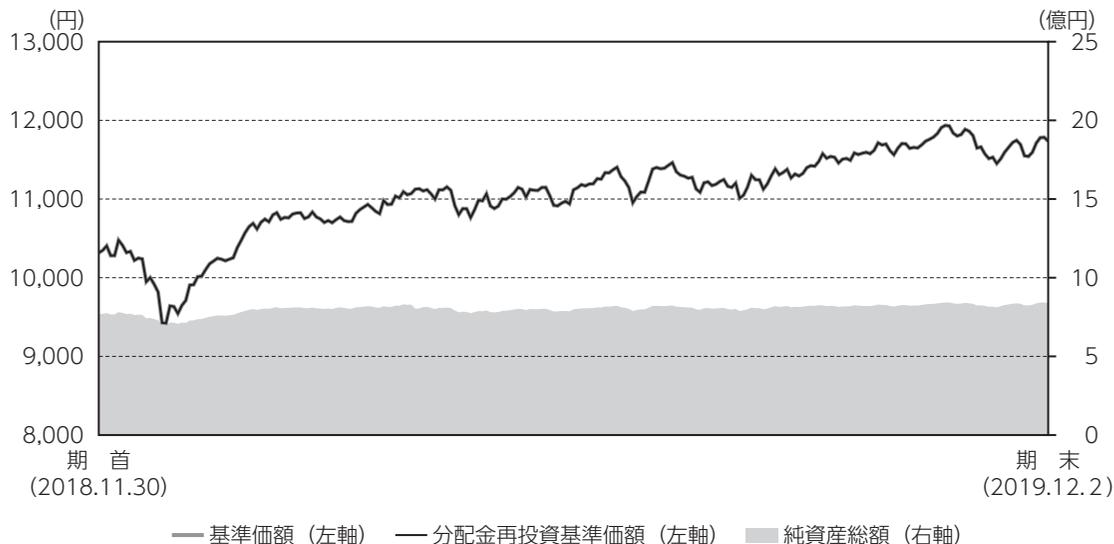
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### ■基準価額・騰落率

期首：10,317円

期末：11,735円（分配金0円）

騰落率：13.7%（分配金込み）

#### ■基準価額の主な変動要因

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

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

年 月 日	基準価額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース) (参考指数)		株式 組入比率	投資信託 受益組入比率	投資信託 証券組入比率	不動産 投信比率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率				
(期首) 2018年11月30日	10,317	% -	10,866	% -	% -	% 0.8	% 98.9	% 1.0
12月末	9,633	△ 6.6	10,158	△ 6.5	-	0.8	95.6	0.6
2019年 1 月末	10,649	3.2	11,269	3.7	-	0.7	98.1	0.8
2 月末	10,702	3.7	11,351	4.5	-	1.1	99.7	0.8
3 月末	11,093	7.5	11,795	8.5	-	0.4	97.8	1.0
4 月末	10,977	6.4	11,699	7.7	-	0.5	98.9	1.0
5 月末	10,913	5.8	11,666	7.4	-	0.7	96.6	1.0
6 月末	11,031	6.9	11,831	8.9	-	0.9	97.6	1.2
7 月末	11,247	9.0	12,103	11.4	-	1.2	97.4	1.3
8 月末	11,399	10.5	12,298	13.2	-	2.6	93.4	1.5
9 月末	11,687	13.3	12,643	16.3	-	0.7	99.4	1.8
10月末	11,886	15.2	12,890	18.6	0.0	0.9	96.8	3.6
11月末	11,784	14.2	12,803	17.8	-	2.1	96.2	2.9
(期末) 2019年12月 2 日	11,735	13.7	12,751	17.3	-	2.1	96.5	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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

米国リート市況は、当作成期首から、米中貿易摩擦問題に加えてF R B (米国連邦準備制度理事会)の利上げ継続姿勢に対する投資家懸念の高まりなどにより株価が急落し、リスク回避の動きが強まったため、下落しました。2019年に入ると、米中貿易摩擦の緩和期待や年内の利上げ停止が示唆され長期金利が低下したこと、また米中貿易交渉の進展期待などから、米国リート市況は上昇に転じました。4月以降しばらくは、米中貿易摩擦が悪材料となったものの好調な決算発表などもあり一進一退の展開となりましたが、その後はF R Bによる利下げ観測や好調な住宅市場などが支援材料となり、米国リート市場は堅調に推移しました。当作成期末にかけては、長期金利の上昇や米国議会において香港人権法案が可決された影響などを嫌気して、軟調に推移しました。

欧州リート市況は、当作成期首より、イタリアや英国等の政治的不安定さが嫌気され、総じて下落しました。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、フランスや英国を中心に欧州リート市況は上昇しました。しかし2月以降は、英国のEU (欧州連合) 離脱交渉への不透明感に加えて、ユーロ圏の経済見通しの引き下げなどから、上値が重い展開となりました。その中で、好調なオフィス市況などからドイツは上昇しました。その後は、ECB (欧州中央銀行) による金融緩和政策やEU離脱に対する懸念が緩和されたことを受け、英国やフランスを中心に欧州リート市況は上昇しました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港は大型商業施設リートの業績への期待継続や中国の景気刺激策で買われましたが、2019年7月以降は反政府デモの影響から売られました。シンガポールは、中国の景気刺激策への期待から堅調に推移しました。オーストラリアは、好調な業績見通しを反映した商業施設リートや低金利の長期化見通しが好感され、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

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

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■当ファンド

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

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

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

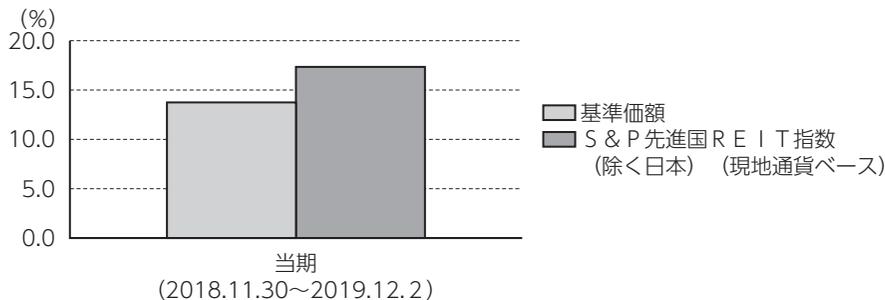
また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。

マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。また、為替ヘッジを行う時に、通貨間の金利差等による損益（為替ヘッジコスト）が発生します。



## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ～2019年12月2日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,734

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.12.1~2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	36円	0.321%	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11,056円です。
(投 信 会 社)	(27)	(0.245)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	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)	
(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	0.010	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(1)	(0.009)	
そ の 他 費 用	5	0.048	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)	(0.052)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(△1)	(△0.009)	合併にかかる税金支払いの戻し、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	43	0.391	

