

# 運用報告書 (全体版)

第8期<決算日2020年1月14日>

## DIAMDC 8資産バランスファンド

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/内外/資産複合(インデックス型)  |  |
| 信託期間   | 2012年9月6日から無期限です。   |  |
| 運用方針   | 信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。   |  |
| 主要投資対象 | ベビーファンド*  | 以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。  |
|        | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド   | 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。   |
|        | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド   | わが国の公社債を主要投資対象とします。  |
|        | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド   | 海外の株式を主要投資対象とします。  |
|        | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド   | 海外の公社債を主要投資対象とします。   |
|        | エマージング株式パッシブ・マザーファンド  | 海外の証券取引所に上場している株式 <sup>®</sup> を主要投資対象とします。<br>※DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。 |
| 対象     | エマージング債券パッシブ・マザーファンド  | 新興国の公社債を主要投資対象とします。  |
|        | J-REITインデックスファンド・マザーファンド  | 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。                                      |
|        | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド   | 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 <sup>®</sup> を主要投資対象とします。<br>※海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。 |
| 運用方法   | 主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資し、基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。<br>実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |  |
| 組入制限   | マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>外貨建資産への実質投資割合については、制限を設けません。                                |  |
| 分配方針   | 決算日(原則として1月11日。休業日の場合は翌営業日。)に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。      |  |

\*ベビーファンドとは、DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10)、DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20)、DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30)です。

愛称：宝船

DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10)

DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20)

DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30)

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAMDC 8資産バランスファンド」は、2020年1月14日に第8期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

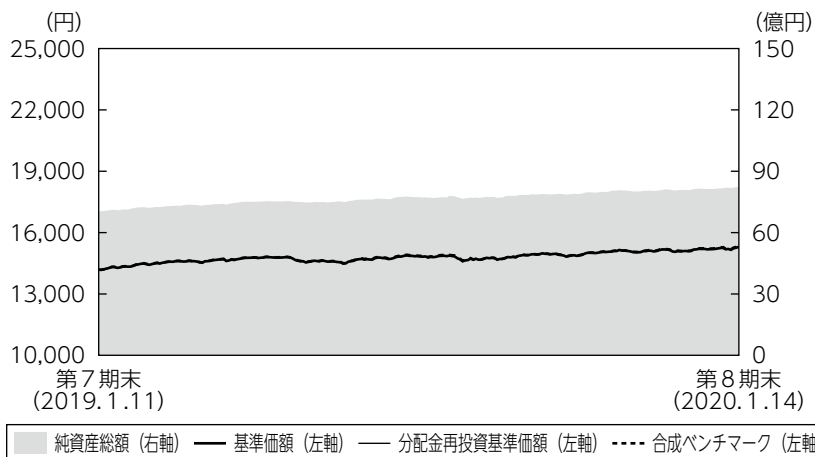
東京都千代田区丸の内1-8-2

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

## ■当期の運用経過（2019年1月12日から2020年1月14日まで）

### DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

#### 基準価額等の推移



第8期首：14,186円  
 第8期末：15,303円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率：7.9%  
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 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。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額および合成ベンチマーク（委託会社が独自に合成した指数）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

#### 基準価額の主な変動要因

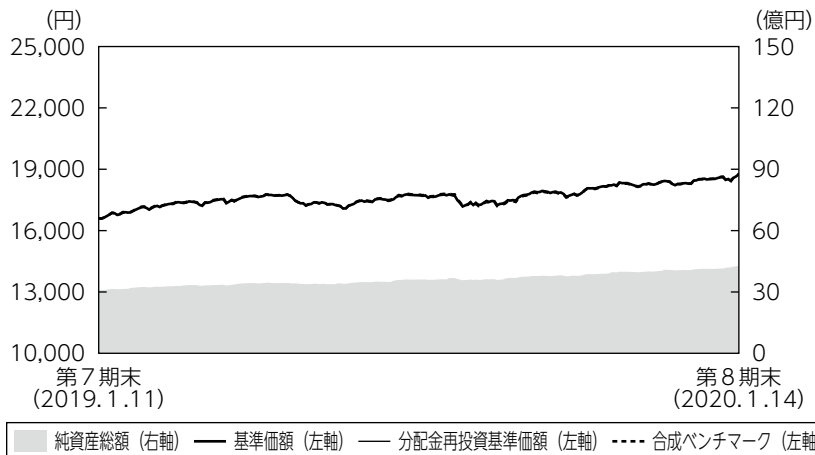
米中通商協議の進展期待や主要国の金利が低下推移したことなどを材料に新興国を含む国内外の株式市場が上昇したこと、多くの中央銀行がハト派姿勢を強めたこと等を背景に主要国の金利が低下（債券価格は上昇）したこと、金利の低下を好感し国内外のリート市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

#### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド                      | 騰落率   |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 16.7% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 1.2%  |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 27.6% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 7.6%  |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 19.1% |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 17.0% |
| J-REITインデックスファンド・マザーファンド    | 22.4% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 20.8% |

## D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）

### 基準価額等の推移



第8期首：16,601円  
 第8期末：18,760円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率：13.0%  
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 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。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額および合成ベンチマーク（委託会社が独自に合成した指数）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

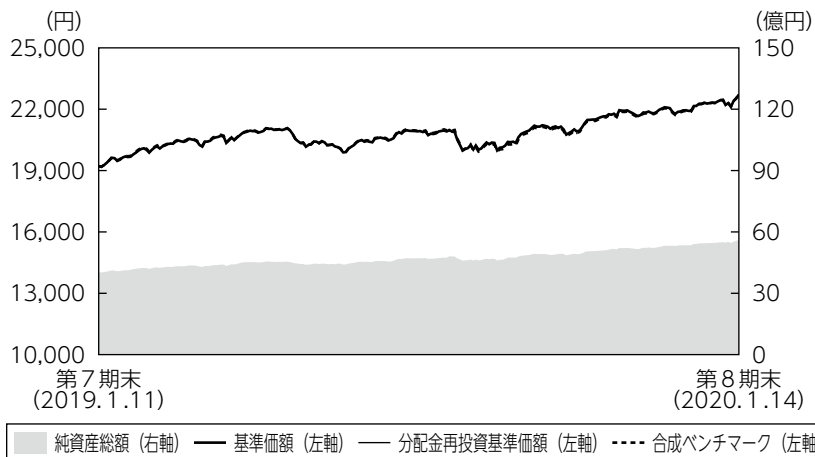
米中通商協議の進展期待や主要国の金利が低下推移したことなどを材料に新興国を含む国内外の株式市場が上昇したこと、多くの中央銀行がハト派姿勢を強めたこと等を背景に主要国の金利が低下（債券価格は上昇）したこと、金利の低下を好感し国内外のリート市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド                      | 騰落率   |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 16.7% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 1.2%  |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 27.6% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 7.6%  |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 19.1% |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 17.0% |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 22.4% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 20.8% |

## DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

### 基準価額等の推移



第8期首：19,213円  
 第8期末：22,720円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率：18.3%  
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 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。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額および合成ベンチマーク（委託会社が独自に合成した指数）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

米中通商協議の進展期待や主要国の金利が低下推移したことなどを材料に新興国を含む国内外の株式市場が上昇したこと、多くの中央銀行がハト派姿勢を強めたこと等を背景に主要国の金利が低下（債券価格は上昇）したこと、金利の低下を好感し国内外のリート市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド                      | 騰落率   |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 16.7% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 1.2%  |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 27.6% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 7.6%  |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 19.1% |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 17.0% |
| J-REITインデックスファンド・マザーファンド    | 22.4% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 20.8% |

## 投資環境

国内株式市場は、期初から2019年4月までは、米国が利上げに慎重な姿勢であったことや米中貿易問題の進展期待などを要因として上昇しました。しかし、5月に入ると世界景気の後退懸念が広がり反落しました。その後はほぼ横ばいとなりましたが、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され下落しました。9月から期末にかけては、米欧の中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し、国内株式市場は上昇しました。

国内債券市場は上昇（利回りは低下）しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念や、世界景気の先行き不透明感の高まり、米欧の中央銀行の金融緩和観測などを背景に、10年国債利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きや、国内債券需給の緩みが意識されたことなどから、利回りの低下幅は縮小しました。

先進国株式市場は、パウエルF R B（米連邦準備理事会）議長が、金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから2019年4月下旬にかけて堅調に推移しました。その後は方向感の定まらない展開となりましたが、10月中旬以降は米中通商協議の進展期待から上昇傾向となりました。2020年に入ると、中東情勢の悪化懸念などから一時下落する場面もありましたが、前期末比で上昇となりました。欧州市場もほぼ同様の動きとなり、各国市場は前期末比で上昇となりました。

先進国債券市場では、米国債、ドイツ債の利回りは、ともに低下しました。世界的な景気減速に加え、米中貿易摩擦の激化やブレグジット（英国のEU離脱）等の不透明感があり、F R Bが政策金利を引き下げ、E C B（欧州中央銀行）も追加的に金融緩和したこと等から利回りは低下しました。その後、米中貿易摩擦やブレグジットへの懸念が後退したことから利回りは上昇に転じましたが、期を通して見ると利回りは低下しました。

新興国株式市場は前期末比で上昇しました。期の前半はF R Bのパウエル議長が利上げに慎重な姿勢を示したことなどから世界景気への先行き不安が和らいで堅調に推移しました。2019年5月に入ると米国による新たな対中制裁の発表により大幅な調整となり、その後は米中貿易摩擦激化を巡る思惑などから方向感に乏しい展開となりました。期末にかけては米中関係改善の期待などから堅調な推移となりました。

新興国債券市場は上昇しました。期初から2019年6月にかけては米国の利下げ期待などから上昇しました。その後はアルゼンチン大統領選挙の予備選で与党が敗北したことから一時下落する場面もありましたが、期末にかけては米中間の緊張緩和期待から値を戻しました。米国長期金利は8月にかけて大きく低下し、対米国債スプレッド（利回り格差）は米国の利下げや期末にかけて米中間の緊張緩和期待が高まったことなどから縮小しました。

国内リート市場は、内需ディフェンシブ株の一角として株式投資家からの資金流入が見られたことや、超低金利環境の継続に対するインカムゲイン期待の投資家の買い付けなどを背景に底堅い展開が続きました。積極的な資産の入れ替え方針などによる投資主価値の向上への期待も加わり、大幅上昇となりました。2019年11月以降は、日米長期金利の上昇を受け、利益確定目的と見られる売りが国内リート市場の上値を抑える要因となりました。

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は、米中通商協議を巡る警戒感などから下落する場面もありましたが、底堅い業績発表や長期金利の低下などを背景に堅調に推移しました。欧州リート市場は、低金利環境の長期化期待や英国のEU離脱問題の進展などを受け各市場で概ね上昇しました。豪州リート市場についても、長期金利の低下やオーストラリア経済への期待などから堅調に推移しました。

為替市場では多くの通貨に対して円安に振れました。ドル/円相場は、2019年5月から8月にかけて米国の長期金利低下による日米金利差縮小を背景に円高ドル安となりました。しかし9月以降は、米中協議の進展期待が高まり米国の長期金利が下げ止まったことや、市場心理が好転したこと等を背景に円安ドル高の動きとなりました。また、その他多くの通貨に対しても長期金利の下げ止まりと市場心理の好転等を背景に円安現地通貨高となりました。

## ポートフォリオについて

各ファンドでは、それぞれ以下の基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざし、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行いました。

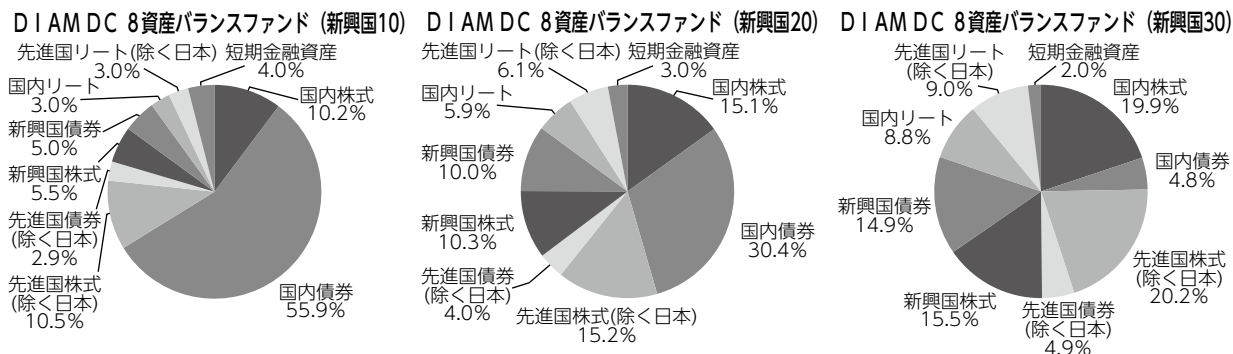
### <基本アロケーション>

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）：国内株式10%、国内債券57%、先進国株式（除く日本）10%、先進国債券（除く日本）3%、新興国株式5%、新興国債券5%、国内リート3%、先進国リート（除く日本）3%、短期金融資産4%

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）：国内株式15%、国内債券31%、先進国株式（除く日本）15%、先進国債券（除く日本）4%、新興国株式10%、新興国債券10%、国内リート6%、先進国リート（除く日本）6%、短期金融資産3%

DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）：国内株式20%、国内債券5%、先進国株式（除く日本）20%、先進国債券（除く日本）5%、新興国株式15%、新興国債券15%、国内リート9%、先進国リート（除く日本）9%、短期金融資産2%

## 決算日（2020年1月14日）現在の組入比率



#### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

#### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

#### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

#### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

#### ●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

#### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

#### ●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

配当落ち以外の場合ではリートの実質組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めました。

#### ●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

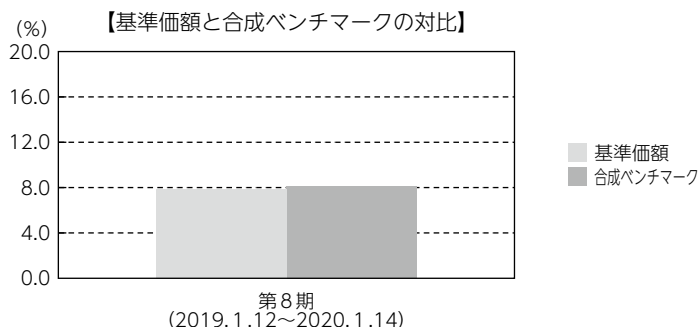
ベンチマークであるS&P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行いました。

## DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）

### 合成ベンチマークとの差異について

合成ベンチマークは前期末比で8.1%上昇しました。

当ファンドの騰落率は合成ベンチマークを0.2%下回りました。信託報酬の影響を除くと、合成ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

### 分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目         | 当期                        |
|------------|---------------------------|
|            | 2019年1月12日<br>～2020年1月14日 |
| 当期分配金（税引前） | －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  | 5,303円                    |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」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。また、小数点第3位を四捨五入しています。

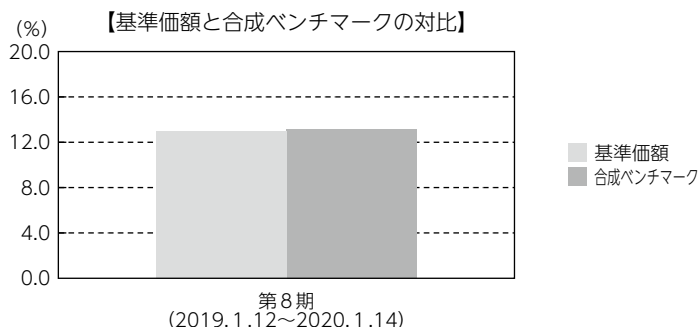
(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。



## DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20） 合成ベンチマークとの差異について

合成ベンチマークは前期末比で13.2%上昇しました。

当ファンドの騰落率は合成ベンチマークを0.2%下回りました。信託報酬の影響を除くと、合成ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目         | 当期                        |
|------------|---------------------------|
|            | 2019年1月12日<br>～2020年1月14日 |
| 当期分配金（税引前） | －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  | 8,759円                    |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」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。また、小数点第3位を四捨五入しています。

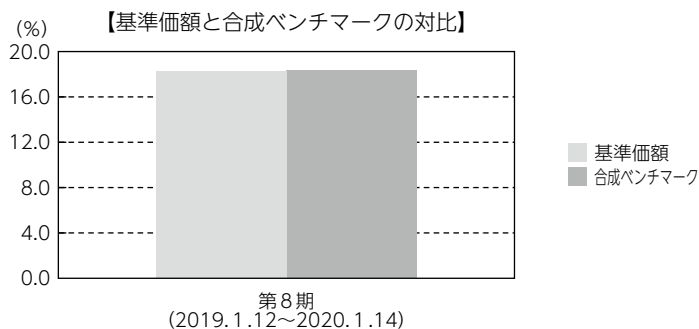
(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）

### 合成ベンチマークとの差異について

合成ベンチマークは前期末比で18.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率は合成ベンチマークを0.1%下回りました。信託報酬の影響を除くと、合成ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

### 分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目         | 当期                        |
|------------|---------------------------|
|            | 2019年1月12日<br>～2020年1月14日 |
| 当期分配金（税引前） | －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  | 12,719円                   |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」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。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「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・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

各ファンドでは、引き続き、合成ベンチマークに概ね連動した投資成果が得られるよう、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行います。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行います。

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

### ●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

### ●J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

引き続き、リートの実質組入比率を高め、ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持するよう努めます。

### ●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

## ■分配金のお知らせ

各ファンドの収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案して無分配とさせていただきます。

\*合成ベンチマークについて

- (注1) 合成ベンチマークとは、東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース、為替ヘッジなし)、東証REIT指数 (配当込み)、S&P先進国REITインデックス (除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、コール・ローン (オーバーナイト物) を、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。基本アロケーションについては、前掲の「ポートフォリオについて」をご参照ください。
- (注2) 経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。
- (注3) 東証株価指数 (TOPIX) および東証REIT指数は、株式会社東京証券取引所 (㈩東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- (注4) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- (注5) MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注6) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- (注7) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- (注8) S&P先進国REITインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社 (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・アンド・プアーズ・ファイナンシャル・サービシズLLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC (「Dow Jones」) の登録商標です。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各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、これらのいずれの関係者も、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インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

## DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10)

### ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額<br>(分配額) |            |            | 合 成<br>ベンチマーク |            | 株式組入<br>比率 | 株式先物<br>比率 | 債券組入<br>比率 | 新株予約<br>権付社債<br>(転換社債)<br>比率 | 債券先物<br>比率 | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額  |
|----------------|---------------|------------|------------|---------------|------------|------------|------------|------------|------------------------------|------------|-------------------------------|------------|
|                | 円             | 税込み<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 | ポイント          | 期 中<br>騰落率 |            |            |            |                              |            |                               |            |
| 4期(2016年1月12日) | 13,081        | 0          | △1.8       | 13,316.55     | △1.2       | 22.9       | 0.4        | 64.9       | —                            | —          | 5.6                           | 百万円<br>512 |
| 5期(2017年1月11日) | 13,892        | 0          | 6.2        | 14,259.59     | 7.1        | 23.9       | 0.7        | 64.0       | —                            | —          | 6.3                           | 792        |
| 6期(2018年1月11日) | 14,668        | 0          | 5.6        | 15,111.41     | 6.0        | 23.9       | 0.8        | 64.1       | —                            | —          | 6.1                           | 1,056      |
| 7期(2019年1月11日) | 14,186        | 0          | △3.3       | 14,700.83     | △2.7       | 23.7       | 1.2        | 66.3       | —                            | —          | 6.6                           | 7,043      |
| 8期(2020年1月14日) | 15,303        | 0          | 7.9        | 15,894.85     | 8.1        | 24.3       | 1.5        | 61.9       | —                            | —          | 6.2                           | 8,245      |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) △(白三角) はマイナスを意味しています(以下同じ)。

### ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日                | 基準価額   |     | 合 成<br>ベンチマーク |     | 株式組入<br>比率 | 株式先物<br>比率 | 債券組入<br>比率 | 新株予約<br>権付社債<br>(転換社債)<br>比率 | 債券先物<br>比率 | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 |
|--------------------|--------|-----|---------------|-----|------------|------------|------------|------------------------------|------------|-------------------------------|
|                    | 円      | 騰落率 | ポイント          | 騰落率 |            |            |            |                              |            |                               |
| (期首)<br>2019年1月11日 | 14,186 | —   | 14,700.84     | —   | 23.7       | 1.2        | 66.3       | —                            | —          | 6.6                           |
| 1月末                | 14,377 | 1.3 | 14,904.26     | 1.4 | 24.0       | 0.9        | 64.4       | —                            | —          | 6.3                           |
| 2月末                | 14,584 | 2.8 | 15,128.26     | 2.9 | 24.3       | 0.9        | 63.7       | —                            | —          | 6.3                           |
| 3月末                | 14,692 | 3.6 | 15,239.30     | 3.7 | 23.9       | 0.9        | 64.3       | —                            | —          | 6.3                           |
| 4月末                | 14,780 | 4.2 | 15,329.79     | 4.3 | 24.3       | 0.9        | 63.5       | —                            | —          | 6.3                           |
| 5月末                | 14,548 | 2.6 | 15,094.82     | 2.7 | 23.5       | 0.9        | 64.8       | —                            | —          | 6.2                           |
| 6月末                | 14,752 | 4.0 | 15,317.50     | 4.2 | 24.0       | 0.9        | 64.0       | —                            | —          | 6.2                           |
| 7月末                | 14,854 | 4.7 | 15,430.17     | 5.0 | 23.8       | 0.8        | 64.4       | —                            | —          | 6.3                           |
| 8月末                | 14,804 | 4.4 | 15,341.08     | 4.4 | 23.1       | 0.9        | 64.6       | —                            | —          | 6.3                           |
| 9月末                | 14,922 | 5.2 | 15,479.15     | 5.3 | 23.8       | 0.9        | 65.3       | —                            | —          | 6.5                           |
| 10月末               | 15,100 | 6.4 | 15,659.78     | 6.5 | 24.1       | 1.2        | 63.6       | —                            | —          | 6.5                           |
| 11月末               | 15,168 | 6.9 | 15,740.41     | 7.1 | 24.5       | 1.1        | 63.7       | —                            | —          | 6.4                           |
| 12月末               | 15,250 | 7.5 | 15,839.54     | 7.7 | 24.9       | 1.0        | 64.0       | —                            | —          | 6.2                           |
| (期末)<br>2020年1月14日 | 15,303 | 7.9 | 15,894.85     | 8.1 | 24.3       | 1.5        | 61.9       | —                            | —          | 6.2                           |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目          | 第8期                         |         | 項目の概要  |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
|             | (2019年1月12日<br>～2020年1月14日) |         |  |
|             | 金額                          | 比率      |  |
| (a) 信託報酬    | 51円                         | 0.345%  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は14,794円です。                     |
| (投信会社)      | (25)                        | (0.170) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価                             |
| (販売会社)      | (20)                        | (0.137) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価                     |
| (受託会社)      | ( 6)                        | (0.038) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価                                 |
| (b) 売買委託手数料 | 1                           | 0.006   | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料   |
| (株式)        | ( 1)                        | (0.004) |  |
| (先物・オプション)  | ( 0)                        | (0.001) |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                        | (0.000) |  |
| (投資証券)      | ( 0)                        | (0.001) |  |
| (c) 有価証券取引税 | 1                           | 0.008   | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式)        | ( 1)                        | (0.006) |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                        | (0.000) |  |
| (投資証券)      | ( 0)                        | (0.002) |  |
| (d) その他費用   | 3                           | 0.019   | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  |
| (保管費用)      | ( 1)                        | (0.009) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用   |
| (監査費用)      | ( 1)                        | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用   |
| (その他)       | ( 1)                        | (0.006) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等   |
| 合計          | 56                          | 0.378   |  |

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

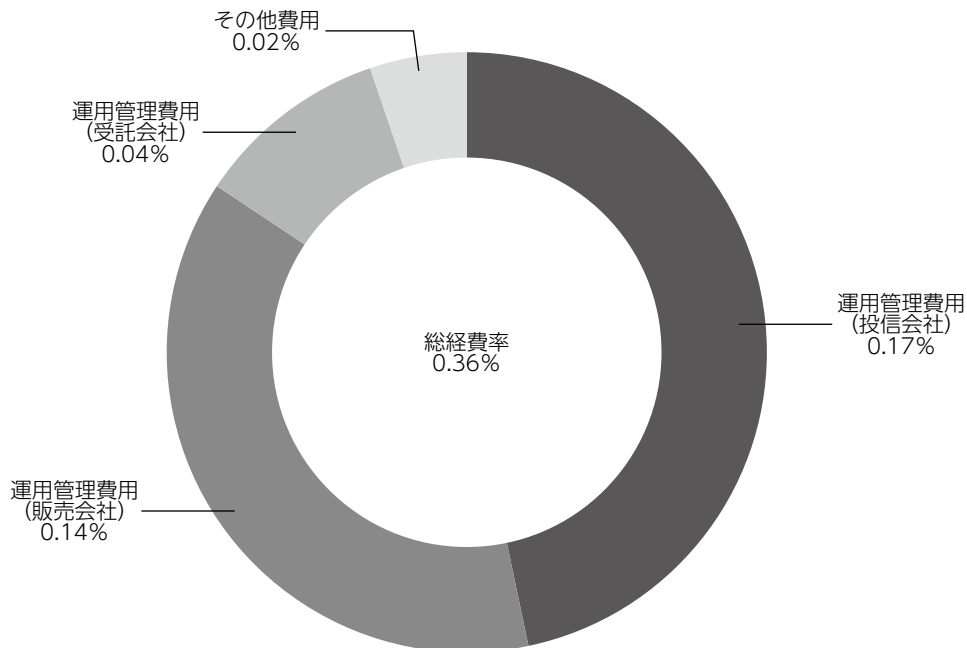
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・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口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.36%です。