(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。

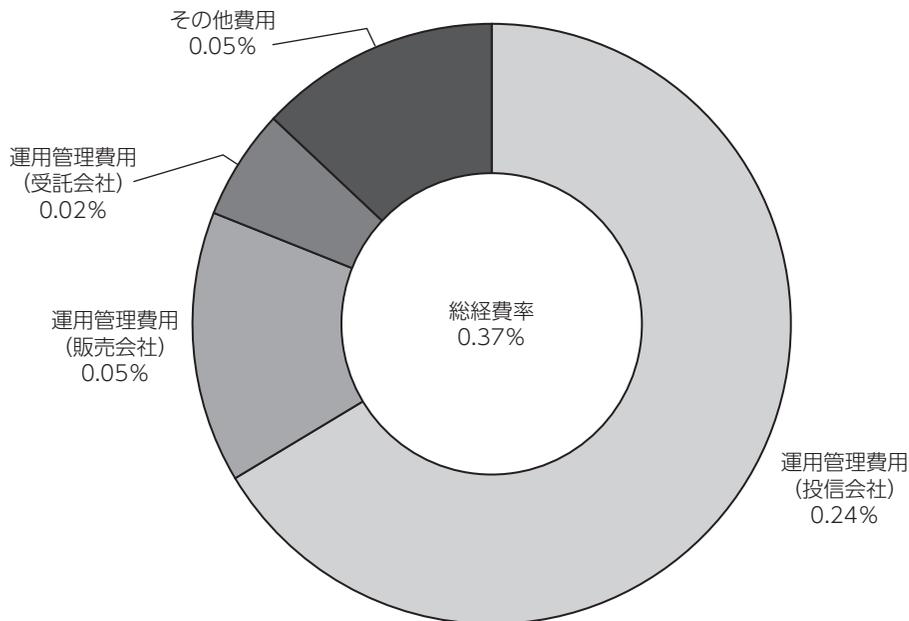
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.37%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	59,742	139,340	66,069	159,420

(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12月1日から2019年12月2日まで)

項 目	当 期
	ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	90千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	89千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.00

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 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	335,779	329,451	851,368

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2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	851,368	99.8
コール・ローン等、その他	2,006	0.2
投資信託財産総額	853,375	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1香港ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=80.21円、1ニュージーランド・ドル=70.63円、1イギリス・ポンド=141.59円、1イスラエル・シケル=31.56円、100韓国ウォン=9.32円、1ユーロ=120.86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(26,571,729千円)の投資信託財産総額(27,320,601千円)に対する比率は、97.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,708,871,086円
コール・ローン等	1,912,793
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)	851,368,742
未収入金	855,589,551
(B) 負債	869,360,103
未払金	867,652,489
未払解約金	350,736
未払信託報酬	1,328,233
その他未払費用	28,645
(C) 純資産総額(A - B)	839,510,983
元本	715,401,824
次期繰越損益金	124,109,159
(D) 受益権総口数	715,401,824口
1万口当り基準価額(C / D)	11,735円

\* 期首における元本額は743,572,984円、当作成期間中における追加設定元本額は207,870,721円、同解約元本額は236,041,881円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,735円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	345円
受取利息	142
その他収益金	2,550
支払利息	△ 2,347
(B) 有価証券売買損益	91,335,977
売買益	191,162,273
売買損	△ 99,826,296
(C) 信託報酬等	△ 2,633,110
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	88,703,212
(E) 前期繰越損益金	14,500,871
(F) 追加信託差損益金	20,905,076
(配当等相当額)	( 12,588,142)
(売買損益相当額)	( 8,316,934)
(G) 合計(D + E + F)	124,109,159
次期繰越損益金(G)	124,109,159
追加信託差損益金	20,905,076
(配当等相当額)	( 12,588,142)
(売買損益相当額)	( 8,316,934)
分配準備積立金	103,204,083

(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	345円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	88,702,183
(c) 収益調整金	20,905,076
(d) 分配準備積立金	14,501,555
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	124,109,159
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	124,109,159
(h) 受益権総口数	715,401,824口

# ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第15期 (決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2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。

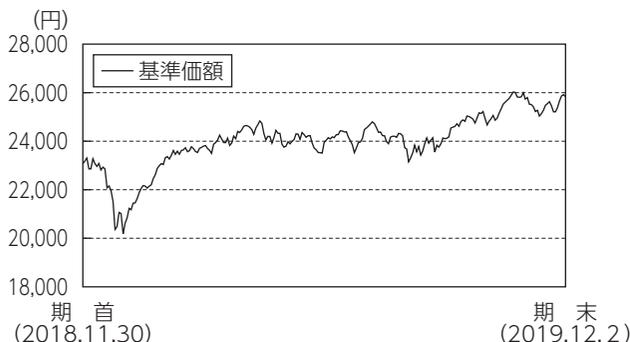
運用方針	S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) に連動した投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場 (上場予定を含みます。) および店頭登録 (登録予定を含みます。) の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース)		株式 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 債券 組入比率	不動産 指数 先物比率
	円	%	%	%				
期首 (2018.11.30)	23,067	-	26,534	-	-	0.8	97.9	0.9
12月末	21,021	△ 8.9	24,151	△ 9.0	-	0.9	98.2	0.6
2019年1月末	22,989	△ 0.3	26,640	0.4	-	0.7	98.2	0.8
2月末	23,535	2.0	27,167	2.4	-	1.1	97.9	0.8
3月末	24,402	5.8	28,053	5.7	-	0.4	98.4	1.0
4月末	24,325	5.5	27,986	5.5	-	0.5	98.5	1.0
5月末	23,647	2.5	27,421	3.3	-	0.8	98.2	1.0
6月末	23,713	2.8	27,403	3.3	-	0.9	97.8	1.2
7月末	24,306	5.4	28,108	5.9	-	1.2	97.4	1.3
8月末	24,131	4.6	27,908	5.2	-	2.7	95.8	1.5
9月末	25,140	9.0	29,167	9.9	-	0.7	97.5	1.7
10月末	25,993	12.7	30,076	13.3	0.0	0.9	95.5	3.6
11月末	25,916	12.4	30,002	13.1	-	2.0	95.0	2.9
期末 (2019年12月2日)	25,842	12.0	29,879	12.6	-	2.0	95.1	2.9

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスである S & P グローバル株指指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとの R E I T 制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
- (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：23,067円 期末：25,842円 騰落率：12.0%

【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

海外リート市況は上昇しました。

米国リート市況は、当作成期首から、米中貿易摩擦問題に加えて F R B (米国連邦準備制度理事会) の利上げ継続姿勢に対する投資家懸念の高まりなどにより株価が急落し、リスク回避の動きが強まったため、下落しました。2019年に入ると、米中貿易摩擦の緩和期待や年内の利上げ停止が示唆され長期金利が低下したこと、また米中貿易交渉の進展期待などから、米国リート市況は上昇に転じました。4月以降しばらくは、米中貿易摩擦が悪材料となったものの好調な決算発表などもあり一進一退の展開となりましたが、その後は F R B による利下げ観測や好調な住宅市場などが支援材料となり、米国リート市場は堅調に推移しました。当作成期末にかけては、長期金利の上昇や米国議会において香港人権法案が可決された影響などを嫌気して、軟調に推移しました。

欧州リート市況は、当作成期首より、イタリアや英国等の政治的不安定さが嫌気され、総じて下落しました。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、フランスや英国を中心に欧州リート市況は上昇しました。しかし2月以降は、英国の E U (欧州連合) 離脱交渉への不透明感に加えて、ユーロ圏の経済見通しの引き下げなどから、上値が重い展開となりました。その中で、好調なオフィス市況などからドイツは上昇しました。その後は、E C B (欧州中央銀行) による金融緩和政策や E U 離脱に対する懸念が緩和されたことを受け、英国やフランスを中心に欧州リート市況は上昇しました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港は大型商業施設リートの業績への期待継続や中国の景気刺激策で買われましたが、2019年7月以降は反政府デモの影響から売られました。シンガポールは、中国の景気刺激策への期待から堅調に推移しました。オーストラリアは、好調な業績見通しを反映した商業施設リートや低金利の長期化見通しが好感され、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、米中貿易摩擦の激化が悪材料となって米ドル安となりました。2019年に入ると、米中貿易摩擦に対する懸念が後退し F R B (米国連邦準備制度理事会) が穏健的なスタンスに転じたことから、リスク回避の動きが後退して、米ドル高となりました。しかし5月に入ると、再び激化した米中貿易摩擦が、同じく対米貿易黒字が大きい日本に対する圧力になり、円高が進行しました。当作成期末にかけては、米中貿易摩擦に対する懸念が後退したことでリスク回避の動きが弱まり、米ドル高となりました。

ユーロは、当作成期首から、リスク回避が強まった局面での円への資金流入を受けて、ユーロ安となりました。しかしその後は、日銀総裁がさらなる金融緩和についても言及したことなどによる円に対する警戒感もあり、ボックス圏の推移となりました。2019年5月以降は、英国およびイタリアでの政局混乱や欧州の景況感悪化による金融緩和期待から、ユーロ安が進みました。当作成期末にかけては、米ドル同様にユーロ高となりました。英ポンドもユーロとほぼ同じ動きとなりました。

豪ドルは、当作成期首から他通貨同様に売られました。2019年1月には買い戻された局面もありましたが、4月中旬からは、世界経済の減速懸念が強まったことやオーストラリアの金利低下が続いたことから、再び下落しました。9月以降はそれまでの反動もあり緩やかな豪ドル高となりましたが、11月には市場の利下げ観測の高まりから下落しました。

◆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）ならびに不動産投資指数先物取引を利用することがあります。

◆ポートフォリオについて

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

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

◆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12.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は12.0%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ズレも、かい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投資指数先物取引を利用することがあります。

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

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	3円
(株式)	( 0)
(先物・オプション)	( 1)
(投資信託受益証券)	( 0)
(投資信託証券)	( 2)
有価証券取引税	2
(株式)	( 0)
(投資信託受益証券)	( 0)
(投資信託証券)	( 2)
その他費用	10
(保管費用)	( 12)
(その他)	(△ 2)
合計	15

(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12月1日から2019年12月2日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 (0.37)	千アメリカ・ドル ( 1)	百株 0.37	千アメリカ・ドル 0

(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12月1日から2019年12月2日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 223.6 ( - )	千アメリカ・ドル 20,114 ( - )	千口 186.1 ( - )	千アメリカ・ドル 16,686 ( - )

(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12月1日から2019年12月2日まで)

	買		付		売		付		
	口	数	金	額	口	数	金	額	
外	アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
		1,111.2 (△ 176.493)	44,239 (△ 1,368)	183.57 (-)	10,387 (-)	183.57 (-)	10,387 (-)	183.57 (-)	10,387 (-)
	カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
		79.8 (△ 2.7)	1,583 (△ 38)	7.2 (-)	125 (-)	7.2 (-)	125 (-)	7.2 (-)	125 (-)
	オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
		1,288.09 (△ 27.821)	5,780 (△ 340)	334.08 (-)	1,492 (-)	334.08 (-)	1,492 (-)	334.08 (-)	1,492 (-)
	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
		372.5 (-)	9,517 (-)	54 (-)	3,188 (-)	54 (-)	3,188 (-)	54 (-)	3,188 (-)
	シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
		2,059 (△ 216.674)	2,935 (△ 248)	123.7 (-)	251 (-)	123.7 (-)	251 (-)	123.7 (-)	251 (-)
ニュージーランド	千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル	
	204.89 (-)	349 (-)	71.48 (-)	161 (-)	71.48 (-)	161 (-)	71.48 (-)	161 (-)	
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド	
	913.9 (△ 164.144)	2,181 (△ 11)	113.31 (-)	534 (-)	113.31 (-)	534 (-)	113.31 (-)	534 (-)	
イスラエル	千口	千イスラエル・シェケル	千口	千イスラエル・シェケル	千口	千イスラエル・シェケル	千口	千イスラエル・シェケル	
	19.5 (-)	301 (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	
韓国	千口	千韓国ウォン	千口	千韓国ウォン	千口	千韓国ウォン	千口	千韓国ウォン	
	6 (-)	33,858 (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	
国	ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		32.81 (△ 111.57)	49 (△ 160)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)
	ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
2.82 (-)	84 (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	
4.54 (△ 1.986)	411 (△ 67)	1 (-)	0 (-)	1 (-)	0 (-)	1 (-)	0 (-)	1 (-)	

	買		付		売		付		
	口	数	金	額	口	数	金	額	
外	ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		12.96 (△ 1.182)	1,140 (-)	15.69 (-)	1,134 (-)	15.69 (-)	1,134 (-)	15.69 (-)	1,134 (-)
	ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		2.28 (-)	30 (△ 13)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	
	10.84 (-)	123 (△ 6)	11.71 (-)	127 (-)	11.71 (-)	127 (-)	11.71 (-)	127 (-)	
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	
	- (△ 143.4)	- (△ 0)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	- (-)	
国	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		66.25 (△ 251.802)	1,840 (△ 112)	28.4 (-)	1,262 (-)	28.4 (-)	1,262 (-)	28.4 (-)	1,262 (-)

(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12月1日から2019年12月2日まで)

種 類 別	買		建		売		建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円							
不動産投信指数先物取引	2,201	1,629	-	-	-	-	-	-

(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12月1日から2019年12月2日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘柄	柄	口 数	金 額	平均単価	銘柄	柄	口 数	金 額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		千口	千円	円	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		千口	千円	円
		223.6	2,187,996	9,785			186.1	1,817,478	9,766