(注1) 1万口当た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。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年1月12日から2020年1月14日まで）

|                                 | 当       |         | 期      |        |
|---------------------------------|---------|---------|--------|--------|
|                                 | 設 定     |         | 解 約    |        |
|                                 | □ 数     | 金 額     | □ 数    | 金 額    |
|                                 | 千□      | 千円      | 千□     | 千円     |
| 国内株式パッシブ・ファンド<br>(最適化法)・マザーファンド | 39,281  | 94,342  | 19,345 | 50,045 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド       | 406,151 | 535,548 | 32,054 | 42,535 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド       | 17,558  | 60,536  | 20,429 | 76,205 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド       | 8,600   | 15,688  | —      | —      |
| エマージング株式パッシブ・<br>マザーファンド        | 45,404  | 48,191  | 18,065 | 21,264 |
| エマージング債券パッシブ・<br>マザーファンド        | 843     | 1,591   | 812    | 1,585  |
| J-R E I Tインデックス<br>ファンド・マザーファンド | —       | —       | 9,009  | 20,151 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド     | 4,465   | 5,570   | —      | —      |

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目               | 当                                   |                                  | 期                            |                                      |
|-------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|
|                   | 国内株式パッシブ・<br>ファンド(最適化法)・<br>マザーファンド | 外 国 株 式<br>パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド | エマージング株式<br>パッシブ・<br>マザーファンド | 外 国 リ ー ト ・<br>パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 142,039,995千円                       | 93,736,671千円                     | 71,468,817千円                 | 80,930千円                             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 256,149,281千円                       | 333,695,084千円                    | 48,000,584千円                 | 229千円                                |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.55                                | 0.28                             | 1.48                         | 352.31                               |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。



■利害関係人との取引状況等（2019年1月12日から2020年1月14日まで）

【DIAMDC 8資産バランスファンド（新興国10）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                         | 当 期   |
|-----------------------------|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)       | 473千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 0.9千円 |
| (B)／(A)                     | 0.2%  |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組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。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期<br>区 分 | 当             |                    |          | 期             |                    |          |
|--------------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
|              | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 株 式          | 百万円<br>52,178 | 百万円<br>24          | %<br>0.0 | 百万円<br>89,861 | 百万円<br>5,933       | %<br>6.6 |

平均保有割合 0.3%

(注) 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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当          |            | 期            |
|-----|------------|------------|--------------|
|     | 買 付 額      | 売 付 額      | 当 期 末 保 有 額  |
| 株 式 | 百万円<br>449 | 百万円<br>848 | 百万円<br>2,512 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当     | 期         |
|-----|-------|-----------|
|     | 買 付 額 | 額         |
| 株 式 |       | 百万円<br>98 |

## 【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

| 区 分   | 当 期            |                    |          | 期              |                    |           |
|-------|----------------|--------------------|----------|----------------|--------------------|-----------|
|       | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C       |
| 公 社 債 | 百万円<br>104,200 | 百万円<br>10,037      | %<br>9.6 | 百万円<br>193,140 | 百万円<br>20,664      | %<br>10.7 |

平均保有割合 1.6%

(注) 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。

## 【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 区 分     | 当 期           |                    |          | 期             |                    |          |
|---------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
|         | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 投 資 証 券 | 百万円<br>52,628 | 百万円<br>467         | %<br>0.9 | 百万円<br>50,828 | 百万円<br>414         | %<br>0.8 |

平均保有割合 0.7%

(注) 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。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類     | 当 期          |
|---------|--------------|
|         | 買 付 額        |
| 投 資 証 券 | 百万円<br>2,217 |

## 【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

### ■組入資産の明細

#### 親投資信託残高

|                             | 期首（前期末）   | 当 期 末     |           |
|-----------------------------|-----------|-----------|-----------|
|                             | □ 数       | □ 数       | 評 価 額     |
|                             | 千□        | 千□        | 千円        |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 286,731   | 306,668   | 844,962   |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 3,136,906 | 3,511,003 | 4,613,107 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 213,418   | 210,547   | 864,359   |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 116,671   | 125,271   | 239,018   |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 323,578   | 350,917   | 450,191   |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 196,510   | 196,542   | 411,520   |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 112,562   | 103,553   | 245,908   |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 172,886   | 177,352   | 248,506   |

## ■投資信託財産の構成

2020年1月14日現在

| 項 目                         | 当 期 末     |       |
|-----------------------------|-----------|-------|
|                             | 評 価 額     | 比 率   |
|                             | 千円        | %     |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 844,962   | 10.2  |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 4,613,107 | 55.7  |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 864,359   | 10.4  |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 239,018   | 2.9   |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 450,191   | 5.4   |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 411,520   | 5.0   |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 245,908   | 3.0   |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 248,506   | 3.0   |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他     | 361,637   | 4.4   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額             | 8,279,211 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2020年1月14日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは362,138,450千円、100.0％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは133,792,129千円、99.7％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは61,156,813千円、99.9％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは137,668,461千円、97.7％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは41,480,172千円、99.6％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2020年1月14日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.16円、1カナダ・ドル=84.39円、1オーストラリア・ドル=76.05円、1香港・ドル=14.17円、1シンガポール・ドル=81.86円、1ニューージーランド・ドル=72.98円、1台湾・ドル=3.68円、1イギリス・ポンド=143.16円、1イスラエル・シケル=31.79円、1スイス・フラン=113.49円、1トルコ・リラ=18.78円、1デンマーク・クローネ=16.42円、1ノルウェー・クローネ=12.40円、1スウェーデン・クローナ=11.65円、1メキシコ・ペソ=5.86円、1フィリピン・ペソ=2.19円、100チリ・ペソ=14.21円、100コロンビア・ペソ=3.37円、1カタール・リアル=30.12円、1サウジアラビア・リアル=29.41円、1インド・ルピー=1.57円、1パキスタン・ルピー=0.72円、100インドネシア・ルピア=0.81円、1アラブ首長国連邦・ディールハム=29.96円、1ブラジル・リアル=26.58円、1チェコ・コルナ=4.87円、100韓国・ウォン=9.58円、1オフショア・人民元=16.02円、1マレーシア・リングギット=27.16円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1タイ・バーツ=3.64円、1ポーランド・ズロチ=28.98円、100ハンガリー・フォリント=36.77円、1ユーロ=122.69円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年1月14日)現在

| 項 目                                  | 当 期 末                 |
|--------------------------------------|-----------------------|
| <b>(A) 資 産</b>                       | <b>8,279,211,484円</b> |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等                      | 361,036,382           |
| 国内株式パッシブ・ファンド<br>(最適化法)・マザーファンド(評価額) | 844,962,618           |
| 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 4,613,107,275         |
| 外国株式パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 864,359,223           |
| 外国債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 239,018,279           |
| エマージング株式パッシブ・<br>マザーファンド(評価額)        | 450,191,856           |
| エマージング債券パッシブ・<br>マザーファンド(評価額)        | 411,520,188           |
| J-R E I Tインデックスファンド・<br>マザーファンド(評価額) | 245,908,596           |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)     | 248,506,067           |
| 未 収 入 金                              | 601,000               |
| <b>(B) 負 債</b>                       | <b>33,828,949</b>     |
| 未 払 解 約 金                            | 19,689,452            |
| 未 払 信 託 報 酬                          | 13,971,436            |
| そ の 他 未 払 費 用                        | 168,061               |
| <b>(C) 純 資 産 総 額(A-B)</b>            | <b>8,245,382,535</b>  |
| 元 本                                  | 5,387,975,800         |
| 次 期 繰 越 損 益 金                        | 2,857,406,735         |
| <b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>               | <b>5,387,975,800口</b> |
| 1万口当たり基準価額(C/D)                      | 15,303円               |

(注) 期首における元本額は4,965,264,521円、当期中における追加  
設定元本額は771,650,558円、同解約元本額は348,939,279  
円です。

## ■損益の状況

当期 自2019年1月12日 至2020年1月14日

| 項 目                         | 当 期                  |
|-----------------------------|----------------------|
| <b>(A) 配 当 等 収 益</b>        | <b>△210,061円</b>     |
| 受 取 利 息                     | 8,206                |
| 支 払 利 息                     | △218,267             |
| <b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>  | <b>582,602,981</b>   |
| 売 買 益                       | 604,329,046          |
| 売 買 損                       | △21,726,065          |
| <b>(C) 信 託 報 酬 等</b>        | <b>△26,825,910</b>   |
| <b>(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)</b> | <b>555,567,010</b>   |
| <b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>    | <b>△67,838,781</b>   |
| <b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>  | <b>2,369,678,506</b> |
| (配 当 等 相 当 額)               | (1,754,563,153)      |
| (売 買 損 益 相 当 額)             | (615,115,353)        |
| <b>(G) 合 計(D+E+F)</b>       | <b>2,857,406,735</b> |
| <b>次 期 繰 越 損 益 金(G)</b>     | <b>2,857,406,735</b> |
| 追 加 信 託 差 損 益 金             | 2,369,678,506        |
| (配 当 等 相 当 額)               | (1,755,330,744)      |
| (売 買 損 益 相 当 額)             | (614,347,762)        |
| 分 配 準 備 積 立 金               | 487,728,229          |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて  
表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加  
設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

| 項 目                  | 当 期           |
|----------------------|---------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益      | 118,374,022円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 247,251,266   |
| (c) 収 益 調 整 金        | 2,369,678,506 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金    | 122,102,941   |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 2,857,406,735 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額    | 5,303.30      |
| (g) 分 配 金            | 0             |
| (h) 1万口当たり分配金        | 0             |

## DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20)

### ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額        |            |            | 合 成               |            | 株式組入<br>比 | 株式先物<br>比 | 債券組入<br>比 | 新株予約<br>権付社債<br>(転換社債)<br>比 | 債券先物<br>比 | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 | 純資<br>産額   |
|----------------|-------------|------------|------------|-------------------|------------|-----------|-----------|-----------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|------------|
|                | (分配落)       | 税込み<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 | ベンチマーク            | 期 中<br>騰落率 |           |           |           |                             |           |                               |            |
| 4期(2016年1月12日) | 円<br>14,776 | 円<br>0     | %<br>△4.0  | ポイント<br>15,202.16 | %<br>△3.1  | %<br>37.0 | %<br>0.7  | %<br>44.6 | %<br>-                      | %<br>-    | %<br>11.1                     | 百万円<br>658 |
| 5期(2017年1月11日) | 16,142      | 0          | 9.2        | 16,796.83         | 10.5       | 38.2      | 1.1       | 44.2      | -                           | -         | 12.3                          | 1,034      |
| 6期(2018年1月11日) | 17,637      | 0          | 9.3        | 18,432.68         | 9.7        | 38.3      | 1.4       | 44.0      | -                           | -         | 12.1                          | 1,740      |
| 7期(2019年1月11日) | 16,601      | 0          | △5.9       | 17,476.60         | △5.2       | 38.6      | 2.1       | 46.7      | -                           | -         | 13.2                          | 3,092      |
| 8期(2020年1月14日) | 18,760      | 0          | 13.0       | 19,775.39         | 13.2       | 37.3      | 2.7       | 43.1      | -                           | -         | 12.2                          | 4,278      |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) △(白三角) はマイナスを意味しています(以下同じ)。

### ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日                | 基準価額        |        | 合 成               |        | 株式組入<br>比 | 株式先物<br>比率 | 債券組入<br>比率 | 新株予約<br>権付社債<br>(転換社債)<br>比率 | 債券先物<br>比率 | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 |
|--------------------|-------------|--------|-------------------|--------|-----------|------------|------------|------------------------------|------------|-------------------------------|
|                    | 騰落率         | 騰落率    | ベンチマーク            | 騰落率    |           |            |            |                              |            |                               |
| (期首)<br>2019年1月11日 | 円<br>16,601 | %<br>- | ポイント<br>17,476.60 | %<br>- | %<br>38.6 | %<br>2.1   | %<br>46.7  | %<br>-                       | %<br>-     | %<br>13.2                     |
| 1月末                | 16,962      | 2.2    | 17,866.78         | 2.2    | 38.2      | 1.5        | 44.4       | -                            | -          | 12.4                          |
| 2月末                | 17,346      | 4.5    | 18,287.70         | 4.6    | 38.3      | 1.6        | 44.0       | -                            | -          | 12.2                          |
| 3月末                | 17,496      | 5.4    | 18,433.65         | 5.5    | 38.0      | 1.6        | 44.3       | -                            | -          | 12.4                          |
| 4月末                | 17,704      | 6.6    | 18,644.08         | 6.7    | 38.1      | 1.5        | 44.1       | -                            | -          | 12.2                          |
| 5月末                | 17,187      | 3.5    | 18,105.74         | 3.6    | 37.6      | 1.6        | 44.7       | -                            | -          | 12.3                          |
| 6月末                | 17,529      | 5.6    | 18,485.70         | 5.8    | 38.2      | 1.5        | 44.1       | -                            | -          | 12.3                          |
| 7月末                | 17,726      | 6.8    | 18,704.36         | 7.0    | 37.9      | 1.4        | 44.4       | -                            | -          | 12.4                          |
| 8月末                | 17,484      | 5.3    | 18,350.15         | 5.0    | 37.0      | 1.5        | 44.6       | -                            | -          | 12.6                          |
| 9月末                | 17,847      | 7.5    | 18,758.99         | 7.3    | 37.9      | 1.6        | 44.7       | -                            | -          | 12.7                          |
| 10月末               | 18,249      | 9.9    | 19,177.59         | 9.7    | 37.9      | 2.1        | 44.0       | -                            | -          | 12.5                          |
| 11月末               | 18,413      | 10.9   | 19,370.65         | 10.8   | 38.0      | 1.9        | 44.4       | -                            | -          | 12.3                          |
| 12月末               | 18,614      | 12.1   | 19,619.07         | 12.3   | 38.6      | 1.8        | 44.3       | -                            | -          | 12.1                          |
| (期末)<br>2020年1月14日 | 18,760      | 13.0   | 19,775.39         | 13.2   | 37.3      | 2.7        | 43.1       | -                            | -          | 12.2                          |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目          | 第8期                         |         | 項目の概要  |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
|             | (2019年1月12日<br>～2020年1月14日) |         |  |
|             | 金額                          | 比率      |  |
| (a) 信託報酬    | 67円                         | 0.378%  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は17,670円です。                     |
| (投信会社)      | (33)                        | (0.186) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価                             |
| (販売会社)      | (27)                        | (0.153) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価                     |
| (受託会社)      | ( 7)                        | (0.038) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価                                 |
| (b) 売買委託手数料 | 2                           | 0.012   | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料   |
| (株式)        | ( 2)                        | (0.008) |  |
| (先物・オプション)  | ( 0)                        | (0.002) |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                        | (0.000) |  |
| (投資証券)      | ( 0)                        | (0.001) |  |
| (c) 有価証券取引税 | 3                           | 0.016   | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>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) |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                        | (0.000) |  |
| (投資証券)      | ( 1)                        | (0.003) |  |
| (d) その他費用   | 6                           | 0.033   | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  |
| (保管費用)      | ( 3)                        | (0.018) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用   |
| (監査費用)      | ( 1)                        | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用   |
| (その他)       | ( 2)                        | (0.010) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等   |
| 合計          | 78                          | 0.439   |  |

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

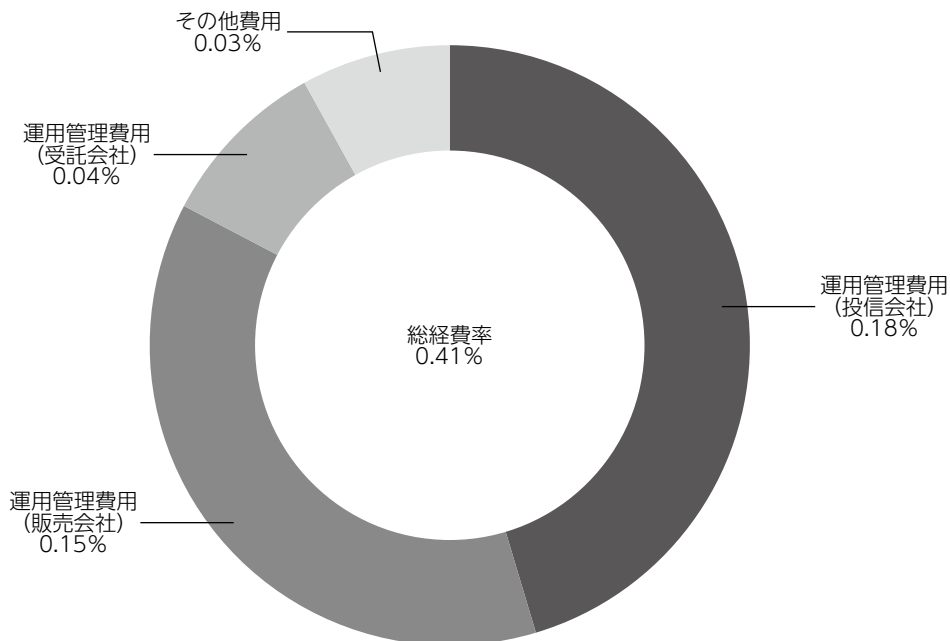
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・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口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.41%です。



(注1) 1万口当た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。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。



■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年1月12日から2020年1月14日まで）

|                                  | 当       |         | 期      |        |
|----------------------------------|---------|---------|--------|--------|
|                                  | 設 定     |         | 解 約    |        |
|                                  | □ 数     | 金 額     | □ 数    | 金 額    |
|                                  | 千□      | 千円      | 千□     | 千円     |
| 国内株式パッシブ・ファンド<br>（最適化法）・マザーファンド  | 46,134  | 114,085 | 6,374  | 16,655 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド        | 260,908 | 344,195 | 21,004 | 27,621 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド        | 27,617  | 98,041  | 12,861 | 46,949 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド        | 21,340  | 39,603  | —      | —      |
| エマージング株式パッシブ・<br>マザーファンド         | 75,795  | 82,774  | 14,735 | 17,889 |
| エマージング債券パッシブ・<br>マザーファンド         | 32,779  | 65,123  | —      | —      |
| JーR E I T インデックス<br>ファンド・マザーファンド | 12,010  | 27,257  | 4,022  | 9,124  |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド      | 33,067  | 43,665  | 2,154  | 2,795  |

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目               | 当                                   |                                  | 期                            |                                      |
|-------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|
|                   | 国内株式パッシブ・<br>ファンド(最適化法)・<br>マザーファンド | 外 国 株 式<br>パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド | エマージング株式<br>パッシブ・<br>マザーファンド | 外 国 リ ー ト ・<br>パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 142,039,995千円                       | 93,736,671千円                     | 71,468,817千円                 | 80,930千円                             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 256,149,281千円                       | 333,695,084千円                    | 48,000,584千円                 | 229千円                                |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.55                                | 0.28                             | 1.48                         | 352.31                               |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年1月12日から2020年1月14日まで）

【DIAMDC 8資産バランスファンド（新興国20）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                         | 当 期   |
|-----------------------------|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)       | 437千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 0.8千円 |
| (B)／(A)                     | 0.2%  |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組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。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期<br>区 分 | 当             |                    |          | 期             |                    |          |
|--------------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
|              | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 株 式          | 百万円<br>52,178 | 百万円<br>24          | %<br>0.0 | 百万円<br>89,861 | 百万円<br>5,933       | %<br>6.6 |

平均保有割合 0.2%

(注) 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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当          |            | 期            |
|-----|------------|------------|--------------|
|     | 買 付 額      | 売 付 額      | 当 期 末 保 有 額  |
| 株 式 | 百万円<br>449 | 百万円<br>848 | 百万円<br>2,512 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当     | 期         |
|-----|-------|-----------|
|     | 買 付 額 | 買 付 額     |
| 株 式 |       | 百万円<br>98 |

## 【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期<br>区 分 | 当 期            |                    |          | 期              |                    |           |
|--------------|----------------|--------------------|----------|----------------|--------------------|-----------|
|              | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C       |
| 公 社 債        | 百万円<br>104,200 | 百万円<br>10,037      | %<br>9.6 | 百万円<br>193,140 | 百万円<br>20,664      | %<br>10.7 |

平均保有割合 0.4%

(注) 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。

## 【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期<br>区 分 | 当 期           |                    |          | 期             |                    |          |
|--------------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
|              | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 投 資 証 券      | 百万円<br>52,628 | 百万円<br>467         | %<br>0.9 | 百万円<br>50,828 | 百万円<br>414         | %<br>0.8 |

平均保有割合 0.6%

(注) 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。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類     | 当 期          |
|---------|--------------|
|         | 買 付 額        |
| 投 資 証 券 | 百万円<br>2,217 |

## 【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

### ■組入資産の明細

#### 親投資信託残高

|                             | 期首（前期末） | 当 期 末   |           |
|-----------------------------|---------|---------|-----------|
|                             | □ 数     | □ 数     | 評 価 額     |
|                             | 千□      | 千□      | 千円        |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 194,305 | 234,064 | 644,917   |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 750,943 | 990,847 | 1,301,874 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 144,027 | 158,784 | 651,856   |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 67,978  | 89,318  | 170,420   |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 283,538 | 344,598 | 442,085   |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 172,561 | 205,341 | 429,943   |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 97,972  | 105,960 | 251,623   |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 153,844 | 184,756 | 258,880   |

## ■投資信託財産の構成

2020年1月14日現在

| 項 目                         | 当 期 末     |       |
|-----------------------------|-----------|-------|
|                             | 評 価 額     | 比 率   |
|                             | 千円        | %     |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 644,917   | 15.0  |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 1,301,874 | 30.3  |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 651,856   | 15.2  |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 170,420   | 4.0   |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 442,085   | 10.3  |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 429,943   | 10.0  |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 251,623   | 5.9   |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 258,880   | 6.0   |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他     | 141,008   | 3.3   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額             | 4,292,610 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2020年1月14日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは362,138,450千円、100.0％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは133,792,129千円、99.7％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは61,156,813千円、99.9％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは137,668,461千円、97.7％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは41,480,172千円、99.6％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2020年1月14日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.16円、1カナダ・ドル=84.39円、1オーストラリア・ドル=76.05円、1香港・ドル=14.17円、1シンガポール・ドル=81.86円、1ニュージーランド・ドル=72.98円、1台湾・ドル=3.68円、1イギリス・ポンド=143.16円、1イスラエル・シェケル=31.79円、1スイス・フラン=113.49円、1トルコ・リラ=18.78円、1デンマーク・クローネ=16.42円、1ノルウェー・クローネ=12.40円、1スウェーデン・クローナ=11.65円、1メキシコ・ペソ=5.86円、1フィリピン・ペソ=2.19円、100チリ・ペソ=14.21円、100コロンビア・ペソ=3.37円、1カタール・リアル=30.12円、1サウジアラビア・リアル=29.41円、1インド・ルピー=1.57円、1パキスタン・ルピー=0.72円、100インドネシア・ルピア=0.81円、1アラブ首長国連邦・ディールハム=29.96円、1ブラジル・レアル=26.58円、1チェコ・コルナ=4.87円、100韓国・ウォン=9.58円、1オフショア・人民元=16.02円、1マレーシア・リングgit=27.16円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1タイ・バーツ=3.64円、1ポーランド・ズロチ=28.98円、100ハンガリー・フォリント=36.77円、1ユーロ=122.69円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年1月14日)現在

| 項 目                                  | 当 期 末                 |
|--------------------------------------|-----------------------|
| <b>(A) 資 産</b>                       | <b>4,292,610,031円</b> |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等                      | 137,774,438           |
| 国内株式パッシブ・ファンド<br>(最適化法)・マザーファンド(評価額) | 644,917,735           |
| 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 1,301,874,678         |
| 外国株式パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 651,856,213           |
| 外国債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 170,420,028           |
| エマージング株式パッシブ・<br>マザーファンド(評価額)        | 442,085,700           |
| エマージング債券パッシブ・<br>マザーファンド(評価額)        | 429,943,329           |
| J-R E I Tインデックスファンド・<br>マザーファンド(評価額) | 251,623,299           |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)     | 258,880,611           |
| 未 収 入 金                              | 3,234,000             |
| <b>(B) 負 債</b>                       | <b>14,249,751</b>     |
| 未 払 解 約 金                            | 6,722,005             |
| 未 払 信 託 報 酬                          | 7,446,019             |
| そ の 他 未 払 費 用                        | 81,727                |
| <b>(C) 純 資 産 総 額(A-B)</b>            | <b>4,278,360,280</b>  |
| 元 本                                  | 2,280,592,387         |
| 次 期 繰 越 損 益 金                        | 1,997,767,893         |
| <b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>               | <b>2,280,592,387口</b> |
| 1万口当たり基準価額(C/D)                      | 18,760円               |

(注) 期首における元本額は1,863,093,142円、当中における追加  
設定元本額は608,761,946円、同解約元本額は191,262,701  
円です。

## ■損益の状況

当期 自2019年1月12日 至2020年1月14日

| 項 目                         | 当 期                  |
|-----------------------------|----------------------|
| <b>(A) 配 当 等 収 益</b>        | <b>△74,709円</b>      |
| 受 取 利 息                     | 3,588                |
| 支 払 利 息                     | △78,297              |
| <b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>  | <b>437,514,140</b>   |
| 売 買 益                       | 457,181,783          |
| 売 買 損                       | △19,667,643          |
| <b>(C) 信 託 報 酬 等</b>        | <b>△13,810,674</b>   |
| <b>(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)</b> | <b>423,628,757</b>   |
| <b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>    | <b>22,731,503</b>    |
| <b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>  | <b>1,551,407,633</b> |
| (配 当 等 相 当 額)               | (1,136,248,381)      |
| (売 買 損 益 相 当 額)             | (415,159,252)        |
| <b>(G) 合 計(D+E+F)</b>       | <b>1,997,767,893</b> |
| <b>次 期 繰 越 損 益 金(G)</b>     | <b>1,997,767,893</b> |
| 追 加 信 託 差 損 益 金             | 1,551,407,633        |
| (配 当 等 相 当 額)               | (1,137,226,457)      |
| (売 買 損 益 相 当 額)             | (414,181,176)        |
| 分 配 準 備 積 立 金               | 446,360,260          |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて  
表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加  
設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

| 項 目                  | 当 期           |
|----------------------|---------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益      | 77,416,043円   |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 170,433,314   |
| (c) 収 益 調 整 金        | 1,551,407,633 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金    | 198,510,903   |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 1,997,767,893 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額    | 8,759.86      |
| (g) 分 配 金            | 0             |
| (h) 1万口当たり分配金        | 0             |

## DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30)

### ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額<br>(分配額)   |                 |               | 合 成<br>ベンチマーク   |      | 株式組入<br>比率 | 株式先物<br>比率 | 債券組入<br>比率 | 新株予約<br>権付社債<br>(転換社債)<br>比率 | 債券先物<br>比率 | 投資信託<br>受益証券<br>投資証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額    |
|----------------|-----------------|-----------------|---------------|-----------------|------|------------|------------|------------|------------------------------|------------|------------------------------|--------------|
|                | 円<br>税込み<br>分配金 | 円<br>期 中<br>騰落率 | %<br>ポ<br>イント | 円<br>期 中<br>騰落率 | %    |            |            |            |                              |            |                              |              |
| 4期(2016年1月12日) | 16,586          | 0               | △6.4          | 17,276.19       | △5.2 | 51.7       | 1.0        | 23.3       | —                            | —          | 16.9                         | 百万円<br>1,057 |
| 5期(2017年1月11日) | 18,583          | 0               | 12.0          | 19,657.42       | 13.8 | 52.6       | 1.5        | 24.2       | —                            | —          | 18.3                         | 1,555        |
| 6期(2018年1月11日) | 21,012          | 0               | 13.1          | 22,326.84       | 13.6 | 52.7       | 1.9        | 23.7       | —                            | —          | 18.1                         | 2,582        |
| 7期(2019年1月11日) | 19,213          | 0               | △8.6          | 20,609.81       | △7.7 | 53.1       | 3.0        | 27.2       | —                            | —          | 20.0                         | 4,022        |
| 8期(2020年1月14日) | 22,720          | 0               | 18.3          | 24,389.27       | 18.3 | 50.8       | 4.0        | 23.9       | —                            | —          | 18.1                         | 5,610        |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) △(白三角) はマイナスを意味しています(以下同じ)。

### ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日                | 基準価額     |          | 合 成<br>ベンチマーク |          | 株式組入<br>比率 | 株式先物<br>比率 | 債券組入<br>比率 | 新株予約<br>権付社債<br>(転換社債)<br>比率 | 債券先物<br>比率 | 投資信託<br>受益証券<br>投資証券<br>組入比率 |
|--------------------|----------|----------|---------------|----------|------------|------------|------------|------------------------------|------------|------------------------------|
|                    | 円<br>騰落率 | %<br>騰落率 | 円<br>騰落率      | %<br>騰落率 |            |            |            |                              |            |                              |
| (期首)<br>2019年1月11日 | 19,213   | —        | 20,609.81     | —        | 53.1       | 3.0        | 27.2       | —                            | —          | 20.0                         |
| 1月末                | 19,790   | 3.0      | 21,245.85     | 3.1      | 52.5       | 2.1        | 24.3       | —                            | —          | 18.6                         |
| 2月末                | 20,401   | 6.2      | 21,928.42     | 6.4      | 52.5       | 2.3        | 24.0       | —                            | —          | 18.3                         |
| 3月末                | 20,602   | 7.2      | 22,115.80     | 7.3      | 52.1       | 2.2        | 24.4       | —                            | —          | 18.4                         |
| 4月末                | 20,966   | 9.1      | 22,489.56     | 9.1      | 52.5       | 2.2        | 24.1       | —                            | —          | 18.2                         |
| 5月末                | 20,068   | 4.5      | 21,538.39     | 4.5      | 51.5       | 2.2        | 24.7       | —                            | —          | 18.6                         |
| 6月末                | 20,582   | 7.1      | 22,124.93     | 7.4      | 52.2       | 2.2        | 24.1       | —                            | —          | 18.4                         |
| 7月末                | 20,903   | 8.8      | 22,485.35     | 9.1      | 52.1       | 2.1        | 24.3       | —                            | —          | 18.6                         |
| 8月末                | 20,400   | 6.2      | 21,763.52     | 5.6      | 50.9       | 2.2        | 24.7       | —                            | —          | 18.9                         |
| 9月末                | 21,081   | 9.7      | 22,539.96     | 9.4      | 51.9       | 2.2        | 24.3       | —                            | —          | 18.8                         |
| 10月末               | 21,777   | 13.3     | 23,283.88     | 13.0     | 51.7       | 3.1        | 24.3       | —                            | —          | 18.4                         |
| 11月末               | 22,077   | 14.9     | 23,632.38     | 14.7     | 51.9       | 2.7        | 24.3       | —                            | —          | 18.5                         |
| 12月末               | 22,444   | 16.8     | 24,090.10     | 16.9     | 52.7       | 2.6        | 24.0       | —                            | —          | 18.2                         |
| (期末)<br>2020年1月14日 | 22,720   | 18.3     | 24,389.27     | 18.3     | 50.8       | 4.0        | 23.9       | —                            | —          | 18.1                         |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目          | 第8期                         |         | 項目の概要  |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
|             | (2019年1月12日<br>～2020年1月14日) |         |  |
|             | 金額                          | 比率      |  |
| (a) 信託報酬    | 86円                         | 0.410%  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は20,857円です。                     |
| (投信会社)      | ( 42)                       | (0.202) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価                             |
| (販売会社)      | ( 35)                       | (0.170) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価                     |
| (受託会社)      | ( 8)                        | (0.038) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価                                 |
| (b) 売買委託手数料 | 4                           | 0.018   | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料   |
| (株式)        | ( 3)                        | (0.013) |  |
| (先物・オプション)  | ( 1)                        | (0.003) |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                        | (0.000) |  |
| (投資証券)      | ( 0)                        | (0.002) |  |
| (c) 有価証券取引税 | 5                           | 0.024   | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>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)        | ( 4)                        | (0.019) |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                        | (0.000) |  |
| (投資証券)      | ( 1)                        | (0.005) |  |
| (d) その他費用   | 10                          | 0.047   | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  |
| (保管費用)      | ( 6)                        | (0.028) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用   |
| (監査費用)      | ( 1)                        | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用   |
| (その他)       | ( 3)                        | (0.015) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等   |
| 合計          | 104                         | 0.499   |  |

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

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

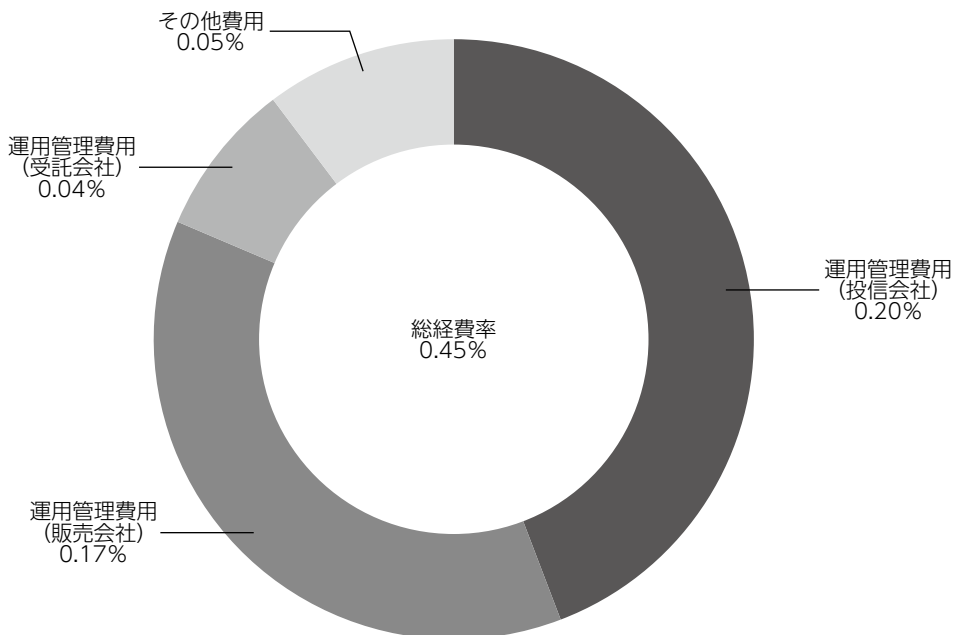
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・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口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.45%です。



(注1) 1万口当た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。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年1月12日から2020年1月14日まで）

|                                  | 当       |         | 期      |        |
|----------------------------------|---------|---------|--------|--------|
|                                  | 設 定     |         | 解 約    |        |
|                                  | □ 数     | 金 額     | □ 数    | 金 額    |
|                                  | 千□      | 千円      | 千□     | 千円     |
| 国内株式パッシブ・ファンド<br>(最適化法)・マザーファンド  | 87,265  | 217,561 | 17,650 | 45,648 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド        | 45,180  | 59,625  | -      | -      |
| 外国株式パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド        | 38,526  | 137,196 | 11,639 | 41,818 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド        | 31,214  | 58,054  | -      | -      |
| エマージング株式パッシブ・<br>マザーファンド         | 160,845 | 177,969 | 41,859 | 49,651 |
| エマージング債券パッシブ・<br>マザーファンド         | 68,201  | 135,132 | 8,319  | 16,265 |
| J-R E I T インデックス<br>ファンド・マザーファンド | 32,110  | 72,949  | 18,052 | 40,314 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド      | 59,017  | 78,740  | 3,191  | 4,122  |

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目               | 当                                   |                                  | 期                            |                                      |
|-------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|
|                   | 国内株式パッシブ・<br>ファンド(最適化法)・<br>マザーファンド | 外 国 株 式<br>パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド | エマージング株式<br>パッシブ・<br>マザーファンド | 外 国 リ ー ト ・<br>パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 142,039,995千円                       | 93,736,671千円                     | 71,468,817千円                 | 80,930千円                             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 256,149,281千円                       | 333,695,084千円                    | 48,000,584千円                 | 229千円                                |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.55                                | 0.28                             | 1.48                         | 352.31                               |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年1月12日から2020年1月14日まで）

【DIAMDC 8資産バランスファンド（新興国30）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                         | 当 期   |
|-----------------------------|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)       | 849千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 1千円   |
| (B)／(A)                     | 0.1%  |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組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。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期<br>区 分 | 当             |                    |          | 期             |                    |          |
|--------------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
|              | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 株 式          | 百万円<br>52,178 | 百万円<br>24          | %<br>0.0 | 百万円<br>89,861 | 百万円<br>5,933       | %<br>6.6 |

平均保有割合 0.4%

(注) 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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当          |            | 期            |
|-----|------------|------------|--------------|
|     | 買 付 額      | 売 付 額      | 当 期 末 保 有 額  |
| 株 式 | 百万円<br>449 | 百万円<br>848 | 百万円<br>2,512 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当     | 期         |
|-----|-------|-----------|
|     | 買 付 額 | 買 付 額     |
| 株 式 |       | 百万円<br>98 |

## 【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期<br>区 分 | 当 期            |                    |          | 期              |                    |           |
|--------------|----------------|--------------------|----------|----------------|--------------------|-----------|
|              | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C       |
| 公 社 債        | 百万円<br>104,200 | 百万円<br>10,037      | %<br>9.6 | 百万円<br>193,140 | 百万円<br>20,664      | %<br>10.7 |

平均保有割合 0.1%

(注) 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。

## 【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期<br>区 分 | 当 期           |                    |          | 期             |                    |          |
|--------------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
|              | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 投 資 証 券      | 百万円<br>52,628 | 百万円<br>467         | %<br>0.9 | 百万円<br>50,828 | 百万円<br>414         | %<br>0.8 |

平均保有割合 1.2%

(注) 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。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類     | 当 期          |
|---------|--------------|
|         | 買 付 額        |
| 投 資 証 券 | 百万円<br>2,217 |

## 【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

### ■組入資産の明細

#### 親投資信託残高

|                             | 期首（前期末） | 当 期 末   |           |
|-----------------------------|---------|---------|-----------|
|                             | □ 数     | □ 数     | 評 価 額     |
|                             | 千□      | 千□      | 千円        |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 335,172 | 404,786 | 1,115,309 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 161,069 | 206,249 | 270,991   |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 249,535 | 276,422 | 1,134,796 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 113,004 | 144,218 | 275,168   |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 560,502 | 679,488 | 871,716   |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 338,305 | 398,187 | 833,724   |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 193,573 | 207,630 | 493,059   |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 305,200 | 361,025 | 505,869   |

## ■投資信託財産の構成

2020年1月14日現在

| 項 目                         | 当 期 末     |       |
|-----------------------------|-----------|-------|
|                             | 評 価 額     | 比 率   |
|                             | 千円        | %     |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 1,115,309 | 19.8  |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 270,991   | 4.8   |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 1,134,796 | 20.1  |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 275,168   | 4.9   |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド        | 871,716   | 15.5  |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド        | 833,724   | 14.8  |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 493,059   | 8.8   |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド     | 505,869   | 9.0   |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他     | 134,167   | 2.4   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額             | 5,634,803 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2020年1月14日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは362,138,450千円、100.0％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは133,792,129千円、99.7％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは61,156,813千円、99.9％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは137,668,461千円、97.7％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは41,480,172千円、99.6％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2020年1月14日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.16円、1カナダ・ドル=84.39円、1オーストラリア・ドル=76.05円、1香港・ドル=14.17円、1シンガポール・ドル=81.86円、1ニュージーランド・ドル=72.98円、1台湾・ドル=3.68円、1イギリス・ポンド=143.16円、1イスラエル・シユケル=31.79円、1スイス・フラン=113.49円、1トルコ・リラ=18.78円、1デンマーク・クローネ=16.42円、1ノルウェー・クローネ=12.40円、1スウェーデン・クローナ=11.65円、1メキシコ・ペソ=5.86円、1フィリピン・ペソ=2.19円、100チリ・ペソ=14.21円、100コロンビア・ペソ=3.37円、1カタール・リアル=30.12円、1サウジアラビア・リアル=29.41円、1インド・ルピー=1.57円、1パキスタン・ルピー=0.72円、100インドネシア・ルピア=0.81円、1アラブ首長国連邦・ディールハム=29.96円、1ブラジル・リアル=26.58円、1チェコ・コルナ=4.87円、100韓国・ウォン=9.58円、1オフショア・人民元=16.02円、1マレーシア・リングギット=27.16円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1タイ・バーツ=3.64円、1ポーランド・ズロチ=28.98円、100ハンガリー・フォリント=36.77円、1ユーロ=122.69円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年1月14日)現在

| 項 目                                  | 当 期 末                 |
|--------------------------------------|-----------------------|
| <b>(A) 資 産</b>                       | <b>5,634,803,871円</b> |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等                      | 134,167,312           |
| 国内株式パッシブ・ファンド<br>(最適化法)・マザーファンド(評価額) | 1,115,309,389         |
| 国内債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 270,991,826           |
| 外国株式パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 1,134,796,841         |
| 外国債券パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)       | 275,168,430           |
| エマージング株式パッシブ・<br>マザーファンド(評価額)        | 871,716,293           |
| エマージング債券パッシブ・<br>マザーファンド(評価額)        | 833,724,572           |
| J-R E I Tインデックスファンド・<br>マザーファンド(評価額) | 493,059,830           |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・<br>マザーファンド(評価額)     | 505,869,378           |
| <b>(B) 負 債</b>                       | <b>24,015,804</b>     |
| 未 払 解 約 金                            | 13,354,569            |
| 未 払 信 託 報 酬                          | 10,554,623            |
| そ の 他 未 払 費 用                        | 106,612               |
| <b>(C) 純 資 産 総 額(A-B)</b>            | <b>5,610,788,067</b>  |
| 元 本                                  | 2,469,566,123         |
| 次 期 繰 越 損 益 金                        | 3,141,221,944         |
| <b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>               | <b>2,469,566,123口</b> |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)              | 22,720円               |

## ■損益の状況

当期 自2019年1月12日 至2020年1月14日

| 項 目                         | 当 期                  |
|-----------------------------|----------------------|
| <b>(A) 配 当 等 収 益</b>        | <b>△67,092円</b>      |
| 受 取 利 息                     | 5,429                |
| 支 払 利 息                     | △72,521              |
| <b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>  | <b>765,479,973</b>   |
| 売 買 益                       | 818,751,331          |
| 売 買 損                       | △53,271,358          |
| <b>(C) 信 託 報 酬 等</b>        | <b>△19,589,585</b>   |
| <b>(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)</b> | <b>745,823,296</b>   |
| <b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>    | <b>△4,191,685</b>    |
| <b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>  | <b>2,399,590,333</b> |
| (配 当 等 相 当 額)               | (1,695,929,593)      |
| (売 買 損 益 相 当 額)             | (703,660,740)        |
| <b>(G) 合 計(D+E+F)</b>       | <b>3,141,221,944</b> |
| <b>次 期 繰 越 損 益 金(G)</b>     | <b>3,141,221,944</b> |
| 追 加 信 託 差 損 益 金             | 2,399,590,333        |
| (配 当 等 相 当 額)               | (1,697,697,194)      |
| (売 買 損 益 相 当 額)             | (701,893,139)        |
| 分 配 準 備 積 立 金               | 741,631,611          |

(注) 期首における元本額は2,093,469,366円、当中における追加設定元本額は729,100,474円、同解約元本額は353,003,717円です。

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

| 項 目                          | 当 期           |
|------------------------------|---------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益              | 129,112,796円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益          | 300,383,991   |
| (c) 収 益 調 整 金                | 2,399,590,333 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金            | 312,134,824   |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)   | 3,141,221,944 |
| (f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額 | 12,719.73     |
| (g) 分 配 金                    | 0             |
| (h) 1 万 口 当 たり 分 配 金         | 0             |

# 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2019年2月7日）

（計算期間 2018年2月8日～2019年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第17期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。

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 2002年10月30日から無期限です。   |
| 運用方針   | 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。  |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。  |

## ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |      | 東証株価指数(TOPIX)    |      | 株式組入率<br>比 | 株式先物率<br>比 | 純資産額    |
|-----------------|--------|------|------------------|------|------------|------------|---------|
|                 | 期騰落率   | 期中率  | (配当込み)<br>ベンチマーク | 期中率  |            |            |         |
| 13期 (2015年2月9日) | 円      | %    | ポイント             | %    | %          | %          | 百万円     |
| 13期 (2015年2月9日) | 20,237 | 22.2 | 1,949.47         | 22.3 | 99.0       | 0.9        | 324,677 |
| 14期 (2016年2月8日) | 19,981 | △1.3 | 1,925.17         | △1.2 | 98.2       | 1.7        | 286,897 |
| 15期 (2017年2月7日) | 22,429 | 12.3 | 2,161.36         | 12.3 | 97.6       | 2.3        | 284,249 |
| 16期 (2018年2月7日) | 26,432 | 17.8 | 2,547.46         | 17.9 | 98.1       | 0.8        | 289,238 |
| 17期 (2019年2月7日) | 24,228 | △8.3 | 2,334.81         | △8.3 | 98.5       | 1.5        | 279,184 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。



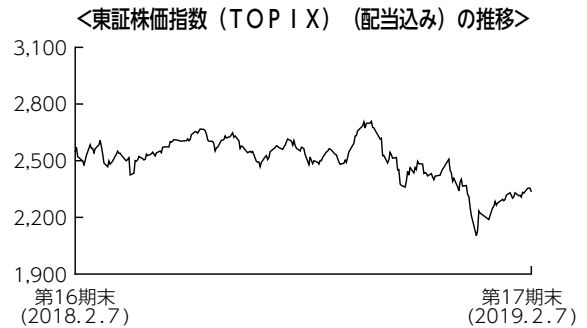
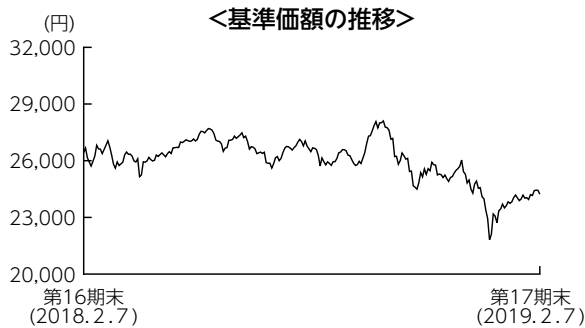
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                  | 基 準 価 額 |        | 東証株価指数(TOPIX)              |        | 株式組入率     | 株式先物率    |
|------------------------|---------|--------|----------------------------|--------|-----------|----------|
|                        | 円       | 騰 落 率  | (配当込み)<br>(ベンチマーク)<br>ポイント | 騰 落 率  |           |          |
| (期 首)<br>2018年 2 月 7 日 | 26,432  | %<br>- | 2,547.46                   | %<br>- | %<br>98.1 | %<br>0.8 |
| 2 月 末                  | 26,718  | 1.1    | 2,574.87                   | 1.1    | 97.9      | 2.7      |
| 3 月 末                  | 26,174  | △1.0   | 2,522.26                   | △1.0   | 95.2      | 4.6      |
| 4 月 末                  | 27,108  | 2.6    | 2,611.85                   | 2.5    | 98.4      | 1.5      |
| 5 月 末                  | 26,665  | 0.9    | 2,568.21                   | 0.8    | 97.4      | 2.2      |
| 6 月 末                  | 26,446  | 0.1    | 2,548.78                   | 0.1    | 96.3      | 3.7      |
| 7 月 末                  | 26,787  | 1.3    | 2,581.96                   | 1.4    | 96.4      | 3.6      |
| 8 月 末                  | 26,523  | 0.3    | 2,556.25                   | 0.3    | 95.9      | 4.0      |
| 9 月 末                  | 28,001  | 5.9    | 2,698.09                   | 5.9    | 97.4      | 2.5      |
| 10 月 末                 | 25,366  | △4.0   | 2,444.11                   | △4.1   | 96.4      | 3.7      |
| 11 月 末                 | 25,703  | △2.8   | 2,475.92                   | △2.8   | 97.2      | 2.7      |
| 12 月 末                 | 23,069  | △12.7  | 2,223.11                   | △12.7  | 95.9      | 4.5      |
| 2019年 1 月 末            | 24,204  | △8.4   | 2,332.52                   | △8.4   | 98.5      | 1.5      |
| (期 末)<br>2019年 2 月 7 日 | 24,228  | △8.3   | 2,334.81                   | △8.3   | 98.5      | 1.5      |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年2月8日から2019年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は24,228円となり、前期末に比べ8.3%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

米中貿易摩擦の激化、米国トランプ大統領の保護貿易主義の高まり、世界景気の減速懸念、米国長期金利の上昇などを要因に国内株式市場が下落したことから、基準価額は下落しました。

### 投資環境

期初から2018年3月下旬にかけては、円高進行、米国株安、安倍政権の不安定さなどを嫌気し、国内株式市場は下落しました。その後は、米中貿易摩擦、為替動向、シリアや北朝鮮などの地政学リスクなどの動向次第で、一進一退の展開となりました。10月以降は、米国長期金利の上昇を受けて米国株式が下落したこと、世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の激化などを嫌気し、国内株式市場は急落しました。しかし、期末にかけては大幅下落の反動もあり、やや値を戻しました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

**【運用状況】** (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。  
 (注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

○組入上位10業種  
 期首 (前期末)

| No. | 業種     | 比率    |
|-----|--------|-------|
| 1   | 電気機器   | 13.7% |
| 2   | 輸送用機器  | 9.0   |
| 3   | 銀行業    | 7.4   |
| 4   | 情報・通信業 | 7.1   |
| 5   | 化学     | 7.0   |
| 6   | 機械     | 5.6   |
| 7   | 卸売業    | 4.6   |
| 8   | 小売業    | 4.6   |
| 9   | 医薬品    | 4.4   |
| 10  | 食料品    | 4.2   |



期末

| No. | 業種     | 比率    |
|-----|--------|-------|
| 1   | 電気機器   | 12.8% |
| 2   | 情報・通信業 | 8.2   |
| 3   | 輸送用機器  | 8.0   |
| 4   | 化学     | 7.2   |
| 5   | 銀行業    | 6.3   |
| 6   | 医薬品    | 5.3   |
| 7   | 卸売業    | 5.0   |
| 8   | 機械     | 4.9   |
| 9   | 小売業    | 4.8   |
| 10  | サービス業  | 4.7   |

○組入上位10銘柄  
 期首 (前期末)

| No.   | 銘柄名               | 通貨      | 比率   |
|-------|-------------------|---------|------|
| 1     | トヨタ自動車            | 日本・円    | 3.5% |
| 2     | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本・円    | 2.2  |
| 3     | ソフトバンクグループ        | 日本・円    | 1.5  |
| 4     | ソニー               | 日本・円    | 1.4  |
| 5     | 三井住友フィナンシャルグループ   | 日本・円    | 1.4  |
| 6     | 日本電信電話            | 日本・円    | 1.4  |
| 7     | 本田技研工業            | 日本・円    | 1.4  |
| 8     | キーエンス             | 日本・円    | 1.2  |
| 9     | 任天堂               | 日本・円    | 1.1  |
| 10    | みずほフィナンシャルグループ    | 日本・円    | 1.0  |
| 組入銘柄数 |                   | 2,049銘柄 |      |



期末

| No.   | 銘柄名               | 通貨      | 比率   |
|-------|-------------------|---------|------|
| 1     | トヨタ自動車            | 日本・円    | 3.2% |
| 2     | ソフトバンクグループ        | 日本・円    | 1.8  |
| 3     | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本・円    | 1.7  |
| 4     | ソニー               | 日本・円    | 1.4  |
| 5     | 日本電信電話            | 日本・円    | 1.4  |
| 6     | キーエンス             | 日本・円    | 1.3  |
| 7     | 武田薬品工業            | 日本・円    | 1.2  |
| 8     | 三井住友フィナンシャルグループ   | 日本・円    | 1.2  |
| 9     | 本田技研工業            | 日本・円    | 1.1  |
| 10    | みずほフィナンシャルグループ    | 日本・円    | 1.0  |
| 組入銘柄数 |                   | 2,113銘柄 |      |

**ベンチマークとの差異について**

ベンチマークは前期末比で8.3%下落しました。  
 当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

**今後の運用方針**

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目                                | 当 期              |                              |
|------------------------------------|------------------|------------------------------|
|                                    | 金 額              | 比 率                          |
| (a) 売買委託手数料<br>(株 式)<br>(先物・オプション) | 0円<br>(0)<br>(0) | 0.001%<br>(0.000)<br>(0.001) |
| (b) そ の 他 費 用<br>(そ の 他)           | 0<br>(0)         | 0.000<br>(0.000)             |
| 合 計                                | 0                | 0.001                        |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,984円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については13ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (2018年2月8日から2019年2月7日まで)

### (1) 株 式

|         |  | 買 付                      |                   | 売 付        |            |
|---------|--|--------------------------|-------------------|------------|------------|
|         |  | 株 数                      | 金 額               | 株 数        | 金 額        |
| 国 内 上 場 |  | 千株                       | 千円                | 千株         | 千円         |
|         |  | 26,354.1<br>(△6,682.321) | 50,317,509<br>(-) | 14,521.779 | 31,359,523 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、株式分割、増資割当および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。