(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12月1日から2019年12月2日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
EQUINIX INC (アメリカ)		14.8	904,204	61,094	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		4.8	84,446	17,593
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		11.4	201,937	17,713	PROLOGIS INC (アメリカ)		9.1	80,565	8,853
PROLOGIS INC (アメリカ)		23.2	193,526	8,341	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		8.3	75,603	9,108
WELLTOWER INC (アメリカ)		18.6	164,254	8,830	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		2.1	54,730	26,062
INVITATION HOMES INC (アメリカ)		50.9	154,394	3,033	BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)		3.8	53,870	14,176
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		5.4	135,121	25,022	COVIVIO (フランス)		4.29	48,737	11,360
REALTY INCOME CORP (アメリカ)		14.5	111,271	7,673	WELLTOWER INC (アメリカ)		4.7	44,419	9,451
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		13.1	110,274	8,417	LINK REIT (香港)		34	41,796	1,229
VENTAS INC (アメリカ)		15.3	109,783	7,175	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		1.7	38,339	22,552
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		5	109,042	21,808	ESSEX PROPERTY TRUST INC (アメリカ)		1.1	37,396	33,996

(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	当		期		未
	口数	評価額	比率	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	54.5	5,072	556,331		2.0

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

(注2) 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	当		期		未
	口数	評価額	比率	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
不動産ファンド		千アメリカ・ドル	千円		%
(シンガポール)	千口				
MANULIFE US REAL ESTATE INV	281.462	271	29,790		0.1
ARA US HOSPITALITY TRUST	87.8	75	8,233		0.0
(アメリカ)					
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22.3	584	64,081		0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	107	11,795		0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	19.582	405	44,522		0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	19.1	402	44,118		0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	24.4	5,231	573,802		2.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	53.847	8,142	893,037		3.3
BOSTON PROPERTIES INC	25.2	3,491	382,915		1.4
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	26.067	1,401	153,729		0.6
VORNADO REALTY TRUST	27.464	1,773	194,501		0.7
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	12.1	281	30,868		0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10.2	341	37,477		0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.7	177	19,418		0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10.4	551	60,535		0.2
EQUITY RESIDENTIAL	60.9	5,182	568,426		2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	36.2	588	64,558		0.2
EPR PROPERTIES	13.6	964	105,787		0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	42	4,706		0.0
CITY OFFICE REIT INC	9.3	124	13,698		0.1

ファンド名	当		期		未
	口数	評価額	比率	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
GLOBAL NET LEASE INC	15.133	308	33,843		0.1
EQUINIX INC	14.8	8,389	920,147		3.4
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11.829	334	36,742		0.1
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	135	14,852		0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5.7	240	26,432		0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8.8	785	86,123		0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19.7	359	39,411		0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.9	138	15,140		0.1
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4.113	40	4,425		0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	126.4	2,210	242,473		0.9
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	44.508	1,188	130,388		0.5
CORESITE REALTY CORP	6.4	725	79,594		0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27.4	980	107,587		0.4
RLJ LODGING TRUST	29.371	501	55,053		0.2
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	19	2,121		0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	31.9	612	67,141		0.2
CYRUSONE INC	19.8	1,233	135,294		0.5
KIMCO REALTY CORP	73.8	1,595	175,000		0.6
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7	97	10,687		0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	35.95	1,091	119,669		0.4
WHITESTONE REIT	5.8	81	8,931		0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35.7	1,506	165,237		0.6

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	%
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22.6	499	54,830	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	42.48	1,004	110,190	0.4
COLONY CAPITAL INC	83.511	407	44,698	0.2
INVITATION HOMES INC	93.897	2,866	314,416	1.2
JBG SMITH PROPERTIES	20.132	802	88,058	0.3
CLIPPER REALTY INC	1.4	12	1,374	0.0
GLADSTONE LAND CORP	2.5	31	3,476	0.0
AMERICOLD REALTY TRUST	33.9	1,275	139,876	0.5
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10.5	227	24,921	0.1
VICI PROPERTIES INC	79.8	1,973	216,448	0.8
RETAIL VALUE INC	2,709	96	10,550	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12.5	237	26,076	0.1
BRT APARTMENTS CORP	1.3	23	2,617	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7.3	84	9,287	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1.9	147	16,131	0.1
SAFEHOLD INC	1.3	53	5,824	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	124	13,669	0.1
AMERICAN FINANCE TRUST INC	18.1	267	29,361	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14.2	370	40,634	0.1
CORECIVIC INC	21.424	324	35,599	0.1
COREPOINT LODGING INC	6.7	67	7,429	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3.4	63	6,913	0.0
STORE CAPITAL CORP	36.4	1,481	162,528	0.6
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17.8	215	23,661	0.1
LIFE STORAGE INC	8.2	898	98,499	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8.7	413	45,353	0.2
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	16.182	241	26,516	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6.6	90	9,967	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	36.3	493	54,107	0.2
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25.7	358	39,350	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18.7	894	98,161	0.4
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21.1	438	48,043	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	22.6	700	76,817	0.3
VENTAS INC	65.179	3,800	416,848	1.5
CARETRUST REIT INC	17.203	359	39,396	0.1
GEO GROUP INC/THE	20.9	289	31,771	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	52.1	1,143	125,372	0.5
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9	300	32,930	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32.887	732	80,364	0.3
UMH PROPERTIES INC	5.6	87	9,587	0.0
IRON MOUNTAIN INC	50.2	1,612	176,850	0.6
TERRENO REALTY CORP	11.4	658	72,170	0.3
VEREIT INC	184.508	1,800	197,511	0.7
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17.62	923	101,266	0.4
SUN COMMUNITIES INC	15.9	2,618	287,239	1.1
ACADIA REALTY TRUST	14.911	400	43,960	0.2
ALEXANDER'S INC	0.4	130	14,318	0.1
PROLOGIS INC	110.302	10,098	1,107,564	4.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19.8	3,217	352,938	1.3
BRANDYWINE REALTY TRUST	30.3	467	51,278	0.2
SAUL CENTERS INC	1.7	90	9,908	0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22.945	33	3,623	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	15.6	333	36,598	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	16.8	1,874	205,544	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	26.006	1,052	115,491	0.4
SITE CENTERS CORP	27.078	392	43,034	0.2
DUKE REALTY CORP	62.6	2,202	241,544	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	6.6	898	98,586	0.4

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11.567	3,610	396,052	1.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22.5	958	105,078	0.4
FEDERAL REALTY INVST TRUST	12.2	1,611	176,722	0.6
GETTY REALTY CORP	5.703	191	20,991	0.1
WELLTOWER INC	70.8	5,987	656,715	2.4
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	86	2,999	329,004	1.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17.7	859	94,251	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	28	652	71,524	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22	730	80,086	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	20.775	682	74,852	0.3
KILROY REALTY CORP	16.2	1,348	147,902	0.5
LIBERTY PROPERTY TRUST	27.3	1,682	184,506	0.7
LTC PROPERTIES INC	7.2	337	36,965	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	42.2	467	51,283	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	20.028	2,726	298,988	1.1
MACERICH CO/THE	19.1	514	56,415	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31.5	2,333	255,940	0.9
NATL HEALTH INVESTORS INC	7.4	599	65,734	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	30	1,672	183,406	0.7
REALTY INCOME CORP	55.617	4,261	467,448	1.7
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19.3	563	61,768	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8.6	49	5,433	0.0
PUBLIC STORAGE	26.2	5,519	605,413	2.2
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3.4	600	65,852	0.2
REGENCY CENTERS CORP	29.02	1,887	207,016	0.8
RPT REALTY	13.8	203	22,370	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15.1	229	25,206	0.1
SL GREEN REALTY CORP	14.4	1,228	134,769	0.5
SENIOR HOUSING PROP TRUST	41	300	32,917	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	10.5	341	37,405	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	146	16,037	0.1
UDR INC	50.7	2,436	267,195	1.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.2	262	28,762	0.1
WP CAREY INC	29.6	2,469	270,825	1.0
WASHINGTON REIT	13.8	428	47,027	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20.6	655	71,939	0.3
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11.3	31	3,408	0.0
AGREE REALTY CORP	7.4	553	60,693	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37.848	1,590	174,473	0.6
CUBESMART	34.1	1,051	115,344	0.4
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38.326	536	58,850	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	36.478	4,412	483,909	1.8
CEDAR REALTY TRUST INC	10.8	28	3,162	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	22.3	2,364	259,383	1.0
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5.275	74	8,204	0.0
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2.06	159	17,469	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	15.65	302	33,214	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	1.7	260	28,583	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	60	6,589	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	24.1	1,157	126,983	0.5
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4.7	107	11,742	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	36.342	374	41,055	0.2
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	86.8	1,801	197,639	0.7
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	182	20,061	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	28.8	1,269	139,207	0.5
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36.8	523	57,435	0.2
アメリカ・ドル 通 貨 計	4,202,749 156銘柄	173,820	19,064,636	<70.1%>

ファンド名	当 期 末			比 率
	口 数	評 価 額	比 率	
	千口	千カナダ・ドル	千円	%
(カナダ)				
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	154	12,782	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	18.4	308	25,509	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	3.1	40	3,350	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7.7	153	12,666	0.0
SLATE OFFICE REIT	5.1	30	2,511	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	96	7,960	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13.7	170	14,058	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	10.7	137	11,350	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4.2	30	2,553	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4.6	315	26,052	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9.4	131	10,880	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10.4	171	14,160	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT	27.4	376	31,081	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	80	6,610	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	181	14,983	0.1
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12.6	403	33,343	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14.1	781	64,584	0.2
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16.79	238	19,725	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26.066	562	46,474	0.2
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27.6	749	61,887	0.2
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	163	13,549	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	228	18,844	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4.9	148	12,286	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	151	12,503	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10.2	544	45,001	0.2
カナダ・ドル 通 貨 計	279,956 25銘柄	6,350 25銘柄	524,713 25銘柄	< 1.9% >
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	47.52	164	12,208	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	338.284	414	30,769	0.1
RURAL FUNDS GROUP	50.595	94	7,024	0.0
VIVA ENERGY REIT	76.33	212	15,812	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	68.595	388	28,878	0.1
CENTURIA METROPOLITAN REIT	64.95	205	15,239	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	170.86	464	34,506	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	57.547	253	18,800	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	135.195	260	19,373	0.1
APN INDUSTRIA REIT	29.76	86	6,408	0.0
GDI PROPERTY GROUP	83.31	128	9,557	0.0
SCENTRE GROUP	985.27	3,881	288,235	1.1
ARENA REIT	59.89	177	13,162	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21.3	69	5,139	0.0
BWP TRUST	90.55	385	28,641	0.1
DEXUS	199.22	2,436	180,907	0.7
GPT GROUP	354.21	2,178	161,745	0.6
CHARTER HALL RETAIL REIT	59.4	273	20,288	0.1
MIRVAC GROUP	728.04	2,453	182,171	0.7
STOCKLAND	442.42	2,234	165,890	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP	64.12	248	18,424	0.1
GOODMAN GROUP	296.45	4,393	326,209	1.2
VICINITY CENTRES	584.59	1,566	116,327	0.4
CHARTER HALL GROUP	82.96	896	66,587	0.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP	45.22	212	15,780	0.1
オーストラリア・ドル 通 貨 計	5,136,586 25銘柄	24,082 25銘柄	1,788,091 25銘柄	< 6.6% >
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEYIU REAL ESTATE INVESTMEN	287	1,486	20,828	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	965	13,519	0.0
FORTUNE REIT	245	2,227	31,200	0.1

ファンド名	当 期 末			比 率
	口 数	評 価 額	比 率	
	千口	千香港ドル	千円	%
PROSPERITY REIT	195	579	8,113	0.0
LINK REIT	387.5	31,000	434,310	1.6
CHAMPION REIT	375	1,890	26,478	0.1
香 港 ド ル 通 貨 計	1,682.5 6銘柄	38,147 6銘柄	534,451 6銘柄	< 2.0% >
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	220.083	440	35,305	0.1
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126.2	129	10,426	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	409	482	38,710	0.1
AIMS APAC REIT	89	127	10,208	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	86	6,936	0.0
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	271.65	336	27,018	0.1
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	73	5,897	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	520.575	1,046	83,928	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	539.516	1,607	128,958	0.5
CAPITALAND MALL TRUST	531.5	1,339	107,431	0.4
SUNTEC REIT	419.4	771	61,897	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	528	892	71,572	0.3
KEPPEL REIT	343.4	422	33,879	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	129.96	217	17,408	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	213.6	288	23,129	0.1
ESR-REIT	374.902	200	16,087	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	157.6	255	20,478	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	130.668	360	28,927	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	243.8	175	14,079	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	145.396	231	18,542	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69.3	225	18,065	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267.2	64	5,143	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	273.58	686	55,079	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST	174.5	124	10,007	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	395.284	932	74,825	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	134	10,808	0.0
SPH REIT	166.6	176	14,164	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	112.1	58	4,720	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124.4	58	4,689	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	148.9	168	13,495	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	436.063	244	19,586	0.1
シンガポール・ドル 通 貨 計	7,952.077 31銘柄	12,360 31銘柄	991,413 31銘柄	< 3.6% >
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	223	15,786	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	273.92	432	30,568	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	56.8	151	10,731	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	188.25	401	28,387	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	190.24	345	24,387	0.1
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	867.73 5銘柄	1,555 5銘柄	109,861 5銘柄	< 0.4% >
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	413.93	313	44,425	0.2
CAPITAL & REGIONAL PLC	59.27	16	2,366	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	99.57	96	13,675	0.1
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	142.71	125	17,720	0.1
PICTON PROPERTY INCOME LTD	88.11	81	11,539	0.0
REGIONAL REIT LTD	81.31	87	12,433	0.0
NEWRIVER REIT PLC	51.33	99	14,099	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	100.49	88	12,577	0.0
LXI REIT PLC	94.038	119	16,989	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54.33	48	6,846	0.0