### (2) 先物取引の種類別取引状況

| 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<br>100,959 | 百万円<br>98,142 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

(注) 金額は受渡代金です。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目                           | 当 期           |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額         | 81,677,032千円  |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 281,533,266千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)         | 0.29          |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2018年2月8日から2019年2月7日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

| 区 分 | 当 期           |                    |        | 期             |                    |          |
|-----|---------------|--------------------|--------|---------------|--------------------|----------|
|     | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A    | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 株 式 | 百万円<br>50,317 | 百万円<br>-           | %<br>- | 百万円<br>31,359 | 百万円<br>5           | %<br>0.0 |

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期        |            |              |
|-----|------------|------------|--------------|
|     | 買 付 額      | 売 付 額      | 当 期 末 保 有 額  |
| 株 式 | 百万円<br>502 | 百万円<br>273 | 百万円<br>2,902 |

### (3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期       |
|-----|-----------|
|     | 買 付 額     |
| 株 式 | 百万円<br>55 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、オリエントコーポレーションです。

# ■組入資産の明細

## (1) 国内株式

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       |         | 当 期 末 |       |         | 銘柄                | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末                |       |       | 銘柄        | 期首(前期末) |     |       | 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 |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         | 千株    | 千円      |       | 千株    | 千円      | 北野建設              | 27      | 2.9   | 9,193     | 昭和産業                 | 10.4  | 11.4  | 33,812    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 極洋                   | 5       | 5.4   | 15,206  |       | 5.4   | 15,206  | 植木組               | 1.6     | 1.8   | 4,060     | 鳥越製粉                 | 10.1  | 11.1  | 8,746     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 日本水産                 | 143     | 166.5 | 122,710 |       | 166.5 | 122,710 | 三井ホーム             | 16      | -     | -         | 中部飼料                 | 13.9  | 15    | 16,920    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| マルハニチロ               | 24.1    | 24.1  | 87,121  |       | 24.1  | 87,121  | 矢作建設工業            | 17.3    | 18.8  | 13,742    | フィード・ワン              | 76.6  | 83    | 14,442    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| カネコ種苗                | 4.4     | 4.6   | 6,035   |       | 4.6   | 6,035   | ビーエス三菱            | 15.1    | 14.5  | 8,352     | 東洋精糖                 | 2     | 2     | 2,179     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| サカタのタネ               | 18.8    | 20.2  | 73,023  |       | 20.2  | 73,023  | 日本ハウスホールディングス     | 24.3    | 26.2  | 11,397    | 日本甜菜製糖               | 6.5   | 7     | 12,341    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ホクト                  | 12.9    | 14    | 27,412  |       | 14    | 27,412  | 大東建設              | 46      | 49    | 745,780   | 三井製糖                 | 9     | 9.7   | 27,994    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ホクリヨウ                | 1.6     | 2.3   | 1,405   |       | 2.3   | 1,405   | 新日本建設             | 15.1    | 16.4  | 17,941    | 塩水港精糖                | 13.7  | 14.4  | 3,182     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| <b>鉱業 (0.3%)</b>     |         |       |         |       |       |         | NIPPO             | 29.4    | 36.4  | 76,076    | 日新製糖                 | 5.4   | 5.8   | 11,814    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 住石ホールディングス           | 33.7    | 35.9  | 3,590   |       | 35.9  | 3,590   | 東亜道路工業            | 2.6     | 2.6   | 8,008     | 森永製菓                 | 26.7  | 31    | 140,895   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 日鉄鉱業                 | 3.5     | 3.9   | 18,271  |       | 3.9   | 18,271  | 前田道路              | 40      | 43.1  | 93,096    | 中村屋                  | 2.9   | 3     | 12,780    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 三井鉱山ホールディングス         | 6.5     | 6.9   | 9,694   |       | 6.9   | 9,694   | 日本道路              | 3.4     | 3.8   | 24,206    | 江崎グリコ                | 31.8  | 36.9  | 205,164   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 国際石油開発帝石             | 617.8   | 668.6 | 678,629 |       | 668.6 | 678,629 | 東亜建設工業            | 10.3    | 12.1  | 17,327    | 名糖産業                 | 5.5   | 5.9   | 8,419     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 日本海洋掘削               | 4.4     | -     | -       |       | -     | -       | 若築建設              | 6.9     | 6.9   | 10,094    | 井村屋グループ              | 4.5   | 5.2   | 12,698    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 石油資源開発               | 20.1    | 24    | 49,728  |       | 24    | 49,728  | 東洋建設              | 39.9    | 50.3  | 20,723    | 不二家                  | 7.3   | 6.9   | 15,635    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| K&Oエナジーグループ          | 7.5     | 8     | 11,664  |       | 8     | 11,664  | 五洋建設              | 151.1   | 163.3 | 102,552   | 山崎製パン                | 93.1  | 100.8 | 216,115   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| <b>建設業 (2.9%)</b>    |         |       |         |       |       |         | 世紀東急工業            | 17.2    | 20.1  | 12,341    | 第一屋製パン               | 2     | 2.1   | 2,137     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ヒノキヤグループ             | -       | 3.5   | 7,122   |       | 3.5   | 7,122   | 福田組               | 4.1     | 4.5   | 19,530    | モロゾフ                 | 1.9   | 2     | 9,800     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ショボンドホールディングス        | 12      | 11.9  | 93,415  |       | 11.9  | 93,415  | 住友林業              | 81.2    | 97.5  | 136,890   | 亀田製菓                 | 7.1   | 7.6   | 39,140    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ミライト・ホールディングス        | 39.1    | 46.9  | 75,978  |       | 46.9  | 75,978  | 日本基礎技術            | 14.2    | 14.4  | 4,867     | 寿スベリッツ               | 11    | 13    | 55,445    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| タマホーム                | 9.6     | 10.3  | 12,174  |       | 10.3  | 12,174  | 日成ビルド工業           | 18.8    | -     | -         | カルビ                  | 51.8  | 56.1  | 175,873   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| サンヨーホームズ             | 2.3     | 2.5   | 2,092   |       | 2.5   | 2,092   | ヤマダ・エスバイエルホーム     | 58      | -     | -         | 森永乳業                 | 22.8  | 24.6  | 77,490    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 日本アーク                | 4       | 4.1   | 1,767   |       | 4.1   | 1,767   | BCOコーポレーション       | 15.9    | 17.1  | 6,805     | 六甲バター                | 5.7   | 9     | 17,874    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ファーストコーポレーション        | 4.3     | 4.6   | 3,491   |       | 4.6   | 3,491   | 大和ハウス工業           | 375.3   | 380.8 | 1,287,484 | ヤクルト本社               | 68.1  | 91.3  | 648,230   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ベステラ                 | 1.8     | 3.2   | 4,272   |       | 3.2   | 4,272   | ライト工業             | 24.5    | 26.4  | 35,904    | 明治ホールディングス           | 75.3  | 87.2  | 721,144   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| TATERU               | 11.2    | 20.2  | 5,959   |       | 20.2  | 5,959   | 積水ハウス             | 413.3   | 420.8 | 679,381   | 雪印メグミルク              | 27.4  | 29.6  | 77,788    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| スペースリゾールホールディングス     | -       | 20.3  | 19,325  |       | 20.3  | 19,325  | 日特建設              | 10.9    | 11.8  | 7,363     | プリマハム                | 80    | 17.3  | 34,669    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ダイセキ環境ソリューション        | 3       | 3.2   | 2,051   |       | 3.2   | 2,051   | 北陸電気工事            | 7.1     | 6.7   | 6,036     | 日本ハム                 | 98    | 53.2  | 230,888   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 第一カッター興業             | 1.3     | 1.9   | 3,562   |       | 1.9   | 3,562   | ユアテック             | 20      | 22.1  | 19,934    | 林業産業                 | 4.1   | 4.3   | 2,494     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 安藤・間                 | 97.8    | 106.4 | 80,757  |       | 106.4 | 80,757  | 西部電気工業            | 2.1     | -     | -         | 丸大食品                 | 6.1   | 13.3  | 24,312    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 東急建設                 | 48.9    | 48.8  | 47,775  |       | 48.8  | 47,775  | 四電工               | 1.9     | 2     | 5,334     | S Foods              | 8     | 11.1  | 43,734    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| コムシホールディングス          | 44.7    | 59.1  | 165,361 |       | 59.1  | 165,361 | 中電工               | 16.4    | 17.6  | 40,180    | 伊藤ハム株式会社ホールディングス     | 73.3  | 79.3  | 49,959    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ミサワホーム               | 10.6    | 13.1  | 9,589   |       | 13.1  | 9,589   | 関電工               | 50.6    | 62.6  | 62,224    | サッポロホールディングス         | 41.6  | 45.1  | 111,938   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ビーホールホールディングス        | 12.6    | 13.8  | 4,899   |       | 13.8  | 4,899   | きんでん              | 84.5    | 91.5  | 161,314   | アサヒグループホールディングス      | 238.4 | 257.9 | 1,220,382 |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 藤松コンストラクショナルグループ     | 8.2     | 10.3  | 28,644  |       | 10.3  | 28,644  | 東京エネシス            | 14.4    | 14.2  | 14,498    | キリンホールディングス          | 547   | 557.2 | 1,474,908 |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 東建コーポレーション           | 4.7     | 5.1   | 32,895  |       | 5.1   | 32,895  | トーエネック            | 3.6     | 3.8   | 12,331    | 宝ホールディングス            | 85.2  | 92.2  | 111,746   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ソネット                 | 1.6     | 1.8   | 1,258   |       | 1.8   | 1,258   | 住友電設              | 10.1    | 9.5   | 17,052    | オノンホールディングス          | 32.5  | 35.2  | 12,672    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ヤマウラ                 | 6       | 6.5   | 6,305   |       | 6.5   | 6,305   | 日本電設工業            | 19.5    | 23.5  | 53,298    | 養命酒製造                | 3.5   | 3.9   | 8,034     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 大成建設                 | 126.5   | 136.8 | 663,480 |       | 136.8 | 663,480 | 協和エクシオ            | 45.6    | 53.8  | 145,582   | コトコロ ホテラズ(株)ホールディングス | 79.9  | 94.3  | 322,977   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 大林組                  | 381     | 412.3 | 419,309 |       | 412.3 | 419,309 | 新日本空調             | 9.8     | 11.7  | 21,258    | サントリー食品インターナショナル     | 87    | 82.4  | 401,700   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 清水建設                 | 388.6   | 420.5 | 388,962 |       | 420.5 | 388,962 | NDS               | 2       | -     | -         | ダイドールグループホールディングス    | 5.8   | 6.9   | 36,432    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 飛鳥建設                 | 115.9   | 11.8  | 17,133  |       | 11.8  | 17,133  | 九電工               | 25.1    | 27    | 106,245   | 伊藤園                  | 37.7  | 37.4  | 188,496   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 長谷工コーポレーション          | 148.3   | 171.9 | 206,623 |       | 171.9 | 206,623 | 三機工業              | 26.9    | 31.6  | 35,676    | キーコーヒー               | 11.2  | 12.2  | 24,668    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 松井建設                 | 14      | 15.2  | 11,020  |       | 15.2  | 11,020  | 日揮                | 109.4   | 118.4 | 191,808   | ユニカフェ                | 3.5   | 3.9   | 3,900     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 銭高組                  | 1.8     | 1.8   | 9,594   |       | 1.8   | 9,594   | 中外炉工業             | 3.9     | 3.9   | 8,162     | ジャパンフーズ              | 1.6   | 1.8   | 2,181     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 鹿島建設                 | 558     | 322.2 | 494,899 |       | 322.2 | 494,899 | ヤマト               | 10.5    | 12.4  | 5,753     | 日清オイリオグループ           | 13.4  | 15.9  | 50,562    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 不動テトラ                | 96.5    | 9.4   | 15,820  |       | 9.4   | 15,820  | 太平電業              | 8.6     | 9.3   | 22,905    | 不二製油グループ本社           | 30.8  | 30.1  | 108,661   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 大末建設                 | 4.1     | 4.9   | 4,630   |       | 4.9   | 4,630   | 高砂熱学工業            | 35      | 34.6  | 58,197    | かどや製油                | 1.2   | 1.3   | 6,526     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 鉄建建設                 | 7.7     | 8.3   | 22,119  |       | 8.3   | 22,119  | 三晃金属工業            | 1.4     | 1.5   | 4,378     | J-オイルミルズ             | 5.9   | 6.4   | 25,696    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 西松建設                 | 29.3    | 29.6  | 75,835  |       | 29.6  | 75,835  | 朝日工業社             | 2.6     | 2.7   | 8,262     | キッコーマン               | 88.9  | 81.3  | 418,695   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 三井住友建設               | 91.6    | 99.1  | 68,379  |       | 99.1  | 68,379  | 明星工業              | 23      | 24.9  | 16,932    | 味の素                  | 261.7 | 271.9 | 449,314   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 大豊建設                 | 46      | 9.3   | 32,689  |       | 9.3   | 32,689  | 大気社               | 16.8    | 18.8  | 53,486    | キユーピー                | 63.4  | 68.6  | 170,608   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 前田建設工業               | 90.6    | 98.1  | 106,732 |       | 98.1  | 106,732 | ダイダ               | 8.5     | 9.2   | 22,650    | ハウス食品グループ本社          | 43.4  | 47    | 187,295   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 佐田建設                 | 8.4     | 8.8   | 3,361   |       | 8.8   | 3,361   | 日比谷総合設備           | 14.2    | 13.1  | 23,855    | カゴメ                  | 45.6  | 49.4  | 139,406   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| ナカノフードー建設            | 9.7     | 10.5  | 5,481   |       | 10.5  | 5,481   | 東芝プラントシステム        | 27.5    | 29.7  | 58,509    | 焼津水産化学工業             | 5.5   | 6.1   | 6,581     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 奥村組                  | 20.9    | 22.6  | 77,066  |       | 22.6  | 77,066  | OSJホールディングス       | 56.3    | 60.8  | 18,118    | アリアケジャパン             | 10.4  | 11.3  | 79,213    |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 東鉄工業                 | 15.3    | 16.5  | 48,691  |       | 16.5  | 48,691  | 東洋エンジニアリング        | 15      | 16.2  | 12,295    | ビエトロ                 | 1.5   | 1.6   | 2,616     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| イチケン                 | 2.3     | 2.6   | 5,166   |       | 2.6   | 5,166   | 千代田化工建設           | 82.5    | 99.1  | 33,297    | エバラ食品工業              | 2.5   | 2.6   | 5,675     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 富士ピー・エス              | -       | 4.3   | 2,214   |       | 4.3   | 2,214   | 新興プランテック          | 24.5    | 24.7  | 31,023    | ニチレイ                 | 54.2  | 64    | 171,008   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 浅沼組                  | 45      | 4.9   | 14,523  |       | 4.9   | 14,523  | <b>食料品 (4.3%)</b> |         |       |           | 東洋水産                 | 62.4  | 63.3  | 258,264   |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 戸田建設                 | 148     | 159.8 | 112,499 |       | 159.8 | 112,499 | 日本製粉              | 37.7    | 40.9  | 75,746    | イトーアンド               | 3.2   | 4.3   | 7,030     |         | 千株  | 千円    |       | 千株  | 千円    |
| 熊谷組                  | 19.     |       |         |       |       |         |                   |         |       |           |                      |       |       |           |         |     |       |       |     |       |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 当 期 末     |       | 銘柄               | 期首(前期末) |       | 当 期 末     |       | 銘柄               | 期首(前期末) |       | 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    |           | 千円    |                  |         | 千株    |           | 千円    |                  |         | 千株    |           | 千円    |
| 日清食品ホールディングス        | 49.6    | 52.4  | 383,044   |       | レンゴー             | 114.5   | 124   | 114,824   |       | ミライアル            | 3.9     | 3.5   | 3,993     |       |
| 永谷園ホールディングス         | 12      | 6.6   | 15,919    |       | トモク              | 6.8     | 7.4   | 11,766    |       | ダイキョウクス          | 4       | 4.3   | 4,145     |       |
| 一正蒲鉾                | 4.4     | 4.9   | 5,081     |       | ザ・パック            | 8.4     | 9.1   | 27,982    |       | ダイキョーニシカフ        | 23.4    | 25.4  | 29,718    |       |
| フジッコ                | 12.3    | 13.4  | 30,471    |       | <b>化学 (7.3%)</b> |         |       |           |       | 竹本容器             | 1.3     | 4.3   | 6,054     |       |
| ロック・フィールド           | 12.3    | 13.4  | 20,595    |       | クラレ              | 199.9   | 202.9 | 331,944   |       | 森六ホールディングス       | 4.5     | 6.5   | 16,542    |       |
| 日本たばこ産業             | 704.1   | 711.1 | 1,938,814 |       | 旭化成              | 740.7   | 855   | 986,242   |       | 日本化薬             | 77.1    | 76.4  | 98,097    |       |
| ケンコーマヨネーズ           | 7.5     | 6.9   | 14,545    |       | 昭和レザー            | 6.9     | 7.5   | 5,467     |       | カールトホールディングス     | 11      | 12.8  | 10,393    |       |
| からばや日洋ホールディングス      | 7.5     | 8     | 14,992    |       | 昭和電工             | 79.1    | 79.8  | 285,684   |       | 日本精化             | 9.9     | 9.7   | 10,864    |       |
| なとり                 | 6.4     | 6.9   | 11,212    |       | 住友化学             | 874     | 946   | 518,408   |       | 扶桑化学工業           | 8.4     | 12.2  | 25,144    |       |
| イフジ産業               | 2       | 2.1   | 1,386     |       | 住友精化             | 4.9     | 5.8   | 24,766    |       | トリケミカル研究所        | -       | 2.7   | 12,879    |       |
| ピュウスクーパーション         | 1.7     | 3     | 6,078     |       | 日産化学             | 69.1    | 73.8  | 408,852   |       | A D E K A        | 51.1    | 59.3  | 100,572   |       |
| 北の達人コーポレーション        | 10.9    | 48.4  | 19,698    |       | ラサ工業             | 4.2     | 4.3   | 5,921     |       | 日油               | 45.9    | 46.2  | 165,627   |       |
| ユープレナ               | 43.9    | 48.9  | 29,095    |       | クラレハ             | 10.3    | 11.1  | 74,148    |       | 新日本理化            | 18.9    | 21.9  | 4,182     |       |
| ミヨシ油脂               | 4.4     | 5     | 5,240     |       | 多木化学             | 1.6     | 3.4   | 18,394    |       | ハリマ化成グループ        | 9.2     | 10    | 10,960    |       |
| 理研ビタミン              | 4.3     | 5.8   | 20,242    |       | テイカ              | 9.1     | 9.8   | 19,649    |       | 花王               | 278.8   | 297.9 | 2,397,797 |       |
| <b>繊維製品 (0.7%)</b>  |         |       |           |       | 石原産業             | 21.3    | 23.2  | 25,404    |       | 第一工業製薬           | 23      | 4.5   | 12,613    |       |
| 片倉工業                | 13.7    | 14.8  | 17,197    |       | 片倉コープアグリ         | 2.9     | 3     | 3,507     |       | 石原ケミカル           | -       | 3.1   | 5,499     |       |
| グンゼ                 | 8.9     | 8     | 41,440    |       | 日東エフシー           | 6.9     | 7.7   | 5,882     |       | 日華化学             | 3.8     | 4     | 3,796     |       |
| 東洋紡                 | 43.9    | 50.8  | 82,804    |       | 日本曹達             | 82      | 19    | 56,468    |       | ニイタカ             | 1.7     | 1.9   | 2,846     |       |
| ユニチカ                | 34.6    | 35.2  | 17,283    |       | 東ソー              | 171.7   | 185.7 | 291,734   |       | 三洋化成工業           | 7.5     | 8     | 40,720    |       |
| 富士紡ホールディングス         | 6.6     | 6.3   | 17,671    |       | トクヤマ             | 34.5    | 34.6  | 97,987    |       | 有機合成薬品工業         | 8       | 8.3   | 1,726     |       |
| 倉敷紡績                | 120     | 11.5  | 27,128    |       | セントラル硝子          | 24.2    | 26.2  | 65,788    |       | 大日本塗料            | 13.6    | 13.7  | 14,385    |       |
| シキボウ                | 6       | 6.3   | 6,552     |       | 東亞合成             | 69.7    | 75.4  | 95,607    |       | 日本ペイントホールディングス   | 91.7    | 99.1  | 367,661   |       |
| 日本毛織                | 33.4    | 39.4  | 33,923    |       | 大阪ソーダ            | 10.7    | 12.9  | 32,688    |       | 関西ペイント           | 124.8   | 135   | 257,445   |       |
| ダイトウボウ              | 18.8    | 19    | 1,634     |       | 関東電化工業           | 28.4    | 28.5  | 25,564    |       | 神東塗料             | 9       | 9.4   | 1,616     |       |
| トア紡コーポレーション         | 5.1     | 5     | 2,265     |       | デンカ              | 43.6    | 47.2  | 157,176   |       | 中国塗料             | 34.1    | 39.4  | 37,627    |       |
| ダイドーリミテッド           | 13.5    | 15    | 5,175     |       | 信越化学工業           | 197.8   | 211.8 | 1,957,879 |       | 日本特殊塗料           | 7.5     | 9     | 11,475    |       |
| 帝国繊維                | 12.4    | 13.5  | 33,615    |       | 日本カーバイド工業        | 3.8     | 4.1   | 7,129     |       | 藤倉化成             | 15      | 16.4  | 9,266     |       |
| 帯人                  | 97      | 98    | 178,458   |       | 堺化学工業            | 8.1     | 7.9   | 18,264    |       | 太陽ホールディングス       | 9.1     | 9.9   | 34,551    |       |
| 東レ                  | 861.5   | 932.2 | 742,870   |       | 第一稀元素化学工業        | -       | 9.8   | 8,839     |       | D I C            | 46.9    | 54.4  | 188,768   |       |
| サカイオーベックス           | 3       | 3     | 5,889     |       | エア・ウォーター         | 97.9    | 98.5  | 179,762   |       | サカタインクス          | 24.2    | 26.2  | 32,226    |       |
| 住江織物                | 3.1     | 3.2   | 8,019     |       | 大陽日酸             | 91.5    | 99    | 156,816   |       | 東洋インキSホールディングス   | 11.7    | 25.4  | 61,442    |       |
| 日本ファルコ              | 6.4     | 6.6   | 2,943     |       | 日本化学工業           | 4.4     | 4.1   | 10,721    |       | T & K TOKA       | 7.9     | 9.4   | 9,315     |       |
| イチワフ                | 8       | 1.8   | 2,469     |       | 東邦アセチレン          | 1.7     | 1.9   | 2,580     |       | 富士フイルムホールディングス   | 235.5   | 254.8 | 1,188,387 |       |
| 日東製綱                | 1.3     | 1.4   | 1,792     |       | 日本パーカライズン        | 60.7    | 65.6  | 90,068    |       | 資生堂              | 211.2   | 243.8 | 1,755,360 |       |
| アツギ                 | 7.9     | 10    | 9,520     |       | 高圧ガス工業           | 17.6    | 19.2  | 14,630    |       | ライオン             | 158     | 171   | 405,783   |       |
| ダイニッ                | 4.6     | 4.7   | 3,468     |       | チタン工業            | 1.3     | 1.5   | 3,769     |       | 高砂香料工業           | 7.1     | 8.5   | 29,877    |       |
| セーレン                | 27.3    | 29.5  | 55,460    |       | 四国化成工業           | 17.1    | 20.2  | 25,876    |       | マンダム             | 22.1    | 27.6  | 73,002    |       |
| ソトー                 | 4.4     | 4.6   | 4,296     |       | 戸田工業             | 2.4     | 2.6   | 5,829     |       | ミルボン             | 15.2    | 15.1  | 68,554    |       |
| 東海染工                | 1.7     | 1.8   | 1,791     |       | ステラ ケミファ         | 6.1     | 7     | 20,762    |       | ファンケル            | 27.5    | 54.6  | 130,384   |       |
| 小松マテール              | 18.2    | 19.7  | 15,070    |       | 保土谷化学工業          | 3.9     | 4.2   | 11,743    |       | コーセー             | 19.2    | 20.8  | 355,264   |       |
| ワコールホールディングス        | 32.8    | 35    | 95,830    |       | 日本触媒             | 18.7    | 20.2  | 150,490   |       | コタ               | 4.9     | 5.8   | 8,439     |       |
| ホギメディカル             | 7.5     | 14.9  | 55,428    |       | 大日精化工業           | 9.2     | 9.9   | 29,284    |       | シーズ・ホールディングス     | 15.4    | -     | -         |       |
| レナウン                | 32.3    | 35    | 3,465     |       | カネカ              | 160     | 32    | 137,920   |       | シーボン             | 1.4     | 1.4   | 3,725     |       |
| クラウディアホールディングス      | 2.9     | 2.9   | 1,374     |       | 三菱瓦斯化学           | 97.9    | 123.7 | 217,588   |       | ポーラ・オルビスホールディングス | 48.4    | 52.4  | 173,182   |       |
| T S Iホールディングス       | 44.8    | 44.3  | 30,744    |       | 三井化学             | 108     | 109   | 300,404   |       | ノビアホールディングス      | 7.2     | 7.7   | 39,578    |       |
| マツカコーポレーション         | 2.1     | 3.9   | 10,221    |       | J S R            | 119.4   | 120.6 | 217,924   |       | アジエパル            | 2.6     | 2.8   | 2,671     |       |
| ワールド                | -       | 12.4  | 24,093    |       | 東京応化工業           | 20.6    | 20.6  | 65,405    |       | エステー             | 8.1     | 8.8   | 16,016    |       |
| 三陽商会                | 6.2     | 7.2   | 12,600    |       | 大阪有機化学工業         | 7.7     | 11.1  | 12,742    |       | アグロ カネシオウ        | 4.6     | 5     | 10,770    |       |
| ナイガイ                | 4.4     | 4.6   | 2,428     |       | 三菱ケミカルホールディングス   | 795.4   | 803.4 | 680,078   |       | コニシ              | 18.6    | 21.8  | 39,087    |       |
| オンワードホールディングス       | 70.9    | 72.3  | 46,127    |       | K Hネオケム          | 18.2    | 18.3  | 48,092    |       | 長谷川香料            | 15      | 14.6  | 23,506    |       |
| ルックホールディングス         | 20      | 4.4   | 4,809     |       | ダイセル             | 160.2   | 186.7 | 199,208   |       | 星光PMC            | 6.5     | 8.1   | 6,228     |       |
| キムラタン               | 55.5    | 57.1  | 1,313     |       | 住友ベークライト         | 96      | 20.8  | 85,176    |       | 小林製薬             | 31.8    | 34.4  | 283,800   |       |
| ゴールドウイン             | 3.4     | 10.9  | 117,284   |       | 積水化学工業           | 246.7   | 262.6 | 444,581   |       | 荒川化学工業           | 10.2    | 11.1  | 14,474    |       |
| デサント                | 27.1    | 29.3  | 77,293    |       | 日本ゼオン            | 100.2   | 108.4 | 122,166   |       | メック              | 7.8     | 8.5   | 9,469     |       |
| キング                 | 5.8     | 6.2   | 3,490     |       | アイカ工業            | 33.3    | 36    | 136,620   |       | 日本高純度化学          | 3.1     | 3.2   | 7,136     |       |
| ヤマトインターナショナル        | 8.1     | 7.9   | 3,231     |       | 宇都興産             | 59.8    | 60.6  | 152,166   |       | タカラバイオ           | 29.7    | 32.1  | 74,953    |       |
| <b>パルプ・紙 (0.3%)</b> |         |       |           |       | 積水樹脂             | 18.3    | 19.8  | 40,728    |       | J C U            | 7       | 15.9  | 28,111    |       |
| 特種東海製紙              | 6.5     | 7.6   | 30,438    |       | タキロンシーアイ         | 24      | 26    | 15,938    |       | 新田ゼラチン           | 7.8     | 7.7   | 5,320     |       |
| 王子ホールディングス          | 500     | 541   | 330,010   |       | 旭有機材             | 7       | 8.3   | 13,495    |       | O A Tアグリオ        | 1.6     | 1.8   | 3,796     |       |
| 日本製紙                | 53.2    | 57.5  | 118,162   |       | 日立化成             | 58.7    | 55.5  | 106,671   |       | デクセリアルズ          | 29.9    | 31.6  | 24,964    |       |
| 三菱製紙                | 16.9    | 19.7  | 10,421    |       | ニチバン             | 5.8     | 6.3   | 12,883    |       | アース製薬            | 8.5     | 9.3   | 48,081    |       |
| 北越コーポレーション          | 66.3    | 79.7  | 47,501    |       | リケンテクノス          | 25.6    | 32.9  | 14,837    |       | 北興化学工業           | 11.7    | 12.8  | 6,745     |       |
| 中越パルプ工業             | 4.7     | 5.1   | 6,823     |       | 大倉工業             | 28      | 6.2   | 11,488    |       | 大成ラミック           | 3.5     | 3.7   | 10,448    |       |
| 巴川製紙所               | 18      | 4.1   | 4,202     |       | 積水化成製品工業         | 14.9    | 17.8  | 16,927    |       | クミアイ化学工業         | 51.6    | 50.7  | 33,816    |       |
| 大王製紙                | 47.3    | 58.5  | 82,777    |       | 群栄化学工業           | 2.8     | 2.9   | 7,737     |       | 日本農薬             | 29.6    | 29.4  | 14,229    |       |
| 阿波製紙                | 2.9     | 3     | 1,416     |       | タイガースポリマー        | 5.9     | 6.5   | 3,737     |       | アキレス             | 8.6     | 9     | 18,423    |       |

| 銘柄                    | 期首(前期末) |    |         | 当 期 末     |      |           | 銘柄                   | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末              |       |       | 銘柄      | 期首(前期末)            |        |       | 当 期 末   |               |       |       |         |       |
|-----------------------|---------|----|---------|-----------|------|-----------|----------------------|---------|-------|-----------|--------------------|-------|-------|---------|--------------------|--------|-------|---------|---------------|-------|-------|---------|-------|
|                       | 株       | 数  | 価 額     | 株         | 数    | 価 額       |                      | 株       | 数     | 価 額       | 株                  | 数     | 価 額   |         | 株                  | 数      | 価 額   | 株       | 数             | 価 額   |       |         |       |
| 有沢製作所                 |         | 千株 | 千円      |           | 千株   | 千円        | コスモエネルギーホールディングス     |         | 千株    | 千円        |                    | 千株    | 千円    | 愛知製鋼    |                    | 千株     | 千円    |         | 千株            | 千円    |       |         |       |
| 日東電工                  | 85.6    | 19 | 19.3    | 92.7      | 19.3 | 16,076    | <b>ゴム製品 (0.8%)</b>   | 32.8    | 35.5  | 84,632    | 横浜ゴム               | 65.6  | 71.2  | 163,332 | 日立金属               | 120.8  | 130.8 | 143,487 | 日本金属          | 2.8   | 2.8   | 3,318   |       |
| レック                   | 6.7     |    | 13.1    | 22,152    |      | 561,298   | TOYO TIRE            | 67.2    | 63    | 94,248    | 新大洋金属              | 6.9   | 8.1   | 23,984  | 大日本電工              | 67.2   | 72.6  | 16,552  | 栗本鐵工所         | 5.7   | 6.2   | 8,804   |       |
| 三光合成                  | —       |    | 9.5     | 3,486     |      | 4,012     | ブリヂストン               | 400.8   | 377.1 | 1,573,261 | 住友ゴム工業             | 116.7 | 110.2 | 166,622 | 虹 技                | 1.7    | 1.8   | 2,444   | 日本鋳鉄管         | 12    | 1.3   | 1,224   |       |
| きもと                   | 19.4    |    | 20.9    | 4,012     |      | 31,801    | オカモト                 | 9.9     | 10.9  | 4,959     | 三菱製鋼               | 8.3   | 9.1   | 14,469  | 日亜鋼業               | 16.5   | 17.2  | 5,005   | 日本精線          | 1.8   | 1.8   | 6,075   |       |
| 藤森工業                  | 9.5     |    | 11      | 31,801    |      | 9,116     | フコク                  | 5       | 5.5   | 4,735     | エンビロ・ホールディングス      | —     | —     | 2.5     | 1,252              | シンニッタン | 8.7   | 19      | 6,175         | 新家工業  | 2.6   | 2.7     | 4,336 |
| 前澤化成工業                | 7.8     |    | 8.6     | 9,116     |      | 15,503    | ニッタ                  | 11.7    | 13.9  | 52,125    | <b>非鉄金属 (0.8%)</b> |       |       |         | 大紀アルミニウム工業所        | 18.5   | 19.9  | 11,800  | 日本軽金属ホールディングス | 327.4 | 330.6 | 79,013  |       |
| 未来工業                  | —       |    | 6.6     | 15,503    |      | 2,022     | 住友友理工                | 22      | 23.9  | 24,306    | 三井金属鉱業             | 30.3  | 32.8  | 84,624  | 東邦亜鉛               | 6.2    | 6.7   | 23,919  | 三菱マテリアル       | 74.1  | 80.1  | 243,504 |       |
| ウェーブロックホールディングス       | —       |    | 2.6     | 2,022     |      | 17,586    | 三ツ星ベルト               | 28      | 16.2  | 33,647    | DOWAホールディングス       | 28.4  | 28.4  | 97,696  | 住友金属鉱山             | 143.3  | 166.1 | 527,367 | 古河機械金属        | 18.5  | 20    | 26,920  |       |
| J S P                 | 6.6     |    | 7.1     | 17,586    |      | 133,404   | バンドー化学               | 21.6    | 23.5  | 26,602    | エス・サイエンス           | 53.4  | 53.7  | 3,436   | 大崎チタニウムテクノロジーズ     | 11.7   | 14.1  | 23,462  | 東邦チタニウム       | 20.1  | 21.8  | 20,819  |       |
| エフピコ                  | 9.3     |    | 10.1    | 61,509    |      | 9.9       | <b>ガス・土石類 (0.9%)</b> |         |       |           | U A C J            | 17    | 18.5  | 40,330  | C K サンエツ           | —      | 2.3   | 5,568   | 古河電気工業        | 37.3  | 35    | 120,225 |       |
| 天馬                    | 8.8     |    | 8.6     | 15,514    |      | 260.2     | 日東紡績                 | 16.9    | 18.3  | 35,227    | 東海カーボン             | 103   | 111.4 | 164,537 | 住友電気工業             | 419.2  | 453.6 | 689,472 | フジクラ          | 135.4 | 146.4 | 71,443  |       |
| 信越ポリマー                | 23.3    |    | 22.1    | 17,967    |      | 22,275    | AGC                  | 115.9   | 121.4 | 469,211   | 日本カーボン             | 5.8   | 5.8   | 24,302  | 昭和電線ホールディングス       | 14.1   | 14.1  | 9,602   | 東京特殊電線        | 1.4   | 1.6   | 3,144   |       |
| 東リ                    | 28.2    |    | 30.7    | 7,705     |      | 906,016   | 日本板硝子                | 57.3    | 58.6  | 54,732    | 東洋炭素               | 7.4   | 7.2   | 17,200  | タツタ電線              | 22.3   | 24.1  | 12,050  | カナレ電線         | 1.9   | 2     | 3,658   |       |
| ニフコ                   | 20.8    |    | 49.1    | 133,404   |      | 235,963   | 石塚硝子                 | 1.5     | 1.6   | 2,924     | リウカガパン(一)リミテド      | 6.7   | 7.3   | 37,449  | 平河ヒューテック           | 5.6    | 5     | 7,425   | リョービー         | 13.8  | 14.9  | 42,599  |       |
| パルカー                  | 9.2     |    | 9.9     | 22,275    |      | 1,064,938 | 日本山硝子                | 47      | 5.2   | 7,779     | T O T O            | 87.2  | 94.4  | 409,224 | アールスティ             | 13.8   | 14.9  | 9,595   | アセビホールディングス   | 18.8  | 22.9  | 48,296  |       |
| ユニ・チャーム               | 240.4   |    | 260.2   | 906,016   |      | 206,691   | 日本電気硝子               | 49      | 53.1  | 152,662   | 三谷セキサン             | 5.9   | 5.7   | 14,962  | <b>金属製品 (0.6%)</b> |        |       |         | 稲葉製作所         | 6.3   | 6.9   | 8,459   |       |
| <b>医薬品 (5.4%)</b>     |         |    |         |           |      | 3,465,317 | オハラ                  | 4.5     | 4.8   | 7,915     | アジアパイルホールディングス     | 14.7  | 17.3  | 11,158  | 宮地エンジニアリンググループ     | 3.2    | 3.8   | 7,634   | トーカロ          | 7.8   | 31.3  | 29,077  |       |
| 協和発酵キリン               | 142.1   |    | 153.7   | 331,684   |      | 1,879,255 | 住友大阪セメント             | 2.20    | 24.7  | 118,807   | 東海カーボン             | 103   | 111.4 | 164,537 | アルファ               | 4      | 4.3   | 5,516   | アルファ          | 4     | 4.3   | 5,516   |       |
| 武田薬品工業                | 417.7   |    | 777.5   | 3,465,317 |      | 1,064,938 | 太平洋セメント              | 71.6    | 77.4  | 288,702   | 日本カーボン             | 5.8   | 5.8   | 24,302  | S U M C O          | 103.3  | 134.1 | 210,671 | 川田テクノロジーズ     | 2.3   | 2.7   | 18,387  |       |
| アステラス製薬               | 1,165.4 |    | 1,131.4 | 1,879,255 |      | 206,691   | 日本ヒューム               | 11.4    | 12.4  | 9,734     | 東洋炭素               | 7.4   | 7.2   | 17,200  | RS Technologies    | 1.6    | 2.5   | 7,485   | 三和ホールディングス    | 107.5 | 125.3 | 163,140 |       |
| 大日本住友製薬               | 84.1    |    | 91      | 235,963   |      | 3,875     | 日本コンクリート工業           | 24.5    | 26.6  | 7,288     | リウカガパン(一)リミテド      | 6.7   | 7.3   | 37,449  | 東洋特殊電線             | 1.4    | 1.6   | 3,144   | 文化シヤッター       | 33    | 35.8  | 28,425  |       |
| 塩野義製薬                 | 162.2   |    | 160.6   | 1,064,938 |      | 18,527    | 三谷セキサン               | 5.9     | 5.7   | 14,962    | 昭和電線ホールディングス       | 14.1  | 14.1  | 9,602   | 三協立山               | 15.5   | 16.8  | 23,116  | アルコン          | 8.2   | 9.7   | 9,467   |       |
| 田辺三菱製薬                | 138.4   |    | 128.3   | 206,691   |      | 231,120   | アジアパイルホールディングス       | 14.7    | 17.3  | 11,158    | 東京特殊電線             | 1.4   | 1.6   | 3,144   | 東洋シヤッター            | 2.9    | 3     | 2,103   | LI X I L グループ | 165.3 | 179.1 | 287,992 |       |
| わかもと製薬                | 14      |    | 14.3    | 3,875     |      | 4,780     | 東海カーボン               | 103     | 111.4 | 164,537   | タツタ電線              | 22.3  | 24.1  | 12,050  | 日本フィルコン            | 8.7    | 9.4   | 4,869   | ノーリツ          | 25    | 27    | 41,607  |       |
| あすか製薬                 | 12.9    |    | 15.1    | 18,527    |      | 883,789   | 日本カーボン               | 5.8     | 5.8   | 24,302    | リョービー              | 13.8  | 14.9  | 9,595   | 長府製作所              | 12.6   | 12.4  | 25,469  | 長府製作所         | 12.6  | 12.4  | 25,469  |       |
| 日本新薬                  | 29.7    |    | 32.1    | 231,120   |      | 119,880   | 東洋炭素                 | 7.4     | 7.2   | 17,200    | アールスティ             | 13.8  | 14.9  | 9,595   | リンヤ                | 20     | 21.7  | 157,976 | ダイニチ工業        | 6     | 6.4   | 4,588   |       |
| ピオフェルミン製薬             | 1.9     |    | 2       | 4,780     |      | 1,264,094 | リウカガパン(一)リミテド        | 6.7     | 7.3   | 37,449    | アセビホールディングス        | 18.8  | 22.9  | 48,296  | ダイニチ工業             | 6      | 6.4   | 4,588   | 日東精工          | 15.5  | 16.7  | 8,867   |       |
| 中外製薬                  | 118.2   |    | 127.9   | 883,789   |      | 185,932   | T O T O              | 87.2    | 94.4  | 409,224   | <b>金属製品 (0.6%)</b> |       |       |         | 日東精工               | 15.5   | 16.7  | 8,867   | 三洋工業          | 1.4   | 1.5   | 2,877   |       |
| 科研製薬                  | 20.5    |    | 22.2    | 119,880   |      | 656,333   | 日本硝子                 | 138.4   | 149.7 | 242,064   | 稲葉製作所              | 6.3   | 6.9   | 8,459   | 日東精工               | 15.5   | 16.7  | 8,867   | 岡部            | 22.7  | 24.6  | 21,156  |       |
| エーザイ                  | 135.7   |    | 146.8   | 1,264,094 |      | 197,652   | ダントホールディングス          | 9       | 9.4   | 1,109     | 宮地エンジニアリンググループ     | 3.2   | 3.8   | 7,634   | 三洋工業               | 1.4    | 1.5   | 2,877   |               |       |       |         |       |
| ロート製薬                 | 62.3    |    | 62.9    | 185,932   |      | 345,876   | MA R U W A           | 3.9     | 4.3   | 25,499    | トーカロ               | 7.8   | 31.3  | 29,077  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 小野薬品工業                | 267.8   |    | 289.9   | 656,333   |      | 10,613    | 品川リフラクトリーズ           | 3       | 3.2   | 11,696    | アルファ               | 4     | 4.3   | 5,516   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 久光製薬                  | 33.5    |    | 36.2    | 197,652   |      | 4,832     | 黒崎播磨                 | 2.2     | 2.5   | 13,600    | S U M C O          | 103.3 | 134.1 | 210,671 |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 持田製薬                  | 7.9     |    | 9.3     | 92,814    |      | 122,872   | ヨータイ                 | 6.8     | 10.7  | 7,490     | 川田テクノロジーズ          | 2.3   | 2.7   | 18,387  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 参天製薬                  | 214.7   |    | 232.6   | 345,876   |      | 48,972    | インソライト工業             | 5.8     | 6.3   | 4,032     | RS Technologies    | 1.6   | 2.5   | 7,485   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 扶桑薬品工業                | 4       |    | 4.2     | 10,613    |      | 62,740    | 東京窯業                 | 14.5    | 15.7  | 5,981     | 三和ホールディングス         | 107.5 | 125.3 | 163,140 |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 日本ケミファ                | 1.5     |    | 1.6     | 4,832     |      | 30,368    | ニッカトール               | 3.9     | 5.5   | 5,214     | 文化シヤッター            | 33    | 35.8  | 28,425  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| ツムラ                   | 40.5    |    | 38.1    | 122,872   |      | 53,157    | フジミンコーポレートド          | 10.1    | 11    | 25,311    | 三協立山               | 15.5  | 16.8  | 23,116  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 日医工                   | 29.9    |    | 30.1    | 48,972    |      | 6,073     | エーアンドエーマテリアル         | 2.5     | 2.6   | 2,636     | アルコン               | 8.2   | 9.7   | 9,467   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| キッセイ薬品工業              | 21      |    | 21.8    | 62,740    |      | 54,600    | ニチアス                 | 62      | 33.6  | 66,897    | 東洋シヤッター            | 2.9   | 3     | 2,103   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 生化学工業                 | 22      |    | 23.8    | 30,368    |      | 44,950    | ニチハ                  | 17.1    | 17    | 52,020    | LI X I L グループ      | 165.3 | 179.1 | 287,992 |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 栄研化学                  | 9.2     |    | 21.6    | 53,157    |      | 15,097    | <b>鉄鋼 (1.0%)</b>     |         |       |           | 稲葉製作所              | 6.3   | 6.9   | 8,459   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 日水製薬                  | 4.8     |    | 5.2     | 6,073     |      | 137,046   | 新日鐵住金                | 501.8   | 563.9 | 1,148,946 | 宮地エンジニアリンググループ     | 3.2   | 3.8   | 7,634   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 鳥居薬品                  | 7.1     |    | 6.6     | 14,223    |      | 46,315    | 神戸製鋼所                | 205.3   | 222   | 194,250   | トーカロ               | 7.8   | 31.3  | 29,077  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| J C R ファーマ            | 8       |    | 8.7     | 54,600    |      | 1,265,364 | 中山製鋼所                | 15.5    | 16.8  | 7,896     | アルファ               | 4     | 4.3   | 5,516   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 東和薬品                  | 5.4     |    | 5.8     | 44,950    |      | 60,723    | 合同製鐵                 | 6.1     | 5.8   | 10,126    | S U M C O          | 103.3 | 134.1 | 210,671 |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 富士製薬工業                | 3.9     |    | 8.3     | 15,097    |      | 9,417     | ジェイ エフ イー ホールディングス   | 302.8   | 327.7 | 628,856   | 川田テクノロジーズ          | 2.3   | 2.7   | 18,387  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 沢井製薬                  | 22.8    |    | 25.1    | 137,046   |      | 19,951    | 日新製鋼                 | 30.9    | —     | —         | RS Technologies    | 1.6   | 2.5   | 7,485   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| ゼリア新薬工業               | 24.3    |    | 24.3    | 46,315    |      | 233.7     | 東京製鐵                 | 60.1    | 64.9  | 58,994    | 三和ホールディングス         | 107.5 | 125.3 | 163,140 |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| キョーリン製薬ホールディングス       | 31.7    |    | 27      | 60,723    |      | 299,208   | 共英製鋼                 | 12.6    | 13.7  | 21,961    | 文化シヤッター            | 33    | 35.8  | 28,425  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 大幸薬品                  | 6       |    | 6.6     | 9,417     |      | 290,394   | 大和工業                 | 23.8    | 25.8  | 75,516    | 三協立山               | 15.5  | 16.8  | 23,116  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| ダイト                   | 6.6     |    | 7.1     | 19,951    |      | 10,420    | 東京製鐵                 | 4.6     | 5     | 5,925     | 東洋シヤッター            | 2.9   | 3     | 2,103   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 大塚ホールディングス            | 235.7   |    | 233.7   | 1,033,888 |      | 178,535   | 大阪製鐵                 | 7.4     | 8     | 15,296    | LI X I L グループ      | 165.3 | 179.1 | 287,992 |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 大正製薬ホールディングス          | 25.4    |    | 27.4    | 299,208   |      | 16,590    | 淀川製鋼所                | 16.4    | 16.4  | 35,522    | 日本フィルコン            | 8.7   | 9.4   | 4,869   |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| ペプチドリーム               | 50.8    |    | 61.2    | 290,394   |      | 7,865     | 東洋鋼板                 | 28.4    | —     | —         | ノーリツ               | 25    | 27    | 41,607  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| <b>石油・石炭製品 (0.7%)</b> |         |    |         |           |      | 5,900     | 丸一鋼管                 | 39.7    | 43    | 148,995   | 長府製作所              | 12.6  | 12.4  | 25,469  |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |
| 日本コープス工業              | 96.1    |    | 104.2   | 10,4      |      |           |                      |         |       |           |                    |       |       |         |                    |        |       |         |               |       |       |         |       |