ファンド名	当 期 末				
	口 数	評 価 額	比 率		
	外貨建金額	邦貨換算金額			
AEW UK REIT PLC	千口 25.61	千円 23	3,372	0.0	
RDI REIT PLC	41,036	52	7,413	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	134,841	1,292	182,979	0.7	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	70.79	73	10,383	0.0	
SEGRO PLC	193.21	1,727	244,568	0.9	
HAMMERSON PLC	133.92	398	56,354	0.2	
UNITE GROUP PLC/THE	52.72	659	93,382	0.3	
BRITISH LAND CO PLC	165.49	952	134,873	0.5	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48.391	402	56,923	0.2	
INTU PROPERTIES PLC	145.67	50	7,218	0.0	
DERWENT LONDON PLC	18.69	691	97,860	0.4	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	213.44	314	44,485	0.2	
WORKSPACE GROUP PLC	24.16	268	38,005	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	36.39	275	38,952	0.1	
SHAFTESBURY PLC	40.68	368	52,242	0.2	
BIG YELLOW GROUP PLC	27.81	307	43,510	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	154.34	358	50,830	0.2	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121.6	65	9,297	0.0	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	296.77	439	62,273	0.2	
イギリス・ボンド 通 貨 計	口数、金額 29銘柄 <比率>	3,130,646	9,800	1,387,601	< 5.1%>
(イスラエル) REIT 1 LTD	千口 28.84	千イスラエル・シェケル 657	千円 20,761	% 0.1	
イスラエル・シェケル 通 貨 計	口数、金額 1銘柄 <比率>	28,84	657	20,761	< 0.1%>
(韓国) SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	千口 6	千韓国ウォン 49,740	千円 4,635	% 0.0	
韓国ウォン 通 貨 計	口数、金額 1銘柄 <比率>	6	49,740	4,635	< 0.0%>
ユーロ (アイルランド) IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES HIBERNIA REIT PLC	千口 58.05 116.24	千ユーロ 102 169	千円 12,348 20,483	% 0.0 0.1	
国 小 計	口数、金額 2銘柄 <比率>	174.29	271	32,831	< 0.1%>
ユーロ (オランダ) WERELDHAVE NV EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV NSI NV VASTNED RETAIL NV	千口 6.47 6.53 3.231 3.75	千ユーロ 140 170 130 103	千円 16,968 20,614 15,776 12,509	% 0.1 0.1 0.1 0.0	
国 小 計	口数、金額 4銘柄 <比率>	19,981	544	65,868	< 0.2%>
ユーロ (ベルギー) AEDIFICA COFINIMMO BEFIMMO INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES RETAIL ESTATES WAREHOUSES DE PAUW SCA MONTEA	千口 4.144 4.07 3.72 3.31 1.94 3.17 1.65	千ユーロ 459 546 217 90 172 509 130	千円 55,593 66,013 26,301 10,901 20,891 61,530 15,774	% 0.2 0.2 0.1 0.0 0.1 0.2 0.1	
国 小 計	口数、金額 7銘柄 <比率>	22,004	2,126	257,004	< 0.9%>
ユーロ (フランス) UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD ICADE ALTAREA GECINA SA KLEPIERRE COVIVIO	千口 23.2 4.56 0.54 9.241 35.24 7.562	千ユーロ 3,292 414 105 1,448 1,147 759	千円 397,880 50,069 12,778 175,124 138,719 91,759	% 1.5 0.2 0.0 0.6 0.5 0.3	

ファンド名	当 期 末				
	口 数	評 価 額	比 率		
	外貨建金額	邦貨換算金額			
MERCIALYS	千口 4.03	千ユーロ 48	千円 5,844	% 0.0	
国 小 計	口数、金額 7銘柄 <比率>	84,373	7,216	872,177	< 3.2%>
ユーロ (ドイツ) ALSTRIA OFFICE REIT-AG HAMBORNER REIT AG	千口 26.6 11.98	千ユーロ 441 114	千円 53,302 13,827	% 0.2 0.1	
国 小 計	口数、金額 2銘柄 <比率>	38.58	555	67,130	< 0.2%>
ユーロ (スペイン) LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	千口 10.53 39.553 61.77	千ユーロ 82 452 801	千円 10,028 54,735 96,827	% 0.0 0.2 0.4	
国 小 計	口数、金額 3銘柄 <比率>	111,853	1,337	161,591	< 0.6%>
ユーロ (イタリア) IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	千口 6.24	千ユーロ 40	千円 4,856	% 0.0	
国 小 計	口数、金額 1銘柄 <比率>	6.24	40	4,856	< 0.0%>
ユーロ通貨計	口数、金額 26銘柄 <比率>	457,321	12,092	1,461,460	< 5.4%>
合 計	口数、金額 305銘柄 <比率>	23,744,405	-	25,887,626	< 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) 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) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	601	-
STOXX 600 REAL (ドイツ)	192	-

(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12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	556,331	2.0
投資信託証券	25,887,626	94.8
コール・ローン等、その他	876,644	3.2
投資信託財産総額	27,320,601	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1香港ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=80.21円、1ニュージーランド・ドル=70.63円、1イギリス・ポンド=141.59円、1イスラエル・シェケル=31.56円、100韓国ウォン=9.32円、1ユーロ=120.86円です。  
 (注3) 当期末における外貨建純資産(26,571,729千円)の投資信託財産総額(27,320,601千円)に対する比率は、97.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>27,977,862,671円</b>
コール・ローン等	697,302,399
投資信託受益証券(評価額)	556,331,509
投資信託証券(評価額)	25,887,626,426
未収入金	680,451,599
未収配当金	49,262,263
差入委託証拠金	106,888,475
<b>(B) 負債</b>	<b>766,513,878</b>
未払金	766,067,473
未払解約金	446,040
その他未払費用	365
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>27,211,348,793</b>
元本	10,530,038,419
次期繰越損益金	16,681,310,374
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>10,530,038,419口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	25,842円

- \* 期首における元本額は8,618,915,071円、当作成期間中における追加設定元本額は3,230,356,134円、同解約元本額は1,319,232,786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) 4,865,906,045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) 735,435,579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) 329,451,568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) 230,518,876円、D-1's グローバルREITインデックス1,341,811円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 351,124円、iFree 外国REITインデックス98,214,754円、iFree 8資産バランス868,450,594円、グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型) 386,949円、グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型) 386,949円、DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド 2,208,215,204円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 2,681,724円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,545,141円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 2,040,991円、ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT 241,290,100円、ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド 34,970,209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) 690,658,642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) 213,192,159円です。  
 \* 当期末の計算口数当りの純資産額は25,842円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>849,462,134円</b>
受取配当金	848,497,084
受取利息	264,153
その他収益金	818,968
支払利息	△ 118,071
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>1,886,640,609</b>
売買益	3,314,451,189
売買損	△ 1,427,810,580
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>33,505,859</b>
取引益	53,026,668
取引損	△ 19,520,809
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 9,633,676</b>
<b>(E) 当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>2,759,974,926</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>11,262,455,896</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 1,883,826,114</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>4,542,705,666</b>
<b>(I) 合計(E+F+G+H)</b>	<b>16,681,310,374</b>
次期繰越損益金(I)	16,681,310,374