| 銘柄               | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |       |           | 銘柄              | 期首(前期末) |       |       | 当 期 末     |   |                     | 銘柄 | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |         |       |           |
|------------------|---------|-------|-----------|-------|-------|-----------|-----------------|---------|-------|-------|-----------|---|---------------------|----|---------|-------|-----------|-------|---------|-------|-----------|
|                  | 株       | 数     | 価 額       | 株     | 数     | 価 額       |                 | 株       | 数     | 価 額   | 株         | 数 | 価 額                 |    | 株       | 数     | 価 額       | 株     | 数       | 価 額   |           |
|                  |         | 千株    | 千円        |       | 千株    | 千円        |                 |         | 千株    | 千株    | 千円        |   |                     | 千株 | 千株      | 千円    |           |       | 千株      | 千株    | 千円        |
| ジーテクト            |         | 12.4  | 21,073    |       | 13.5  | 21,073    | 日精樹脂工業          |         | 9.4   | 10.2  | 9,618     |   | T P R               |    | 12.7    | 16.5  | 38,065    |       | 12.7    | 16.5  | 38,065    |
| 中国工業             |         | 1.7   | 1,081     |       | 1.9   | 1,081     | オカダアイオン         |         | 3.3   | 4.2   | 6,211     |   | ツバキ・ナカシマ            |    | 11.4    | 18.5  | 31,468    |       | 11.4    | 18.5  | 31,468    |
| 東プレ              |         | 20.9  | 53,810    |       | 22.6  | 53,810    | ワイエイシールホールディングス |         | 3.8   | 4.9   | 3,248     |   | ホシガキ                |    | 35.7    | 35.8  | 275,660   |       | 35.7    | 35.8  | 275,660   |
| 高周波熱錬            |         | 21.6  | 21,056    |       | 23.5  | 21,056    | 小松製作所           |         | 547.5 | 555.5 | 1,485,684 |   | 大豊工業                |    | 9.2     | 10    | 10,290    |       | 9.2     | 10    | 10,290    |
| 東京製綱             |         | 8.1   | 7,237     |       | 7.4   | 7,237     | 住友重機械工業         |         | 64.9  | 70.2  | 260,793   |   | 日本精工                |    | 232.9   | 252   | 268,884   |       | 232.9   | 252   | 268,884   |
| サンコール            |         | 6.3   | 4,395     |       | 6.9   | 4,395     | 日立建機            |         | 53    | 49.1  | 136,154   |   | N T N               |    | 262.4   | 263.7 | 90,449    |       | 262.4   | 263.7 | 90,449    |
| モリテックスチール        |         | 6.6   | 3,961     |       | 9.5   | 3,961     | 日工              |         | 3.1   | 3.4   | 7,775     |   | ジェイテクト              |    | 120.8   | 117.7 | 160,542   |       | 120.8   | 117.7 | 160,542   |
| パイオラックス          |         | 16.6  | 42,815    |       | 19.4  | 42,815    | 巴工業             |         | 4.8   | 5.2   | 13,000    |   | 不二越                 |    | 105     | 11.4  | 49,077    |       | 105     | 11.4  | 49,077    |
| エイチワン            |         | 8.3   | 13,260    |       | 12    | 13,260    | 井関農機            |         | 11.3  | 12.3  | 20,393    |   | 日本トムソン              |    | 36.3    | 36.4  | 20,966    |       | 36.3    | 36.4  | 20,966    |
| 日本発条             |         | 111.7 | 124,527   |       | 120.9 | 124,527   | T O W A         |         | 8.8   | 10.4  | 6,999     |   | T H K               |    | 70.7    | 76.5  | 206,014   |       | 70.7    | 76.5  | 206,014   |
| 中央発條             |         | 1.3   | 4,048     |       | 1.4   | 4,048     | 丸山製作所           |         | 2.5   | 2.6   | 3,546     |   | ユーシン精機              |    | 5       | 9.5   | 8,597     |       | 5       | 9.5   | 8,597     |
| アドパネクス           |         | 1.8   | 2,468     |       | 1.6   | 2,468     | 北川鉄工所           |         | 5.4   | 5.5   | 12,507    |   | 前澤給袋工業              |    | 4.4     | 4.8   | 8,707     |       | 4.4     | 4.8   | 8,707     |
| 立川プラインド工業        |         | 5     | 5,313     |       | 5.4   | 5,313     | ローツエ            |         | 5.6   | 5.3   | 8,904     |   | イーグル工業              |    | 14      | 15.1  | 19,871    |       | 14      | 15.1  | 19,871    |
| 三益半導体工業          |         | 8.7   | 13,642    |       | 9.5   | 13,642    | タカカタ            |         | 3.6   | 4.4   | 2,657     |   | 前澤工業                |    | 7.8     | 9.1   | 3,221     |       | 7.8     | 9.1   | 3,221     |
| <b>機械 (4.9%)</b> |         |       |           |       |       |           | クボタ             |         | 608.2 | 658.2 | 1,119,927 |   | 日本ビラー工業             |    | 11.5    | 12.4  | 16,603    |       | 11.5    | 12.4  | 16,603    |
| 日本ドライケミカル        |         | 1.5   | 3,954     |       | 3.4   | 3,954     | 荏原実業            |         | 3.3   | 3.5   | 7,245     |   | キッツ                 |    | 50.5    | 49.7  | 45,028    |       | 50.5    | 49.7  | 45,028    |
| 日本製鋼所            |         | 36.6  | 74,794    |       | 36.7  | 74,794    | 三菱化工機           |         | 3.9   | 4.3   | 6,617     |   | マキタ                 |    | 147.9   | 149.3 | 582,270   |       | 147.9   | 149.3 | 582,270   |
| 三浦工業             |         | 48.5  | 125,766   |       | 52.6  | 125,766   | 月島機械            |         | 22.5  | 24.3  | 33,631    |   | 日立造船                |    | 89.9    | 97.1  | 35,247    |       | 89.9    | 97.1  | 35,247    |
| タクマ              |         | 38    | 61,482    |       | 44.2  | 61,482    | 帝國電機製作所         |         | 7.9   | 8.6   | 10,294    |   | 三菱重工業               |    | 190     | 205.6 | 872,566   |       | 190     | 205.6 | 872,566   |
| ツガミ              |         | 30    | 19,268    |       | 27.1  | 19,268    | 東京機械製作所         |         | 4.5   | 4.7   | 1,800     |   | I H I               |    | 87.1    | 94.3  | 321,091   |       | 87.1    | 94.3  | 321,091   |
| オークマ             |         | 13.1  | 89,782    |       | 15.4  | 89,782    | 新東工業            |         | 26.9  | 29.1  | 27,965    |   | スター精機               |    | 18.2    | 21.1  | 33,464    |       | 18.2    | 21.1  | 33,464    |
| 東芝機械             |         | 63    | 29,961    |       | 13.7  | 29,961    | 瀬谷工業            |         | 9.9   | 10.7  | 40,446    |   | <b>電気機器 (13.0%)</b> |    |         |       |           |       |         |       |           |
| アマダホールディングス      |         | 173   | 201,427   |       | 187.2 | 201,427   | アイチコーポレーション     |         | 19.6  | 21.2  | 14,903    |   | 日清紡ホールディングス         |    | 69.3    | 68.1  | 63,128    |       | 69.3    | 68.1  | 63,128    |
| アイデンエンジニアリング     |         | 28.5  | 26,656    |       | 33.7  | 26,656    | 小森コーポレーション      |         | 28.5  | 33.2  | 37,682    |   | イビデン                |    | 69.4    | 75.1  | 109,120   |       | 69.4    | 75.1  | 109,120   |
| 滝澤鉄工所            |         | 3.5   | 6,555     |       | 3.9   | 6,555     | 鶴見製作所           |         | 9.5   | 9.6   | 17,222    |   | コニカミノルタ             |    | 265.4   | 268.1 | 286,598   |       | 265.4   | 268.1 | 286,598   |
| F U J I          |         | 33.6  | 52,308    |       | 36.3  | 52,308    | 住友精工工業          |         | 19    | 2     | 5,836     |   | ブラザー工業              |    | 138.5   | 159.9 | 324,916   |       | 138.5   | 159.9 | 324,916   |
| 牧野フライス製作所        |         | 56    | 60,634    |       | 14.2  | 60,634    | 酒井重工業           |         | 2.1   | 2.3   | 5,428     |   | ニセバミアツミ             |    | 210.5   | 227.8 | 418,924   |       | 210.5   | 227.8 | 418,924   |
| オーエスジー           |         | 51.7  | 135,399   |       | 59.7  | 135,399   | 荏原製作所           |         | 46.6  | 54.4  | 166,192   |   | 日立製作所               |    | 2,723   | 552.4 | 1,935,057 |       | 2,723   | 552.4 | 1,935,057 |
| ダイジェット工業         |         | 1.4   | 2,244     |       | 1.4   | 2,244     | 石井鐵工所           |         | 1.8   | 1.9   | 3,467     |   | 三菱電機                |    | 1,133.9 | 1,227 | 1,706,143 |       | 1,133.9 | 1,227 | 1,706,143 |
| 旭ダイヤモンド工業        |         | 33.3  | 23,436    |       | 31.8  | 23,436    | 西島製作所           |         | 11.6  | 12.6  | 11,881    |   | 富士電機                |    | 342     | 79.6  | 258,700   |       | 342     | 79.6  | 258,700   |
| DMG森精機           |         | 62.1  | 114,743   |       | 76.7  | 114,743   | 北越工業            |         | 12.8  | 12.7  | 15,240    |   | 東洋電機製造              |    | 4.5     | 4.8   | 6,254     |       | 4.5     | 4.8   | 6,254     |
| ソディック            |         | 24.4  | 21,648    |       | 26.4  | 21,648    | ダイキン工業          |         | 154.8 | 167.5 | 1,968,962 |   | 日立電機                |    | 131.4   | 142.2 | 443,664   |       | 131.4   | 142.2 | 443,664   |
| ディスコ             |         | 15.2  | 271,748   |       | 16.4  | 271,748   | オルゴン            |         | 4.1   | 4.5   | 12,546    |   | シフニアテクノロジー          |    | 73      | 17    | 23,239    |       | 73      | 17    | 23,239    |
| 日東工器             |         | 6.9   | 14,869    |       | 6.6   | 14,869    | トーヨーカネツ         |         | 4.8   | 4.6   | 10,842    |   | 明電舎                 |    | 96      | 24.3  | 39,293    |       | 96      | 24.3  | 39,293    |
| 日進工具             |         | 3     | 9,113     |       | 3.7   | 9,113     | 栗田工業            |         | 61.4  | 66.4  | 186,052   |   | オリソン電気              |    | 3.3     | 3.3   | 6,263     |       | 3.3     | 3.3   | 6,263     |
| パンチ工業            |         | 9.4   | 4,496     |       | 8.5   | 4,496     | 椿本チエイン          |         | 67    | 16    | 65,360    |   | 山洋電気                |    | 5.5     | 5.9   | 23,511    |       | 5.5     | 5.9   | 23,511    |
| 富士ダイス            |         | 4.3   | 3,504     |       | 5.4   | 3,504     | 大同工業            |         | 4.3   | 5.8   | 5,144     |   | デンヨー                |    | 10.5    | 11.3  | 16,012    |       | 10.5    | 11.3  | 16,012    |
| 豊和工業             |         | 6.2   | 5,715     |       | 6.7   | 5,715     | 木村化工機           |         | 9.6   | 10.2  | 3,886     |   | 東芝テック               |    | 81      | 15.3  | 41,264    |       | 81      | 15.3  | 41,264    |
| OK K             |         | 4.3   | 4,235     |       | 5     | 4,235     | アネスト岩田          |         | 19.1  | 19.1  | 18,202    |   | 芝浦メカトロニクス           |    | 17      | 2.2   | 7,854     |       | 17      | 2.2   | 7,854     |
| 石川製作所            |         | 2.9   | 3,433     |       | 2.9   | 3,433     | ダイフク            |         | 57.7  | 67.4  | 376,092   |   | マブチモーター             |    | 31.6    | 33.9  | 131,362   |       | 31.6    | 33.9  | 131,362   |
| 東洋機械金属           |         | 8.8   | 5,139     |       | 8.8   | 5,139     | サムコ             |         | 3.1   | 3.4   | 3,352     |   | 日本電産                |    | 136.5   | 147.7 | 1,941,516 |       | 136.5   | 147.7 | 1,941,516 |
| 津田駒工業            |         | 27    | 4,872     |       | 2.6   | 4,872     | 加藤製作所           |         | 5.4   | 6.3   | 17,173    |   | ユ・エム・シー・エレクトロニクス    |    | 4.1     | 6.6   | 11,259    |       | 4.1     | 6.6   | 11,259    |
| エンシュウ            |         | 29    | 3,564     |       | 3.2   | 3,564     | 油研工業            |         | 2.2   | 2.2   | 4,331     |   | トレックス・セミコンダクター      |    | —       | 4.2   | 5,363     |       | —       | 4.2   | 5,363     |
| 島精機製作所           |         | 14.2  | 59,619    |       | 16.7  | 59,619    | タダノ             |         | 54.7  | 59.2  | 70,566    |   | 東光高岳                |    | 5.7     | 6.2   | 8,909     |       | 5.7     | 6.2   | 8,909     |
| オプトラン            |         | 8.2   | 22,848    |       | 11.9  | 22,848    | フジテック           |         | 36.3  | 44.6  | 52,494    |   | ダブル・スコープ            |    | 16.5    | 17.8  | 20,559    |       | 16.5    | 17.8  | 20,559    |
| NCホールディングス       |         | 3.6   | 1,835     |       | 3.8   | 1,835     | C K D           |         | 31.5  | 34.1  | 36,964    |   | 宮越ホールディングス          |    | 4.3     | 4.6   | 4,540     |       | 4.3     | 4.6   | 4,540     |
| フリユー             |         | 8     | 9,952     |       | 9.7   | 9,952     | キトー             |         | 8.6   | 9.3   | 15,763    |   | ダイヘン                |    | 62      | 13.5  | 37,125    |       | 62      | 13.5  | 37,125    |
| ヤマシンフィルタ         |         | 15.3  | 13,567    |       | 21.1  | 13,567    | 平和              |         | 35.1  | 34.2  | 77,292    |   | 田淵電機                |    | 15.8    | 16.5  | 2,029     |       | 15.8    | 16.5  | 2,029     |
| 日阪製作所            |         | 16.1  | 12,840    |       | 15    | 12,840    | 理想科学工業          |         | 11.2  | 10.9  | 18,813    |   | ヤーマン                |    | 16.4    | 17.7  | 24,355    |       | 16.4    | 17.7  | 24,355    |
| やまびこ             |         | 21.7  | 26,078    |       | 23.6  | 26,078    | S A N K Y O     |         | 28.4  | 30.7  | 126,177   |   | J V Cケンウッド          |    | 83.3    | 89.9  | 24,452    |       | 83.3    | 89.9  | 24,452    |
| 平田機工             |         | 3.1   | 37,107    |       | 5.7   | 37,107    | 日本金銭機械          |         | 10.5  | 13.6  | 13,205    |   | ミキエンジニアリング          |    | 10.2    | 11    | 8,910     |       | 10.2    | 11    | 8,910     |
| ペガサスミシン製造        |         | 10.5  | 7,364     |       | 11.4  | 7,364     | マースグループホールディングス |         | 7.2   | 7.7   | 16,362    |   | 第一精工                |    | 5.3     | 5.1   | 6,257     |       | 5.3     | 5.1   | 6,257     |
| マルマエ             |         | —     | 2,392     |       | 3.3   | 2,392     | 福島工業            |         | 7     | 7.5   | 28,987    |   | 日新電機                |    | 26.6    | 28.8  | 28,137    |       | 26.6    | 28.8  | 28,137    |
| タツモ              |         | —     | 3,525     |       | 3.9   | 3,525     | オーイズミ           |         | 4.8   | 5     | 1,750     |   | 大崎電気工業              |    | 24.3    | 24.4  | 17,470    |       | 24.3    | 24.4  | 17,470    |
| ナプテスコ            |         | 61.7  | 189,294   |       | 66.7  | 189,294   | ダイコク電機          |         | 5.2   | 5.6   | 8,159     |   | オムロン                |    | 120.5   | 130.3 | 630,000   |       | 120.5   | 130.3 | 630,000   |
| 三井海洋開発           |         | 11.9  | 40,377    |       | 12.9  | 40,377    | 竹内製作所           |         | 19    | 20.5  | 40,754    |   | 日東工業                |    | 18.2    | 19.6  | 42,708    |       | 18.2    | 19.6  | 42,708    |
| レオン自動機           |         | 10    | 16,740    |       | 12    | 16,740    | アmano           |         | 35.1  | 35.1  | 82,941    |   | I D E C             |    | 14      | 16.4  | 33,718    |       | 14      | 16.4  | 33,718    |
| S M C            |         | 35.6  | 1,386,458 |       | 35.9  | 1,386,458 | J U K I         |         | 16.8  | 17    | 19,635    |   | 不二電機工業              |    | 1.3     | 1.3   | 1,684     |       | 1.3     | 1.3   | 1,684     |
| 新川               |         | 9.2   | 3,634     |       | 9.2   | 3,634     | サンデーホールディングス    |         | 13.8  | 14.9  | 12,054    |   | ジェーエス・コア コーポレーション   |    | 204     | 44.1  | 99,798    |       | 204     | 44.1  | 99,798    |
| ホソカワミクロン         |         |       |           |       |       |           |                 |         |       |       |           |   |                     |    |         |       |           |       |         |       |           |



| 銘柄                  | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |       |        | 銘柄                   | 期首(前期末) |         |           | 当 期 末 |        |                        | 銘柄    | 期首(前期末) |         |       | 当 期 末 |    |       |
|---------------------|---------|-------|-----------|-------|-------|--------|----------------------|---------|---------|-----------|-------|--------|------------------------|-------|---------|---------|-------|-------|----|-------|
|                     | 株       | 数     | 評 価 額     | 株     | 数     | 評 価 額  |                      | 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      |         |       | 千株    | 千円 |       |
| シード                 | 1.2     | 5.2   | 6,744     |       |       |        | <b>電気・ガス業 (2.0%)</b> |         |         |           |       |        | SGホールディングス             | 76.1  | 109.8   | 327,423 |       |       |    |       |
| ノーリツ鋼機              | 11.5    | 9.7   | 18,274    |       | 905.1 | 979.5  | 東京電力ホールディングス         | 346.9   | 375.4   | 658,224   |       |        | <b>海運業 (0.2%)</b>      |       |         |         |       |       |    |       |
| エー・アンド・デイ           | 10.4    | 11.2  | 7,873     |       | 462.7 | 500.7  | 中部電力                 | 156.7   | 169.6   | 627,481   |       |        | 日本郵船                   | 89.8  | 97.1    | 175,945 |       |       |    |       |
| 朝日インテック             | -       | 52    | 254,280   |       | 462.7 | 500.7  | 関西電力                 | 111.1   | 120.1   | 792,107   |       |        | 商船三井                   | 67.9  | 69      | 182,712 |       |       |    |       |
| シチズン時計              | 135.3   | 134.2 | 77,567    |       | 111.1 | 120.1  | 中国電力                 | 265.5   | 287.4   | 249,481   |       |        | 川崎汽船                   | 49.6  | 35.8    | 55,704  |       |       |    |       |
| リズム時計工業             | 4.3     | 4.1   | 7,080     |       | 111.1 | 120.1  | 北陸電力                 | 102.1   | 110.5   | 105,808   |       |        | NSユナイテッド海運             | 5.1   | 6.4     | 16,832  |       |       |    |       |
| 大研医器                | 10.1    | 9.8   | 5,870     |       | 250.4 | 252.9  | 東北電力                 | 13.7    | 14.8    | 408,108   |       |        | 明治海運                   | 11.4  | 12.1    | 4,271   |       |       |    |       |
| メニコン                | 15.6    | 16.8  | 45,578    |       | 18.3  | 22.7   | 東国電力                 | 90.2    | 97.7    | 157,020   |       |        | 飯野海運                   | 54.7  | 55      | 21,835  |       |       |    |       |
| シンシア                | -       | 1.9   | 934       |       | 90.2  | 97.7   | 九州電力                 | 5.7     | 7.3     | 334,839   |       |        | 共栄タンカー                 | 0.8   | 0.8     | 1,216   |       |       |    |       |
| 松風                  | 5.6     | 6.2   | 7,526     |       | 5.7   | 7.3    | 北海道電力                | 17.8    | 21.3    | 89,544    |       |        | 乾汽船                    | 8.3   | 10.4    | 7,415   |       |       |    |       |
| セイコーホールディングス        | 17.5    | 19    | 44,384    |       | 17.8  | 21.3   | 沖縄電力                 | 12.7    | 13.881  | 46,716    |       |        | <b>空運業 (0.6%)</b>      |       |         |         |       |       |    |       |
| ニプロ                 | 78.5    | 84.9  | 118,605   |       | 12.7  | 13.881 | 電源開発                 | 241.9   | 240.7   | 269,358   |       |        | 日本航空                   | 199.2 | 212.8   | 856,732 |       |       |    |       |
| <b>その他製品 (2.0%)</b> |         |       |           |       |       |        | エフオン                 | 220     | 238     | 6,635     |       |        | ANAホールディングス            | 210.5 | 212.5   | 862,112 |       |       |    |       |
| 中本パックス              | 1.1     | 3.4   | 5,531     |       | 220   | 238    | イーレックス               | 56.2    | 60.7    | 14,079    |       |        | パスコ                    | 10    | 2.3     | 1,948   |       |       |    |       |
| スノーピーク              | 3.5     | 4.5   | 5,598     |       | 56.2  | 60.7   | レノバ                  | 31      | 6.6     | 13,881    |       |        | <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |       |         |         |       |       |    |       |
| パワマウントベッドホールディングス   | 12      | 14.1  | 65,071    |       | 31    | 6.6    | 東京瓦斯                 | 23.4    | 25.5    | 699,835   |       |        | トランコム                  | 3     | 3.3     | 21,912  |       |       |    |       |
| トランザクション            | 5.1     | 6.7   | 4,817     |       | 23.4  | 25.5   | 大阪瓦斯                 | 13.8    | 13.9    | 514,318   |       |        | 日新                     | 9.3   | 10      | 19,050  |       |       |    |       |
| S HO - B I          | 3.9     | 3.5   | 1,221     |       | 13.8  | 13.9   | 東邦瓦斯                 | 32.2    | 37.7    | 279,220   |       |        | 三菱倉庫                   | 37.1  | 40.2    | 106,610 |       |       |    |       |
| ニホンフラッシュ            | 5.3     | 5.2   | 10,618    |       | 32.2  | 37.7   | 北海道瓦斯                | 6.4     | 5.9     | 9,490     |       |        | 三井倉庫ホールディングス           | 61    | 14.3    | 28,585  |       |       |    |       |
| 前田工織                | 11.4    | 13.6  | 37,848    |       | 6.4   | 5.9    | 広島ガス                 | 11.2    | 12.2    | 8,746     |       |        | 住友倉庫                   | 74    | 43.7    | 63,496  |       |       |    |       |
| 永大産業                | 15      | 16.4  | 7,314     |       | 11.2  | 12.2   | 西部瓦斯                 | 12.2    | 129.4   | 34,597    |       |        | 滋澤倉庫                   | 5.9   | 6.5     | 10,192  |       |       |    |       |
| アートネイチャー            | 12.1    | 13.1  | 8,017     |       | 12.2  | 12.2   | 静岡ガス                 | 12.2    | 129.4   | 33,628    |       |        | 東陽倉庫                   | 19.5  | 20.5    | 6,088   |       |       |    |       |
| パシフィックホールディングス      | 117.2   | 126.8 | 571,234   |       | 12.2  | 12.2   | メタウォーター              | 12.2    | 12.2    | 18,349    |       |        | 日本トランスシティ              | 26    | 25.7    | 11,256  |       |       |    |       |
| アイフィスジャパン           | 2.4     | 2.7   | 1,657     |       | 12.2  | 12.2   | <b>陸運業 (4.7%)</b>    |         |         |           |       |        | ケイヒン                   | 2.1   | 2.2     | 2,824   |       |       |    |       |
| 共立印刷                | 18.9    | 20.8  | 4,846     |       | 12.2  | 12.2   | SBSホールディングス          | 12.2    | 12.2    | 20,081    |       |        | 中央倉庫                   | 6.6   | 6.9     | 6,906   |       |       |    |       |
| S HO E I            | 5.1     | 5.8   | 22,823    |       | 12.2  | 12.2   | 東武鉄道                 | 36.3    | 42.2    | 390,141   |       |        | 川西倉庫                   | 2.2   | 2.3     | 2,716   |       |       |    |       |
| フランスベッドホールディングス     | 13.4    | 17.4  | 15,068    |       | 36.3  | 42.2   | 相鉄ホールディングス           | 308     | 333.3   | 135,884   |       |        | 安田倉庫                   | 9.7   | 9.7     | 8,516   |       |       |    |       |
| パイロットコーポレーション       | 19.8    | 21.4  | 113,848   |       | 308   | 333.3  | 東京急行電鉄               | 155.3   | 168.1   | 609,272   |       |        | 東洋埠頭                   | 3.2   | 3.3     | 4,719   |       |       |    |       |
| 萩原工業                | 6.3     | 6.8   | 11,240    |       | 155.3 | 168.1  | 京浜急行電鉄               | 168.6   | 196.6   | 300,562   |       |        | 宇徳                     | 9.4   | 10.1    | 5,514   |       |       |    |       |
| トッパン・フォームズ          | 24.3    | 26.3  | 23,538    |       | 168.6 | 196.6  | 小田急電鉄                | 63.4    | 68.6    | 476,165   |       |        | 上組                     | 67.6  | 71.8    | 174,545 |       |       |    |       |
| フジテレビインターナショナル      | 25.4    | 27.4  | 110,148   |       | 63.4  | 68.6   | 京王電鉄                 | 78.9    | 92      | 420,518   |       |        | サンリツ                   | 2.8   | 2.9     | 2,012   |       |       |    |       |
| タカラトミー              | 47.5    | 51.4  | 61,731    |       | 78.9  | 92     | 京成電鉄                 | 15.5    | 16.7    | 324,760   |       |        | キムラユニティー               | 2.9   | 3.2     | 3,484   |       |       |    |       |
| 廣済堂                 | 10.6    | 11.4  | 8,835     |       | 15.5  | 16.7   | 富士急行                 | 2.9     | 3.1     | 59,118    |       |        | キューソー流通システム            | 3.1   | 3       | 6,171   |       |       |    |       |
| エステールホールディングス       | 3.4     | 3.5   | 2,310     |       | 2.9   | 3.1    | 新京成電鉄                | 20.3    | 21.8    | 6,441     |       |        | 近鉄エクスプレス               | 20.3  | 22      | 36,630  |       |       |    |       |
| アーク                 | 47.9    | 46.7  | 4,529     |       | 20.3  | 21.8   | 東日本旅客鉄道              | 102.3   | 110     | 2,216,912 |       |        | 東海運                    | 6.1   | 6.3     | 1,764   |       |       |    |       |
| タカノ                 | 5       | 4.9   | 4,135     |       | 102.3 | 110    | 西日本旅客鉄道              | 101.5   | 109.9   | 864,490   |       |        | エーアイティ                 | 7.7   | 7.5     | 7,627   |       |       |    |       |
| プロネクサス              | 10.6    | 10.5  | 12,201    |       | 101.5 | 109.9  | 東海旅客鉄道               | 144.5   | 156.3   | 2,596,387 |       |        | 内外トランスライン              | 3.8   | 3.8     | 5,449   |       |       |    |       |
| ホクシン                | 8.2     | 7.7   | 1,054     |       | 144.5 | 156.3  | 西武ホールディングス           | 16      | 19.6    | 302,284   |       |        | 日本コンセプト                | 2.1   | 3.2     | 3,206   |       |       |    |       |
| ウッドワン               | 3.8     | 4     | 4,148     |       | 16    | 19.6   | 鴻池運輸                 | 31.4    | 34      | 32,594    |       |        | <b>情報・通信業 (8.4%)</b>   |       |         |         |       |       |    |       |
| 大建工業                | 8.8     | 9.3   | 17,688    |       | 31.4  | 34     | 西日本鉄道                | 8       | 9.4     | 91,358    |       |        | NECネットエスアイ             | 12.3  | 13.4    | 33,567  |       |       |    |       |
| 凸版印刷                | 320     | 173.2 | 309,335   |       | 8     | 9.4    | ハマキョウレックス            | 107.4   | 116.1   | 35,720    |       |        | システナ                   | 8.9   | 43      | 46,784  |       |       |    |       |
| 大日本印刷               | 148.4   | 172.9 | 435,362   |       | 6     | 6.5    | サイキ引越センター            | 143.2   | 155     | 40,365    |       |        | デジタルアーツ                | 5.5   | 6.5     | 52,195  |       |       |    |       |
| 図書印刷                | 7.6     | 11.5  | 11,097    |       | 6     | 6.5    | 近鉄グループホールディングス       | 50.9    | 51.9    | 553,797   |       |        | 新日鉄住金ソリューションズ          | 17.5  | 18      | 52,776  |       |       |    |       |
| 共同印刷                | 3.5     | 3.9   | 9,126     |       | 143.2 | 155    | 阪急阪神ホールディングス         | 50.9    | 51.9    | 599,850   |       |        | キューブシステム               | 6.5   | 6.4     | 5,331   |       |       |    |       |
| N I S S H A         | 23.3    | 25.1  | 36,545    |       | 50.9  | 51.9   | 南海電気鉄道               | 47.8    | 51.8    | 151,288   |       |        | エイジア                   | 1.7   | 2.4     | 2,786   |       |       |    |       |
| 光村印刷                | 1       | 1     | 1,964     |       | 47.8  | 51.8   | 京阪ホールディングス           | 2.6     | 3       | 232,582   |       |        | コア                     | 4.7   | 5.1     | 6,732   |       |       |    |       |
| 宝印刷                 | 5.9     | 6.4   | 10,208    |       | 2.6   | 3      | 神戸電鉄                 | 83.3    | 93.1    | 11,685    |       |        | ソリトンシステムズ              | 3.7   | 6.8     | 5,691   |       |       |    |       |
| アックス                | 112.6   | 121.9 | 200,891   |       | 83.3  | 93.1   | 名古屋鉄道                | 8.3     | 9       | 269,338   |       |        | ソフトウエアホールディングス         | 5.4   | 5.2     | 7,753   |       |       |    |       |
| ツツミ                 | 3.5     | 3.9   | 7,569     |       | 8.3   | 9      | 山陽電気鉄道               | 42.2    | 45.6    | 18,972    |       |        | T I S                  | 37.1  | 40.1    | 199,898 |       |       |    |       |
| 小松ウォール工業            | 3.8     | 3.8   | 7,087     |       | 42.2  | 45.6   | 日本通運                 | 188.3   | 203.7   | 298,680   |       |        | ネオス                    | 3.4   | 4.1     | 4,239   |       |       |    |       |
| ヤマハ                 | 76.4    | 73    | 382,520   |       | 188.3 | 203.7  | ヤマトホールディングス          | 27.6    | 32.3    | 572,600   |       |        | 電算システム                 | 3.9   | 4.6     | 11,012  |       |       |    |       |
| 河合楽器製作所             | 3.8     | 3.8   | 12,711    |       | 27.6  | 32.3   | 丸運                   | 6       | 6.2     | 166,345   |       |        | グリー                    | 59.6  | 83.1    | 38,059  |       |       |    |       |
| クリナップ               | 10.5    | 11.5  | 7,130     |       | 6     | 6.2    | 丸全和運輸                | 38      | 9.4     | 1,847     |       |        | コーエーテックホールディングス        | 18.9  | 24.6    | 44,722  |       |       |    |       |
| ピジョン                | 68.5    | 74.2  | 325,738   |       | 38    | 9.4    | セルコグループホールディングス      | 64.6    | 64.1    | 25,774    |       |        | 三菱総合研究所                | 4.8   | 4.7     | 15,345  |       |       |    |       |
| 兼松サステック             | 0.9     | 0.8   | 1,240     |       | 64.6  | 64.1   | トナミホールディングス          | 2.6     | 2.8     | 54,933    |       |        | ポルテージ                  | 2.1   | 2.4     | 1,360   |       |       |    |       |
| キングダム               | 9.4     | 10.2  | 8,047     |       | 2.6   | 2.8    | ニッコンホールディングス         | 1.3     | 1.4     | 16,576    |       |        | 電算                     | 1.3   | 1.3     | 2,797   |       |       |    |       |
| リンテック               | 26.9    | 29.2  | 71,335    |       | 40.8  | 44.2   | 日本石油輸送               | 15.7    | 14.9    | 120,003   |       |        | A G S                  | 6.3   | 6.8     | 4,549   |       |       |    |       |
| イトーキ                | 23.9    | 22.6  | 12,723    |       | 1.3   | 1.4    | 福山通運                 | 80.4    | 87      | 3,977     |       |        | ファインデックス               | 9.3   | 10.1    | 6,787   |       |       |    |       |
| 任天堂                 | 69.8    | 75.5  | 2,213,282 |       | 80.4  | 87     | セイノールホールディングス        | 2.7     | 2.9     | 63,325    |       |        | ヒト・コミュニケーションズ          | 2.5   | 2.8     | 4,390   |       |       |    |       |
| 三菱鉛筆                | 18.7    | 20.2  | 46,460    |       | 2.7   | 2.9    | エスライン                | 23.6    | 25.6    | 130,761   |       |        | ブレインパッド                | 2.4   | 2.6     | 13,390  |       |       |    |       |
| タカラスタンダード           | 23.4    | 25.4  | 43,357    |       | 23.6  | 25.6   | 丸和運輸機関               | 5.7     | 6.1     | 3,468     |       |        | K L a b                | 21.6  | 21.4    | 18,254  |       |       |    |       |
| コクヨ                 | 54.4    | 58.9  | 94,416    |       | 5.7   | 6.1    | C&Fロジホールディングス        | 11.8    | 11.9    | 10,686    |       |        | ホトクワイクビトロホールディングス      | 8.1   | 16      | 13,872  |       |       |    |       |
| ナカバヤシ               | 11.1    | 12.3  | 6,678     |       | 11.8  | 11.9   | 九州旅客鉄道               | 90.1    | 97.6    | 77,440    |       |        | イーブイコミュニケーションズ         | 1.8   | 2       | 3,054   |       |       |    |       |
| グローブライド             | 5.1     | 5.9   | 15,027    |       | 90.1  | 97.6   |                      |         | 20,831  |           |       | ネクソン   | 124                    | 306.6 | 512,022 |         |       |       |    |       |
| オカムラ                | 39.6    | 42.9  | 54,483    |       |       |        |                      |         | 14,053  |           |       | アイスタイル | 27.9                   | 30.6  | 25,214  |         |       |       |    |       |
| 美津濃                 | 11.2    | 12.2  | 31,280    |       |       |        |                      |         | 348,920 |           |       | エムアツップ | 3.7                    | 4.2   | 7,492   |         |       |       |    |       |

| 銘柄                    | 期首(前期末) |       |         | 当期末   |         |         | 銘柄               | 期首(前期末) |       |         | 当期末   |       |         | 銘柄                 | 期首(前期末) |         |           | 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       |
| エイチーム                 |         | 千株    | 千円      |       | 千株      | 千円      | シンクロ・フード         |         | 千株    | 千円      |       | 千株    | 千円      | USEN-NEXT HOLDINGS |         | 千株      | 千円        |         | 千株      | 千円        |
| テクノスジャパン              | 7.6     | 7.5   | 13,560  | 7.6   | 7.5     | 13,560  | オークネット           | 0.9     | 5.1   | 3,366   | 0.9   | 5.1   | 3,366   | ワイヤレスゲート           | 2.9     | 4.6     | 4,259     | 2.9     | 4.6     | 4,259     |
| enish                 | 10.1    | 10.1  | 7,787   | 10.1  | 10.1    | 7,787   | AOI TYO HOLDINGS | 3.5     | 6.3   | 6,016   | 3.5   | 6.3   | 6,016   | コネクシオ              | 5.2     | 5.3     | 2,803     | 5.2     | 5.3     | 2,803     |
| コロプラ                  | 3.3     | 4.2   | 2,041   | 4.2   | 2,041   | 2,041   | マクロミル            | 9.1     | 13.1  | 10,807  | 9.1   | 13.1  | 10,807  | クロップス              | 7.9     | 8.6     | 12,160    | 7.9     | 8.6     | 12,160    |
| モバイルクリエイト             | 36.1    | 34.3  | 24,215  | 34.3  | 24,215  | 24,215  | オロ               | 10.4    | 21.3  | 32,887  | 10.4  | 21.3  | 32,887  | 日本通信               | 100.8   | 102.6   | 13,030    | 100.8   | 102.6   | 13,030    |
| オルトプラス                | 8.6     | -     | -       | -     | -       | -       | ソルクシーズ           | -       | 2.3   | 2,070   | -     | 2.3   | 2,070   | ソフトバンク             | 2.4     | 2.3     | 1,559     | 2.4     | 2.3     | 1,559     |
| ブロードリーフ               | 5.4     | 7.3   | 2,328   | 7.3   | 2,328   | 2,328   | フェイス             | -       | 1.1   | 5,203   | -     | 1.1   | 5,203   | 日本電信電話             | 798.5   | 823.5   | 3,817,746 | 798.5   | 823.5   | 3,817,746 |
| クロス・マーケティンググループ       | 27.6    | 59.7  | 33,790  | 59.7  | 33,790  | 33,790  | ハイマックス           | 4.3     | 5.1   | 3,391   | 4.3   | 5.1   | 3,391   | KDDI               | 1,001.9 | 1,061.1 | 2,820,934 | 1,001.9 | 1,061.1 | 2,820,934 |
| デジタルハーツホールディングス       | -       | 3.3   | 1,188   | 3.3   | 1,188   | 1,188   | 野村総合研究所          | 3.9     | 4.2   | 3,616   | 3.9   | 4.2   | 3,616   | 光通信                | -       | 957.3   | 1,250,233 | -       | 957.3   | 1,250,233 |
| メディアアドホールディングス        | 5.9     | 5.4   | 7,630   | 5.4   | 7,630   | 7,630   | サイバネットシステム       | 1.5     | 1.5   | 2,688   | 1.5   | 1.5   | 2,688   | N T T ドコモ          | 13.4    | 14.2    | 251,766   | 13.4    | 14.2    | 251,766   |
| じげん                   | 3.6     | 3.5   | 8,102   | 3.5   | 8,102   | 8,102   | CEホールディングス       | 74.4    | 76.5  | 318,622 | 74.4  | 76.5  | 318,622 | EMUティーアイ           | 823.7   | 864.6   | 2,208,620 | 823.7   | 864.6   | 2,208,620 |
| ブイキューブ                | -       | 12.8  | 7,347   | 12.8  | 7,347   | 7,347   | 日本システム技術         | 9.2     | 9.9   | 6,336   | 9.2   | 9.9   | 6,336   | GMOインターネット         | 15      | 14.1    | 8,586     | 15      | 14.1    | 8,586     |
| サイバーリンクス              | 6.9     | 6.3   | 2,305   | 6.3   | 2,305   | 2,305   | インテジホールディングス     | 3.2     | 3.2   | 2,272   | 3.2   | 3.2   | 2,272   | アイネット              | 40.5    | 43.8    | 68,809    | 40.5    | 43.8    | 68,809    |
| ディー・エル・イー             | 1.8     | 1.9   | 1,941   | 1.9   | 1,941   | 1,941   | 東邦システムサイエンス      | 1.4     | 2     | 3,012   | 1.4   | 2     | 3,012   | インプレスホールディングス      | 1.8     | 2.5     | 1,245     | 1.8     | 2.5     | 1,245     |
| フィックスターズ              | 5.1     | 7.5   | 1,110   | 7.5   | 1,110   | 1,110   | ソースネクスト          | 12.8    | 15.4  | 13,582  | 12.8  | 15.4  | 13,582  | カドカワ               | 32.4    | 35.1    | 41,733    | 32.4    | 35.1    | 41,733    |
| CARTA HOLDINGS        | 1.9     | 11.5  | 16,157  | 11.5  | 16,157  | 16,157  | インフォコム           | 3.8     | 3.7   | 3,367   | 3.8   | 3.7   | 3,367   | 学研ホールディングス         | 3.7     | 4.1     | 16,810    | 3.7     | 4.1     | 16,810    |
| オプティム                 | 5.7     | 6.4   | 6,752   | 6.4   | 6,752   | 6,752   | FIG              | 15.7    | 46.4  | 26,030  | 15.7  | 46.4  | 26,030  | ゼンリン               | 13.5    | 24      | 67,248    | 13.5    | 24      | 67,248    |
| セレス                   | 1.9     | 2.7   | 12,312  | 2.7   | 12,312  | 12,312  | アルテリア・ネットワークス    | -       | 4.9   | 19,110  | -     | 4.9   | 19,110  | 昭文社                | 5.1     | 5.4     | 2,430     | 5.1     | 5.4     | 2,430     |
| ペリサーブ                 | 3.4     | 4     | 6,040   | 4     | 6,040   | 6,040   | フォーカスシステムズ       | -       | 10.6  | 3,572   | -     | 10.6  | 3,572   | アイネット              | 9.5     | 9.7     | 1,455     | 9.5     | 9.7     | 1,455     |
| ティョーガイア               | 1.4     | 1.1   | 7,348   | 1.1   | 7,348   | 7,348   | フジ・メディア・ホールディングス | 6.3     | 8     | 8,328   | 6.3   | 8     | 8,328   | 東宝                 | 6.3     | 6.8     | 9,200     | 6.3     | 6.8     | 9,200     |
| セック                   | 11.1    | 12.1  | 24,030  | 12.1  | 24,030  | 24,030  | オービック            | 2.5     | 3.7   | 13,061  | 2.5   | 3.7   | 13,061  | 東映                 | 7.4     | 7.9     | 86,110    | 7.4     | 7.9     | 86,110    |
| 日本アジアグループ             | 1.1     | 2     | 7,440   | 2     | 7,440   | 7,440   | ジャストシステム         | 116.5   | 124.9 | 199,715 | 116.5 | 124.9 | 199,715 | エヌ・ティ・ティ・データ       | 73.2    | 79.2    | 312,048   | 73.2    | 79.2    | 312,048   |
| 豆蔵ホールディングス            | 11.7    | 12.8  | 4,595   | 12.8  | 4,595   | 4,595   | TDCソフト           | 35.1    | 41.8  | 427,196 | 35.1  | 41.8  | 427,196 | ピー・シー・エー           | 4.2     | 5.1     | 71,298    | 4.2     | 5.1     | 71,298    |
| テクノマトリックス             | 8.3     | 8.1   | 8,424   | 8.1   | 8,424   | 8,424   | ヤフー              | 18.1    | 17.1  | 39,723  | 18.1  | 17.1  | 39,723  | ビジネスプレイング太田昭       | 345.6   | 320.7   | 379,708   | 345.6   | 320.7   | 379,708   |
| プロシッパ                 | 6.1     | 8.6   | 16,847  | 8.6   | 16,847  | 16,847  | トレンドマイクロ         | 4.9     | 10.5  | 9,166   | 4.9   | 10.5  | 9,166   | DT S               | 1.7     | 1.6     | 3,211     | 1.7     | 1.6     | 3,211     |
| カネホ・オンライン・エンターテイメント   | 1.6     | 3.6   | 4,716   | 3.6   | 4,716   | 4,716   | インフォメーション・デバイス   | 802.3   | 785.1 | 244,166 | 802.3 | 785.1 | 244,166 | アイ・エス・ビー           | 1.9     | 2.1     | 4,111     | 1.9     | 2.1     | 4,111     |
| GMOベイトゲートウェイ          | 301.7   | 290.2 | 91,413  | 290.2 | 91,413  | 91,413  | 日本オラクル           | 54.3    | 64.2  | 362,730 | 54.3  | 64.2  | 362,730 | ジャストテック            | 11.6    | 13.5    | 56,362    | 11.6    | 13.5    | 56,362    |
| ザッパラス                 | 7.8     | 19.8  | 110,682 | 19.8  | 110,682 | 110,682 | アルファシステムズ        | 3.5     | 3.4   | 5,052   | 3.5   | 3.4   | 5,052   | S C S K            | 51.7    | 56      | 186,760   | 51.7    | 56      | 186,760   |
| システムリサーチ              | 5.5     | 5.9   | 2,194   | 5.9   | 2,194   | 2,194   | フューチャー           | 18      | 24.4  | 196,908 | 18    | 24.4  | 196,908 | 日本システムウェア          | 6.6     | 12.9    | 27,412    | 6.6     | 12.9    | 27,412    |
| インターネットエンシアティブ        | 18.1    | 19.6  | 52,645  | 19.6  | 52,645  | 52,645  | CAC Holdings     | 3.7     | 4     | 10,408  | 3.7   | 4     | 10,408  | アイネス               | 23.8    | 51.6    | 117,028   | 23.8    | 51.6    | 117,028   |
| ざくらインターネット            | 13.3    | 14.4  | 6,768   | 14.4  | 6,768   | 6,768   | ソフトバンク・テクノロジー    | 15.1    | 16.3  | 28,655  | 15.1  | 16.3  | 28,655  | T K C              | 2.2     | 2.4     | 4,576     | 2.2     | 2.4     | 4,576     |
| ザックス                  | -       | 4.1   | 5,174   | 4.1   | 5,174   | 5,174   | アイティフォー          | 8.4     | 9.1   | 8,745   | 8.4   | 9.1   | 8,745   | 富士ソフト              | 6.5     | 7       | 6,531     | 6.5     | 7       | 6,531     |
| GMOクラウド               | 2.5     | 2.7   | 9,504   | 2.7   | 9,504   | 9,504   | 東計電算             | 4.7     | 5.1   | 10,883  | 4.7   | 5.1   | 10,883  | N S D              | 25.7    | 31.8    | 147,075   | 25.7    | 31.8    | 147,075   |
| S R Aホールディングス         | 5.9     | 6.4   | 16,742  | 6.4   | 16,742  | 16,742  | エックスネット          | 3       | 3.3   | 2,719   | 3     | 3.3   | 2,719   | 日本システムウェア          | 3.7     | 4       | 8,020     | 3.7     | 4       | 8,020     |
| MINORソリューションズ         | 2.2     | 2.4   | 3,960   | 2.4   | 3,960   | 3,960   | 大塚商会             | 5.7     | 12.4  | 49,662  | 5.7   | 12.4  | 49,662  | アイネス               | 14.1    | 15.2    | 19,866    | 14.1    | 15.2    | 19,866    |
| システムインテグレータ           | 1.6     | 3.4   | 2,570   | 3.4   | 2,570   | 2,570   | サイボウズ            | 25.3    | 54.9  | 138,073 | 25.3  | 54.9  | 138,073 | T K C              | 10.4    | 10.1    | 39,491    | 10.4    | 10.1    | 39,491    |
| 朝日ネット                 | 10.2    | 10.1  | 5,191   | 10.1  | 5,191   | 5,191   | ソフトブレイン          | 13.6    | 14.6  | 12,059  | 13.6  | 14.6  | 12,059  | 富士ソフト              | 15.4    | 18      | 80,730    | 15.4    | 18      | 80,730    |
| e B A S E             | 2.2     | 3.7   | 6,378   | 3.7   | 6,378   | 6,378   | 電通国際情報サービス       | 2       | 1.8   | 5,436   | 2     | 1.8   | 5,436   | N S D              | 18.3    | 19.7    | 47,063    | 18.3    | 19.7    | 47,063    |
| アバント                  | -       | 3.2   | 4,265   | 3.2   | 4,265   | 4,265   | デジタルガレージ         | 1.8     | 2.3   | 1,945   | 1.8   | 2.3   | 1,945   | コナミホールディングス        | 45.5    | 49.3    | 217,413   | 45.5    | 49.3    | 217,413   |
| アドソル日進                | 4.3     | 4.3   | 7,271   | 4.3   | 7,271   | 7,271   | ウェアザーニューズ        | 33.4    | 65.1  | 262,027 | 33.4  | 65.1  | 262,027 | 日本システムウェア          | 3.2     | 4       | 7,256     | 3.2     | 4       | 7,256     |
| フリービット                | 7.4     | 7.9   | 7,394   | 7.9   | 7,394   | 7,394   | C I J            | 14.9    | 14.1  | 8,939   | 14.9  | 14.1  | 8,939   | J B Cホールディングス      | 8.8     | 9.5     | 16,216    | 8.8     | 9.5     | 16,216    |
| コムチュア                 | 5.7     | 6.7   | 19,892  | 6.7   | 19,892  | 19,892  | ネットワンシステムズ       | 8.9     | 9.5   | 4,854   | 8.9   | 9.5   | 4,854   | ソフトバンクグループ         | 9.8     | 12      | 30,672    | 9.8     | 12      | 30,672    |
| サイバーコム                | 2       | 2.2   | 5,152   | 2.2   | 5,152   | 5,152   | システムソフト          | 6.9     | 7.4   | 23,680  | 6.9   | 7.4   | 23,680  | 卸売業 (5.1%)         | 503.7   | 503.2   | 5,012,878 | 503.7   | 503.2   | 5,012,878 |
| アステリア                 | -       | 5.9   | 4,979   | 5.9   | 4,979   | 4,979   | イーエムシステムズ        | 20      | 23.5  | 66,881  | 20    | 23.5  | 66,881  | ハウスイ               | 0.9     | 0.9     | 784       | 0.9     | 0.9     | 784       |
| マークライズ                | -       | 4.2   | 6,102   | 4.2   | 6,102   | 6,102   | ウエザーニューズ         | 3.9     | 9.7   | 10,912  | 3.9   | 9.7   | 10,912  | 高千穂交易              | 4.3     | 4.7     | 4,667     | 4.3     | 4.7     | 4,667     |
| メディカル・データ・ビジョン        | 4.2     | 10.6  | 10,250  | 10.6  | 10,250  | 10,250  | 日本エンビコム          | 3.8     | 4.1   | 11,955  | 3.8   | 4.1   | 11,955  | 伊藤忠食品              | 2.7     | 2.9     | 13,862    | 2.7     | 2.9     | 13,862    |
| gumi                  | 12.8    | 13.9  | 8,896   | 13.9  | 8,896   | 8,896   | スカラ              | 8.8     | 9.5   | 7,666   | 8.8   | 9.5   | 7,666   | エレマテック             | 5.2     | 5.6     | 10,242    | 5.2     | 5.6     | 10,242    |
| ショーケース・ティービー          | 2.2     | 2.6   | 1,781   | 2.6   | 1,781   | 1,781   | IMAGICA GROUP    | 1.1     | 1.1   | 2,106   | 1.1   | 1.1   | 2,106   | J A L U X          | 3.2     | 3.4     | 8,466     | 3.2     | 3.4     | 8,466     |
| モバイルファクトリー            | 2.1     | 3.3   | 5,388   | 3.3   | 5,388   | 5,388   | ネットワンシステムズ       | 11.7    | 12.7  | 2,298   | 11.7  | 12.7  | 2,298   | あらた                | 5.5     | 6.9     | 29,111    | 5.5     | 6.9     | 29,111    |
| テラスカイ                 | -       | 0.7   | 2,863   | 0.7   | 2,863   | 2,863   | システムソフト          | 5.3     | 5.7   | 16,455  | 5.3   | 5.7   | 16,455  | トーマンデバイス           | 1.7     | 1.9     | 4,542     | 1.7     | 1.9     | 4,542     |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 1.7     | 5.3   | 6,927   | 5.3   | 6,927   | 6,927   | イーエムシステムズ        | 7.8     | 9.7   | 7,207   | 7.8   | 9.7   | 7,207   | 東京エレクトロニクス         | 4       | 4.4     | 8,078     | 4       | 4.4     | 8,078     |
| P C Iホールディングス         | 1.9     | 2.2   | 5,123   | 2.2   | 5,123   | 5,123   | イーエムシステムズ        | 9.4     | 10.2  | 5,344   | 9.4   | 10.2  | 5,344   | フィールズ              | 8.5     | 10.5    | 6,709     | 8.5     | 10.5    | 6,709     |
| パイプHD                 | 1.8     | 2     | 1,780   | 2     | 1,780   | 1,780   | イーエムシステムズ        | 45.4    | 42.7  | 107,219 | 45.4  | 42.7  | 107,219 | 双日                 | 660.7   | 667.4   | 274,968   | 660.7   | 667.4   | 274,968   |
| アイビシー                 | 1.2     | 2     | 2,574   | 2     | 2,574   | 2,574   | イーエムシステムズ        | 26.5    | 29.1  | 2,880   | 26.5  | 29.1  | 2,880   | アルフレッサホールディングス     | 124.1   | 134.3   | 398,736   | 124.1   | 134.3   | 398,736   |
| ネオジャパン                | -       | 2.3   | 2,201   | 2.3   | 2,201   | 2,201   | イーエムシステムズ        | 5.1     | 5.1   | 23,740  | 5.1   | 5.1   | 23,740  | 横浜冷凍               | 27      | 31.7    | 29,544    | 27      | 31.7    | 29,544    |
| P R T I M E S         | -       | 0.7   | 1,625   | 0.7   | 1,625   | 1,625   | イーエムシステムズ        | 18.9    | 18.4  | 16,964  | 18    |       |         |                    |         |         |           |         |         |           |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       |         | 当 期 末 |       |         | 銘柄              | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |       |       | 銘柄                | 期首(前期末) |       |         | 当 期 末 |       |         |
|------------------|---------|-------|---------|-------|-------|---------|-----------------|---------|-------|-----------|-------|-------|-------|-------------------|---------|-------|---------|-------|-------|---------|
|                  | 株       | 数     | 価 額     | 株     | 数     | 評 価 額   |                 | 株       | 数     | 株         | 数     | 評 価 額 | 株     |                   | 数       | 株     | 数       | 評 価 額 | 株     | 数       |
| メディアスホールディングス    |         | 千株    | 千円      |       | 千株    | 千円      | 三井物産            |         | 千株    | 千円        |       | 千株    | 千円    | 加藤産業              |         | 千株    | 千円      |       | 千株    | 千円      |
| UKCホールディングス      | 1.8     | 6.7   | 4,549   | 7.2   | 7.7   | 15,423  | 日本紙パルプ商事        | 948.7   | 995.7 | 1,737,496 | 1.8   | 17.4  | 18.9  | 北恵                | 17.4    | 18.9  | 61,708  | 7.2   | 7.7   | 2,168   |
| ジュテックホールディングス    | 2.6     | 2.7   | 2,716   | 2.6   | 2.7   | 2,716   | 日立エレクトロロジーズ     | 38.8    | 36.7  | 155,791   | 2.6   | 9.7   | 8.3   | イノテック             | 9.7     | 8.3   | 8,573   | 2.6   | 3     | 1,818   |
| 大光               | 3.2     | 3.4   | 3,872   | 3.2   | 3.4   | 3,872   | カメイ             | 14.5    | 15.8  | 18,391    | 3.2   | 10.5  | 11.4  | イエローハット           | 10.5    | 11.4  | 31,156  | 3.2   | 3.4   | 3,872   |
| OCH1ホールディングス     | 59      | 63.9  | 56,679  | 59    | 63.9  | 56,679  | 東都水産            | 1.7     | 1.8   | 4,467     | 59    | 11.2  | 11.1  | J Kホールディングス       | 11.2    | 11.1  | 6,282   | 59    | 63.9  | 56,679  |
| 黒谷               | —       | 2     | 980     | —     | 2     | 980     | OUGホールディングス     | 1.8     | 2.1   | 5,115     | —     | 9.3   | 10    | 日伝                | 9.3     | 10    | 15,630  | —     | 2     | 980     |
| Cominix          | 1.7     | 1.9   | 1,565   | 1.7   | 1.9   | 1,565   | スターゼン           | 4.4     | 4.5   | 18,090    | 1.7   | 9.5   | 9.2   | 北沢産業              | 9.5     | 9.2   | 2,668   | 1.7   | 1.9   | 1,565   |
| 三洋貿易             | 6.1     | 6.1   | 10,980  | 6.1   | 6.1   | 10,980  | 山善              | 43.6    | 47.2  | 51,967    | 6.1   | 6     | 6.6   | 杉本商事              | 6       | 6.6   | 11,244  | 6.1   | 6.1   | 10,980  |
| ピューティガレージ        | 1.5     | 1.8   | 2,853   | 1.5   | 1.8   | 2,853   | 椿本興業            | 2.5     | 2.7   | 9,895     | 1.5   | 14.7  | 17.1  | 因幡電機産業            | 14.7    | 17.1  | 78,660  | 1.5   | 1.8   | 2,853   |
| ワイン・パートナーズ       | 8.1     | 7.8   | 8,447   | 8.1   | 7.8   | 8,447   | 住友商事            | 704.4   | 714.7 | 1,159,600 | 8.1   | 5.1   | 5.4   | パイテックホールディングス     | 5.1     | 5.4   | 10,989  | 8.1   | 7.8   | 8,447   |
| ミタチ産業            | 2.6     | 2.9   | 2,114   | 2.6   | 2.9   | 2,114   | 内田洋行            | 5.1     | 5.5   | 12,303    | 2.6   | 3.7   | 4.1   | 東テク               | 3.7     | 4.1   | 9,343   | 2.6   | 2.9   | 2,114   |
| シッパヘルスケアホールディングス | 23.3    | 25.1  | 103,286 | 23.3  | 25.1  | 103,286 | 三菱商事            | 783.7   | 848   | 2,676,288 | 23.3  | 129.6 | 151.3 | ミスミグループ本社         | 129.6   | 151.3 | 394,439 | 23.3  | 25.1  | 103,286 |
| 明治電機工業           | 3.8     | 3.9   | 6,961   | 3.8   | 3.9   | 6,961   | 第一実業            | 5.1     | 5.5   | 19,112    | 3.8   | 9.6   | 8.7   | アルテック             | 9.6     | 8.7   | 1,931   | 3.8   | 3.9   | 6,961   |
| デリカフーズホールディングス   | 2.2     | 2.2   | 2,981   | 2.2   | 2.2   | 2,981   | キャノンマーケティングジャパン | 31.9    | 34.5  | 70,207    | 2.2   | 3.7   | 3.8   | タキヒヨー             | 3.7     | 3.8   | 6,809   | 2.2   | 2.2   | 2,981   |
| スターティアホールディングス   | 2.5     | 2.4   | 1,430   | 2.5   | 2.4   | 1,430   | 西華産業            | 6.9     | 6.8   | 10,329    | 2.5   | 1.8   | 2.1   | 戴王産業              | 1.8     | 2.1   | 2,679   | 2.5   | 2.4   | 1,430   |
| コメダホールディングス      | 20.6    | 27.7  | 58,391  | 20.6  | 27.7  | 58,391  | 佐藤商事            | 10      | 10.9  | 9,690     | 20.6  | 50.9  | 55.1  | スズケン              | 50.9    | 55.1  | 307,458 | 20.6  | 27.7  | 58,391  |
| 富士興産             | 4.1     | 4.6   | 2,953   | 4.1   | 4.6   | 2,953   | 菱洋エレクトロ         | 10.4    | 12.3  | 18,474    | 4.1   | 7.7   | 8.5   | ジェコス              | 7.7     | 8.5   | 8,882   | 4.1   | 4.6   | 2,953   |
| 協栄産業             | 1.4     | 1.4   | 2,114   | 1.4   | 1.4   | 2,114   | 東京産業            | 11.1    | 12.1  | 6,449     | 1.4   | 10.2  | 11.2  | ルネサスイーストン         | 10.2    | 11.2  | 4,816   | 1.4   | 1.4   | 2,114   |
| 小野建              | 9.7     | 10.6  | 17,797  | 9.7   | 10.6  | 17,797  | ユアサ商事           | 10.6    | 12.4  | 41,044    | 9.7   | 28.3  | 30.6  | 小売業 (4.9%)        | 28.3    | 30.6  | 204,102 | 9.7   | 10.6  | 17,797  |
| 南陽               | —       | 2.5   | 5,597   | —     | 2.5   | 5,597   | 神鋼商事            | 2.5     | 2.7   | 6,814     | —     | 8.4   | 9.2   | ローソン              | 8.4     | 9.2   | 40,296  | —     | 2.5   | 5,597   |
| 佐鳥電機             | 8.2     | 9     | 8,379   | 8.2   | 9     | 8,379   | 小林産業            | 7.6     | 7     | 1,953     | 8.2   | 8.7   | 9.4   | サンエー              | 8.7     | 9.4   | 19,270  | 8.2   | 9     | 8,379   |
| エコトレーディング        | 2.5     | 2.6   | 1,565   | 2.5   | 2.6   | 1,565   | 阪和興業            | 20.9    | 21    | 61,551    | 2.5   | 20.3  | 18.9  | カワチ薬品             | 20.3    | 18.9  | 118,125 | 2.5   | 2.6   | 1,565   |
| 伯東               | 6.8     | 8.3   | 9,835   | 6.8   | 8.3   | 9,835   | 正栄食品工業          | 6.2     | 6.4   | 18,137    | 6.8   | 4.9   | 4.8   | イービーシー・マート        | 4.9     | 4.8   | 3,926   | 6.8   | 8.3   | 9,835   |
| コンドーテック          | 8.9     | 9.4   | 9,099   | 8.9   | 9.4   | 9,099   | カナデン            | 10.7    | 11.7  | 14,601    | 8.9   | 11.7  | 12.7  | ハードオフコーポレーション     | 11.7    | 12.7  | 26,847  | 8.9   | 9.4   | 9,099   |
| 中山福              | 6.4     | 6.6   | 3,445   | 6.4   | 6.6   | 3,445   | 菱電商事            | 8       | 9.6   | 13,324    | 6.4   | 9.7   | 18.4  | アスフル              | 9.7     | 18.4  | 29,697  | 6.4   | 6.6   | 3,445   |
| ナガイレーベン          | 14.8    | 17.4  | 38,367  | 14.8  | 17.4  | 38,367  | フルサト工業          | 6.1     | 6.7   | 10,880    | 14.8  | 20.4  | 18.4  | ゲオホールディングス        | 20.4    | 18.4  | 29,697  | 14.8  | 17.4  | 38,367  |
| 三菱食品             | 12.3    | 13.4  | 39,114  | 12.3  | 13.4  | 39,114  | 岩谷産業            | 24.8    | 26.7  | 98,256    | 12.3  | 17.2  | 16.7  | アダストリア            | 17.2    | 16.7  | 31,963  | 12.3  | 13.4  | 39,114  |
| 松田産業             | 8.1     | 8.9   | 12,807  | 8.1   | 8.9   | 12,807  | すてきナイスグループ      | 4.8     | 5     | 4,315     | 8.1   | 6.7   | 7.4   | ジーフット             | 6.7     | 7.4   | 4,972   | 8.1   | 8.9   | 12,807  |
| 第一興商             | 16.6    | 18    | 93,960  | 16.6  | 18    | 93,960  | 昭光通商            | 40      | 4.4   | 2,802     | 16.6  | 1.5   | 1.5   | シー・ワイ・エス・ベイエリア    | 1.5     | 1.5   | 1,132   | 16.6  | 18    | 93,960  |
| メディカルホールディングス    | 111.9   | 130.5 | 329,121 | 111.9 | 130.5 | 329,121 | ニチモウ            | 1.7     | 1.9   | 3,629     | 111.9 | 6.6   | 7.1   | くらこポレクション         | 6.6     | 7.1   | 39,334  | 111.9 | 130.5 | 329,121 |
| S P K            | 2.4     | 2.5   | 5,690   | 2.4   | 2.5   | 5,690   | 極東貿易            | 16      | 14.8  | 6,156     | 2.4   | 5.3   | 5.7   | キャンドゥ             | 5.3     | 5.7   | 8,778   | 2.4   | 2.5   | 5,690   |
| 都電気ホールディングス      | 3.8     | 4.5   | 12,586  | 3.8   | 4.5   | 12,586  | イワキ             | 16      | 3.5   | 5,727     | 3.8   | 6.2   | 6.2   | バルグループホールディングス    | 6.2     | 6.2   | 18,817  | 3.8   | 4.5   | 12,586  |
| アズワン             | 8.7     | 8.7   | 68,730  | 8.7   | 8.7   | 68,730  | 三菱石油            | 30      | 32.4  | 30,067    | 8.7   | 43.4  | 51.1  | エディオン             | 51.1    | 50.78 | 50,078  | 8.7   | 8.7   | 68,730  |
| スズデン             | 3.9     | 4.3   | 6,798   | 3.9   | 4.3   | 6,798   | 稲畑産業            | 26.8    | 29    | 45,037    | 3.9   | 19.2  | 24.5  | サーヨーポレクション        | 19.2    | 24.5  | 13,989  | 3.9   | 4.3   | 6,798   |
| 尾家産業             | 3.3     | 3.4   | 3,940   | 3.3   | 3.4   | 3,940   | G S Iクレオス       | 3       | 3.2   | 3,872     | 3.3   | 4.5   | 4.1   | ワッツ               | 4.5     | 4.1   | 2,984   | 3.3   | 3.4   | 3,940   |
| シモジマ             | 6.8     | 7.4   | 8,443   | 6.8   | 7.4   | 8,443   | 明和産業            | 10.4    | 11.4  | 4,753     | 6.8   | 4.2   | 4.6   | ハローズ              | 4.2     | 4.6   | 10,483  | 6.8   | 7.4   | 8,443   |
| ドウシシャ            | 11.8    | 11.4  | 18,559  | 11.8  | 11.4  | 18,559  | ワキタ             | 23.8    | 25.8  | 29,695    | 11.8  | 2.4   | 2.7   | あみやき亭             | 2.4     | 2.7   | 9,612   | 11.8  | 11.4  | 18,559  |
| 小津産業             | 2.5     | 2.6   | 4,836   | 2.5   | 2.6   | 4,836   | 東邦ホールディングス      | 33.1    | 35.8  | 93,080    | 2.5   | 15.4  | 24.1  | ひらまつ              | 15.4    | 24.1  | 8,194   | 2.5   | 2.6   | 4,836   |
| 高速               | 6.6     | 7.3   | 7,738   | 6.6   | 7.3   | 7,738   | サンゲツ            | 37.7    | 36.5  | 74,679    | 6.6   | 2.7   | 2.8   | 大黒天物産             | 2.7     | 2.8   | 11,172  | 6.6   | 7.3   | 7,738   |
| たけびし             | 3.9     | 4.3   | 5,981   | 3.9   | 4.3   | 5,981   | ミツコグループホールディングス | 16.2    | 17.5  | 14,000    | 3.9   | 10.8  | 11.8  | ハニースホールディングス      | 10.8    | 11.8  | 11,174  | 3.9   | 4.3   | 5,981   |
| リップス             | 2.5     | 2.7   | 4,106   | 2.5   | 2.7   | 4,106   | シヤネンホールディングス    | 5.3     | 5     | 11,035    | 2.5   | 2.6   | 2.7   | ファーマリスホールディングス    | 2.6     | 2.7   | 1,514   | 2.5   | 2.7   | 4,106   |
| 丸文               | 9.9     | 10.7  | 7,564   | 9.9   | 10.7  | 7,564   | 伊藤忠エネクス         | 24.7    | 26.6  | 24,259    | 9.9   | 8.6   | 9.3   | アルペン              | 8.6     | 9.3   | 15,345  | 9.9   | 10.7  | 7,564   |
| ハピネット            | 7.6     | 10.1  | 15,846  | 7.6   | 10.1  | 15,846  | サンリオ            | 31.4    | 37.3  | 82,507    | 7.6   | 2.1   | 3.9   | ハブ                | 2.1     | 3.9   | 3,673   | 7.6   | 10.1  | 15,846  |
| 橋本総業ホールディングス     | 2.3     | 2.4   | 3,410   | 2.3   | 2.4   | 3,410   | サンワ テクノス        | 6.6     | 7.3   | 6,891     | 2.3   | 12.3  | 17.7  | クオールホールディングス      | 12.3    | 17.7  | 25,257  | 2.3   | 2.4   | 3,410   |
| 日本ライフライン         | 31.8    | 37.9  | 58,972  | 31.8  | 37.9  | 58,972  | リョーサン           | 14      | 13.4  | 41,071    | 31.8  | 7.6   | 8.1   | ジンズ               | 7.6     | 8.1   | 42,444  | 31.8  | 37.9  | 58,972  |
| タカショー            | —       | 6.1   | 2,641   | —     | 6.1   | 2,641   | 新光商事            | 12.3    | 11.4  | 21,181    | —     | 64.7  | 64.5  | ビッツカメラ            | 64.7    | 64.5  | 79,722  | —     | 6.1   | 2,641   |
| エクセル             | 4.5     | 4.5   | 9,553   | 4.5   | 4.5   | 9,553   | トーホー            | 5       | 5.5   | 11,297    | 4.5   | 60.2  | 65.1  | DCMホールディングス       | 60.2    | 65.1  | 72,521  | 4.5   | 4.5   | 9,553   |
| マルカカイ            | 3.6     | 4     | 7,836   | 3.6   | 4     | 7,836   | 三信電気            | 10.3    | 10    | 18,090    | 3.6   | 6     | 9.5   | ペッパーフードサービス       | 6       | 9.5   | 24,434  | 3.6   | 4     | 7,836   |
| I DOM            | 33.9    | 40.7  | 16,402  | 33.9  | 40.7  | 16,402  | 東陽テクニカ          | 12.9    | 14    | 12,166    | 33.9  | 39.7  | 76.3  | Monotaro          | 39.7    | 76.3  | 182,662 | 33.9  | 40.7  | 16,402  |
| 日本エム・ディ・エム       | 7.5     | 7     | 7,476   | 7.5   | 7     | 7,476   | モスフードサービス       | 14.6    | 15.9  | 43,263    | 7.5   | 2.5   | 2.5   | 東京一番フーズ           | 2.5     | 2.5   | 1,487   | 7.5   | 7     | 7,476   |
| 進和               | 6.6     | 7.1   | 14,966  | 6.6   | 7.1   | 14,966  | 加賀電子            | 10.1    | 12.1  | 24,611    | 6.6   | 2.4   | 2.7   | DDホールディングス        | 2.4     | 2.7   | 5,548   | 6.6   | 7.1   | 14,966  |
| エスケイジャパン         | 2.4     | 2.9   | 1,844   | 2.4   | 2.9   | 1,844   | ソーダニッカ          | 11.6    | 12.7  | 6,896     | 2.4   | 3.1   | 3.1   | きちりホールディングス       | 3.1     | 3.1   | 2,157   | 2.4   | 2.9   | 1,844   |
| ダイトロン            | 5.1     | 5.5   | 7,694   | 5.1   | 5.5   | 7,694   | 立花エレクトク         | 7.6     | 9     | 13,986    | 5.1   | 9.3   | 8.9   | アークソフサービスホールディングス | 9.3     | 8.9   | 18,245  | 5.1   | 5.5   | 7,694   |
| シークス             | 7.1     | 15.3  | 23,454  | 7.1   | 15.3  | 23,454  | フォーバル           | 4.9     | 5.3   | 4,478     | 7.1   | 133.4 | 154.5 | J. フロントリテイリング     | 133.4   | 154.5 | 186,945 | 7.1   | 15.3  | 23,454  |
| 田中商事             | 3.5     | 3.7   | 2,205   | 3.5   | 3.7   | 2,205   | P A L T A C     | 15.7    | 21.8  | 115,758   | 3.5   | 19.6  | 21.2  | ドット・イレブホールディングス   | 19.6    | 21.2  | 44,583  | 3.5   | 3.7   | 2,205   |
| オーハシテクニカ         | 6.3     | 6.8   | 9,520   | 6.3   | 6.8   | 9,520   | 三谷産業            | 12.1    | 14.4  | 3,916     | 6.3   | 46.2  | 50    | マツモトキヨシホールディングス   | 46.2    | 50    | 167,250 | 6.3   | 6.8   | 9,520   |
| 白銅               | 4       | 4     | 6,724   | 4     | 4     | 6,724   | 太平洋興発           | 4.7     | 4.9   | 3,572     | 4     | 5.8   | 6.3   |                   |         |       |         |       |       |         |