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

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

## 運用報告書 (全体版) 第3期

(決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日~2019年12月2日)

### 受益者のみなさまへ

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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			S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 組入比率	投信証 証券比率	不動産 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
1期末(2017年11月30日)	円 10,273	円 0	% 2.7	10,407	% 4.1	% 0.3	% 98.9	% 0.5	百万円 312
2期末(2018年11月30日)	10,501	0	2.2	10,745	3.2	0.8	97.9	0.9	561
3期末(2019年12月2日)	11,725	0	11.7	12,100	12.6	2.0	95.1	2.9	595

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

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

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

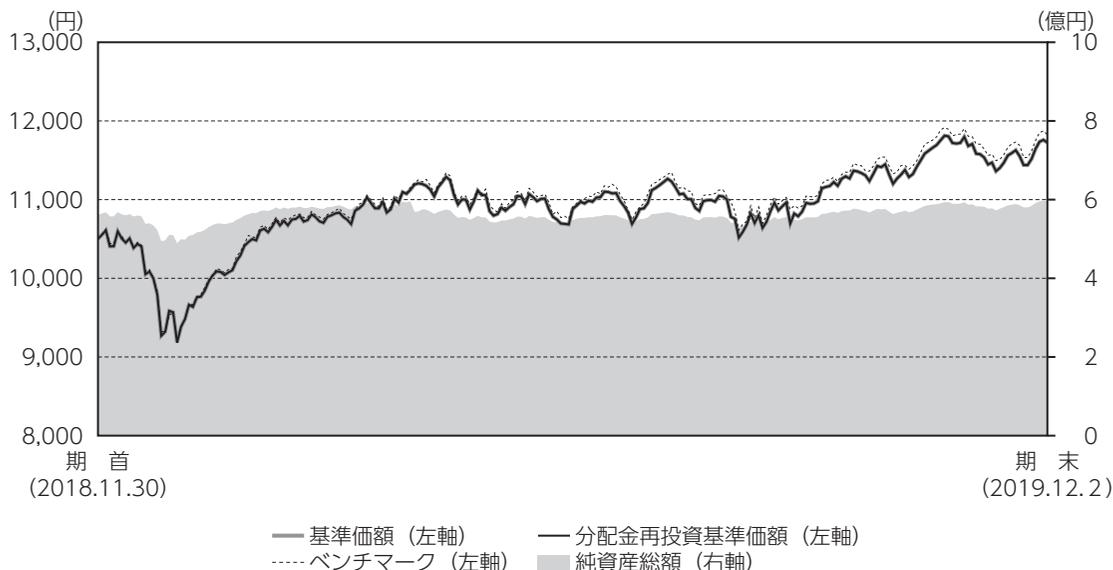
(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

\*ベンチマークはS & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)です。

### ■基準価額・騰落率

期首：10,501円

期末：11,725円(分配金0円)

騰落率：11.7%(分配金込み)

### ■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

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

年 月 日	基準価額		S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		株式 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券組入 比率	不動産 投信指 先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
(期首) 2018年11月30日	円 10,501	% -	10,745	% -	% -	% 0.8	% 97.9	% 0.9
12月末	9,568	△ 8.9	9,780	△ 9.0	-	0.9	98.2	0.6
2019年 1 月末	10,460	△ 0.4	10,788	0.4	-	0.7	98.2	0.8
2 月末	10,705	1.9	11,002	2.4	-	1.1	97.9	0.8
3 月末	11,096	5.7	11,361	5.7	-	0.4	98.3	1.0
4 月末	11,058	5.3	11,333	5.5	-	0.5	98.5	1.0
5 月末	10,747	2.3	11,105	3.3	-	0.8	98.1	1.0
6 月末	10,774	2.6	11,097	3.3	-	0.9	97.8	1.2
7 月末	11,040	5.1	11,383	5.9	-	1.2	97.4	1.3
8 月末	10,958	4.4	11,302	5.2	-	2.7	95.8	1.5
9 月末	11,413	8.7	11,812	9.9	-	0.7	97.5	1.7
10 月末	11,797	12.3	12,180	13.3	0.0	0.9	95.5	3.6
11 月末	11,759	12.0	12,150	13.1	-	2.0	94.9	2.9
(期末) 2019年12月 2 日	11,725	11.7	12,100	12.6	-	2.0	95.1	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

(2018.12.1～2019.12.2)

### ■海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

米国リート市況は、当作成期首から、米中貿易摩擦問題に加えて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などにより株価が急落し、リスク回避の動きが強まったため、下落しました。2019年に入ると、米中貿易摩擦の緩和期待や年内の利上げ停止が示唆され長期金利が低下したこと、また米中貿易交渉の進展期待などから、米国リート市況は上昇に転じました。4月以降しばらくは、米中貿易摩擦が悪材料となったものの好調な決算発表などもあり一進一退の展開となりましたが、その後はFRBによる利下げ観測や好調な住宅市場などが支援材料となり、米国リート市場は堅調に推移しました。当作成期末にかけては、長期金利の上昇や米国議会において香港人権法案が可決された影響などを嫌気して、軟調に推移しました。

欧州リート市況は、当作成期首より、イタリアや英国等の政治的不安定さが嫌気され、総じて下落しました。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、フランスや英国を中心に欧州リート市況は上昇しました。しかし2月以降は、英国のEU（欧州連合）離脱交渉への不透明感に加えて、ユーロ圏の経済見通しの引き下げなどから、上値が重い展開となりました。その中で、好調なオフィス市況などからドイツは上昇しました。その後は、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和政策やEU離脱に対する懸念が緩和されたことを受け、英国やフランスを中心に欧州リート市況は上昇しました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港は大型商業施設リートの業績への期待継続や中国の景気刺激策で買われましたが、2019年7月以降は反政府デモの影響から売られました。シンガポールは、中国の景気刺激策への期待から堅調に推移しました。オーストラリアは、好調な業績見通しを反映した商業施設リートや低金利の長期化見通しが好感され、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、米中貿易摩擦の激化が悪材料となって米ドル安となりました。2019年に入ると、米中貿易摩擦に対する懸念が後退しFRB（米国連邦準備制度理事会）が穏健的なスタンスに転じたことから、リスク回避の動きが後退して、米ドル高となりました。しかし5月に入ると、再び激化した米中貿易摩擦が、同じく対米貿易黒字が大きい日本に対する圧力になり、円高が進行しました。当作成期末にかけては、米中貿易摩擦に対する懸念が後退したことでリスク回避の動きが弱まり、米ドル高となりました。

ユーロは、当作成期首から、リスク回避が強まった局面での円への資金流入を受けて、ユーロ安となりました。しかしその後は、日銀総裁がさらなる金融緩和についても言及したことなどによる円に対する警戒感もあり、ボックス圏の推移となりました。2019年5月以降は、英国およびイタリアでの政局混乱や欧州の景況感悪化による金融緩和期待から、ユーロ安が進みました。当作成期末にかけては、米ドル同様にユーロ高となりました。英ポンドもユーロとほぼ同じ動きとなりました。

豪ドルは、当作成期首から他通貨同様に売られました。2019年1月には買い戻された局面もありましたが、4月中旬からは、世界経済の減速懸念が強まったことやオーストラリアの金利低下が続いたことから、再び下落しました。9月以降はそれまでの反動もあり緩やかな豪ドル高となりましたが、11月には市場の利下げ観測の高まりから下落しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

今後の運用につきましては、引き続き、主として「ダイワ・グローバル R E I T 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 R E I T インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2018.12.1 ~ 2019.12.2)

### ■当ファンド

「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ 100% 行いました。

### ■ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

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

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

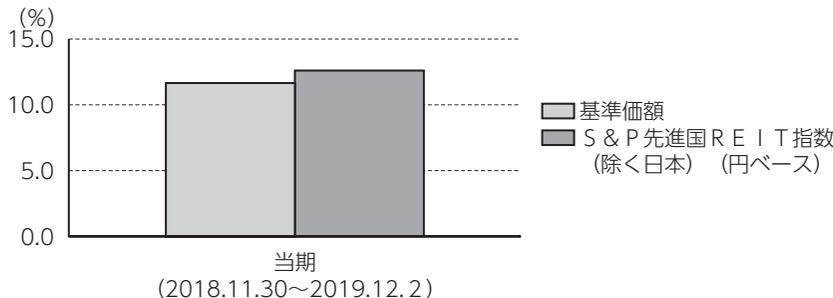
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマーク ( S & P 先進国 R E I T 指数 ( 除く日本 ) ( 円ベース ) ) の騰落率は 12.6% となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は 11.7% 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、マザーファンドにおいて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ズレも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ～2019年12月2日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,894

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2018.12.1~2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	35円	0.321%	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10,910円です。
(投 信 会 社)	(27)	(0.245)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	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)	
(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	0.010	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(1)	(0.009)	
そ の 他 費 用	5	0.046	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)	(0.052)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(△1)	(△0.011)	合併にかかる税金支払いの戻し、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	42	0.388	

(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。

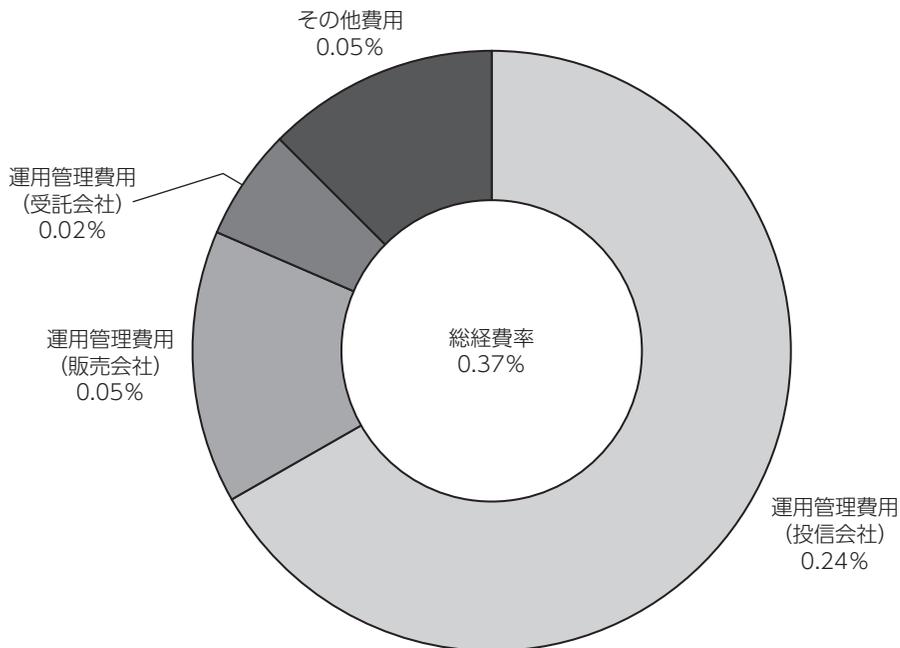
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.37%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年12月1日から2019年12月2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	26,226	62,323	38,998	93,455

(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12月1日から2019年12月2日まで)

項 目	当 期
	ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	90千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	89千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	1.00

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	243,291	230,518	595,706

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2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	595,706	99.8
コール・ローン等、その他	1,217	0.2
投資信託財産総額	596,924	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1香港ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=80.21円、1ニュージーランド・ドル=70.63円、1イギリス・ポンド=141.59円、1イスラエル・シケル=31.56円、100韓国ウォン=9.32円、1ユーロ=120.86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(26,571,729千円)の投資信託財産総額(27,320,601千円)に対する比率は、97.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	596,924,265円
コール・ローン等	1,217,386
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)	595,706,879
(B) 負債	1,172,018
未払解約金	238,199
未払信託報酬	918,163
その他未払費用	15,656
(C) 純資産総額(A-B)	595,752,247
元本	508,116,057
次期繰越損益金	87,636,190
(D) 受益権総口数	508,116,057口
1万口当り基準価額(C/D)	11,725円

\*期首における元本額は534,454,266円、当作成期間中における追加設定元本額は146,810,171円、同解約元本額は173,148,380円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は11,725円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	520円
受取利息	21
その他収益金	1,194
支払利息	△ 695
(B) 有価証券売買損益	59,287,408
売買益	68,182,599
売買損	△ 8,895,191
(C) 信託報酬等	△ 1,833,512
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	57,454,416
(E) 前期繰越損益金	22,693,189
(F) 追加信託差損益金	7,488,585
(配当等相当額)	( 16,119,520)
(売買損益相当額)	(△ 8,630,935)
(G) 合計(D + E + F)	87,636,190
次期繰越損益金(G)	87,636,190
追加信託差損益金	7,488,585
(配当等相当額)	( 16,119,520)
(売買損益相当額)	(△ 8,630,935)
分配準備積立金	80,147,605

(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	520円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	57,453,488
(c) 収益調整金	16,119,520
(d) 分配準備積立金	22,693,597
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	96,267,125
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	96,267,125
(h) 受益権総口数	508,116,057口

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第15期にかかる運用状況については、294～302ページをご参照ください。