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |       |           | 銘柄               | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |       |           | 銘柄                 | 期首(前期末) |         |           | 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 |
| ティールライフ              |         | 千株    | 千円        |       | 千株    | 千円        | VTホールディングス       |         | 千株    | 千円        |       | 千株    | 千円        | 愛眼                 |         | 千株      | 千円        |         | 千株      | 千円        |
| エー・ピーカンパニー           | 1.5     | 1.6   | 1,427     | 1.6   | 1.6   | 1,427     | 魚力               | 37.8    | 41    | 17,015    | 37.8  | 41    | 17,015    | ケユーホールディングス        | 9.1     | 9.7     | 2,919     | 9.1     | 9.7     | 2,919     |
| チムエー                 | 2.2     | 2.3   | 1,053     | 2.3   | 2.3   | 1,053     | ポブラ              | 3.1     | 3.4   | 4,851     | 3.1   | 3.4   | 4,851     | 吉野家ホールディングス        | 5.8     | 6.2     | 4,848     | 5.8     | 6.2     | 4,848     |
| シュッピン                | 3.4     | 3.8   | 9,591     | 3.8   | 3.8   | 9,591     | フジ・コーポレーション      | 3       | 3.1   | 1,819     | 3     | 3.1   | 1,819     | 松屋ホールディングス         | 36.7    | 42.3    | 74,659    | 36.7    | 42.3    | 74,659    |
| ネクステージ               | 6.8     | 8.1   | 5,904     | 8.1   | 8.1   | 5,904     | ユナイテッドアローズ       | 1.9     | 2.5   | 5,120     | 1.9   | 2.5   | 5,120     | 関西スーパーマーケット        | 5.4     | 5.8     | 20,590    | 5.4     | 5.8     | 20,590    |
| ジョイフル本田              | 11.4    | 18.6  | 17,279    | 18.6  | 18.6  | 17,279    | ハイデイ日高           | 13.8    | 13.9  | 52,333    | 13.8  | 13.9  | 52,333    | サガミホールディングス        | 14.9    | 16.2    | 21,448    | 14.9    | 16.2    | 21,448    |
| 扇真族                  | 16.4    | 35.4  | 48,568    | 35.4  | 35.4  | 48,568    | 京都ぎもの友禅          | 12.2    | 15.9  | 34,757    | 12.2  | 15.9  | 34,757    | 王将フードサービス          | 8.4     | 9.2     | 9,089     | 8.4     | 9.2     | 9,089     |
| キリン堂ホールディングス         | 4.1     | 4     | 7,024     | 4     | 4     | 7,024     | ココロイド            | 7.3     | 7.7   | 3,226     | 7.3   | 7.7   | 3,226     | プレナス               | 8.2     | 8.9     | 63,813    | 8.2     | 8.9     | 63,813    |
| ホットランド               | 3.9     | 4.8   | 6,897     | 4.8   | 4.8   | 6,897     | ピーシーダゴコーポレーション   | 37.1    | 40.2  | 94,952    | 37.1  | 40.2  | 94,952    | ミニストップ             | 12.5    | 13.6    | 24,792    | 12.5    | 13.6    | 24,792    |
| すかいらーくホールディングス       | 6.5     | 6.3   | 7,938     | 6.3   | 6.3   | 7,938     | トッパカルチャー         | 16.7    | 16    | 6,960     | 16.7  | 16    | 6,960     | アークス               | 8.3     | 9       | 17,379    | 8.3     | 9       | 17,379    |
| 綿半ホールディングス           | 69.3    | 112.6 | 204,256   | 112.6 | 112.6 | 204,256   | PLANT            | 7.9     | 8.6   | 39,259    | 7.9   | 8.6   | 39,259    | パローホールディングス        | 20.9    | 22.7    | 55,319    | 20.9    | 22.7    | 55,319    |
| ヨシックス                | 4.2     | 4.5   | 9,103     | 4.5   | 4.5   | 9,103     | スキホールディングス       | 4.1     | 4.6   | 1,329     | 4.1   | 4.6   | 1,329     | 藤久                 | 26      | 26.1    | 70,835    | 26      | 26.1    | 70,835    |
| コナカ                  | 1.8     | 2     | 6,060     | 2     | 2     | 6,060     | ヴィア・ホールディングス     | 2.6     | 2.9   | 2,917     | 2.6   | 2.9   | 2,917     | ベルク                | 0.9     | 0.9     | 674       | 0.9     | 0.9     | 674       |
| コナカ                  | 37.1    | 35.2  | 41,360    | 35.2  | 35.2  | 41,360    | スクロール            | 24.5    | 26.5  | 121,502   | 24.5  | 26.5  | 121,502   | 大 庄                | 5       | 5.9     | 28,674    | 5       | 5.9     | 28,674    |
| ブックオフコーポレーション        | 6.4     | -     | -         | -     | -     | -         | ユンディーホールディングス    | 9.8     | 14.8  | 9,723     | 9.8   | 14.8  | 9,723     | ファーストリテイリング        | 6       | 6.5     | 9,925     | 6       | 6.5     | 9,925     |
| コナカ                  | 4.5     | 4.9   | 3,332     | 4.9   | 4.9   | 3,332     | ユニバーサルホールディングス   | 17.4    | 18.6  | 7,235     | 17.4  | 18.6  | 7,235     | サンドラッグ             | 18.7    | 16.2    | 777,924   | 18.7    | 16.2    | 777,924   |
| BEENOS               | 1.5     | 2.8   | 3,029     | 2.8   | 2.8   | 3,029     | ユニバーサルホールディングス   | 11.4    | 13.5  | 29,038    | 11.4  | 13.5  | 29,038    | サックスホールディングス       | 47.3    | 45.4    | 157,084   | 47.3    | 45.4    | 157,084   |
| あさひ                  | 8.3     | 10    | 15,080    | 10    | 10    | 15,080    | ユニバーサルホールディングス   | 35.7    | 33.8  | 425,880   | 35.7  | 33.8  | 425,880   | ヤマザウ               | 10.5    | 10.2    | 11,046    | 10.5    | 10.2    | 11,046    |
| 日本調剤                 | 3.9     | 4.3   | 16,813    | 4.3   | 4.3   | 16,813    | 木曾路              | 13.7    | 14.8  | 36,570    | 13.7  | 14.8  | 36,570    | やまや                | 2.3     | 2.4     | 4,260     | 2.3     | 2.4     | 4,260     |
| コスモス薬品               | 5.6     | 5.3   | 109,816   | 5.3   | 5.3   | 109,816   | SRSホールディングス      | 13.2    | 14.3  | 14,271    | 13.2  | 14.3  | 14,271    | ベルーナ               | 2.3     | 2.1     | 4,741     | 2.3     | 2.1     | 4,741     |
| トーエル                 | 5.5     | 5.8   | 4,007     | 5.8   | 5.8   | 4,007     | 千趣会              | 20.2    | 21.9  | 5,037     | 20.2  | 21.9  | 5,037     | 島根銀行               | 27.4    | 29.6    | 25,633    | 27.4    | 29.6    | 25,633    |
| 一六堂                  | 2.5     | -     | -         | -     | -     | -         | タカキュー            | 9       | 9.2   | 1,692     | 9     | 9.2   | 1,692     | 新生銀行               | 2.4     | 2.7     | 1,871     | 2.4     | 2.7     | 1,871     |
| オンリー                 | 1.7     | 2.2   | 2,217     | 2.2   | 2.2   | 2,217     | ケーヨー             | 20.7    | 22.4  | 11,760    | 20.7  | 22.4  | 11,760    | じもとホールディングス        | 75.7    | 82.1    | 9,852     | 75.7    | 82.1    | 9,852     |
| セブン&アイ・ホールディングス      | 468.1   | 506.6 | 2,415,468 | 506.6 | 506.6 | 2,415,468 | 上新電機             | 13.2    | 14.3  | 33,161    | 13.2  | 14.3  | 33,161    | めざきフィナンシャルグループ     | 581.1   | 628.6   | 184,808   | 581.1   | 628.6   | 184,808   |
| 薬王堂                  | 4.9     | 5.2   | 13,119    | 5.2   | 5.2   | 13,119    | 日本瓦斯             | 19.5    | 19.6  | 81,046    | 19.5  | 19.6  | 81,046    | めざきほしフィナンシャルグループ   | 15.1    | 16.3    | 25,313    | 15.1    | 16.3    | 25,313    |
| クワイエット・レストランホールディングス | 30      | 32.6  | 40,424    | 32.6  | 32.6  | 40,424    | ロイヤルホールディングス     | 20.8    | 21.4  | 56,538    | 20.8  | 21.4  | 56,538    | 九州フィナンシャルグループ      | 183.4   | 198.5   | 87,538    | 183.4   | 198.5   | 87,538    |
| ツルハホールディングス          | 24.2    | 26.2  | 259,380   | 26.2  | 26.2  | 259,380   | 東天虹              | 0.8     | 0.8   | 1,038     | 0.8   | 0.8   | 1,038     | ゆうちょ銀行             | 316.8   | 343.1   | 430,247   | 316.8   | 343.1   | 430,247   |
| サマルクホールディングス         | 8.8     | 9.5   | 23,674    | 9.5   | 9.5   | 23,674    | いなげや             | 12.4    | 13.6  | 18,890    | 12.4  | 13.6  | 18,890    | 富士第一銀行             | 28.5    | 29.2    | 11,008    | 28.5    | 29.2    | 11,008    |
| フェリシモ                | 2.9     | 2.7   | 2,926     | 2.7   | 2.7   | 2,926     | 島忠               | 27      | 27.3  | 83,811    | 27    | 27.3  | 83,811    | ココロシティフィナンシャルグループ  | 68.0    | 77.0    | 339,878   | 68.0    | 77.0    | 339,878   |
| トリドールホールディングス        | 13.8    | 14.9  | 29,338    | 14.9  | 14.9  | 29,338    | チヨダ              | 13.2    | 12.7  | 23,583    | 13.2  | 12.7  | 23,583    | 西日本フィナンシャルホールディングス | 75.8    | 77.4    | 74,304    | 75.8    | 77.4    | 74,304    |
| TOKYO BASE           | 2.2     | 10.7  | 9,223     | 10.7  | 10.7  | 9,223     | ライフコーポレーション      | 8.5     | 9.2   | 22,512    | 8.5   | 9.2   | 22,512    | 関西フィナンシャルホールディングス  | -       | 56.8    | 45,326    | -       | 56.8    | 45,326    |
| ウィルプラスホールディングス       | -       | 1.1   | 843       | 1.1   | 1.1   | 843       | リンガーハット          | 13.8    | 14.9  | 34,985    | 13.8  | 14.9  | 34,985    | 三十三フィナンシャルグループ     | -       | 10.4    | 16,650    | -       | 10.4    | 16,650    |
| ジャパネット               | -       | 4.6   | 7,787     | 4.6   | 4.6   | 7,787     | さかきグループホールディングス  | 10      | -     | -         | 10    | -     | -         | 野村證券フィナンシャルグループ    | -       | 21      | 62,958    | -       | 21      | 62,958    |
| サツドラホールディングス         | 1.5     | 2     | 3,666     | 2     | 2     | 3,666     | MrMa x HD        | 14      | 16.6  | 8,316     | 14    | 16.6  | 8,316     | 新生銀行               | 96.8    | 88.8    | 128,582   | 96.8    | 88.8    | 128,582   |
| デファクトスタンダード          | -       | 0.7   | 277       | 0.7   | 0.7   | 277       | テンアライド           | 10.6    | 11.5  | 4,531     | 10.6  | 11.5  | 4,531     | あおぞら銀行             | 66.6    | 67.5    | 210,600   | 66.6    | 67.5    | 210,600   |
| ダイエー・リテールホールディングス    | 5.2     | 6.5   | 6,376     | 6.5   | 6.5   | 6,376     | AOKIホールディングス     | 22.3    | 24.2  | 30,371    | 22.3  | 24.2  | 30,371    | 三井住友フィナンシャルグループ    | 7,901.7 | 8,428.8 | 4,872,689 | 7,901.7 | 8,428.8 | 4,872,689 |
| パロックスジャパンリミテッド       | 8.9     | 9.7   | 8,778     | 9.7   | 9.7   | 8,778     | オーワーク            | 16      | 17.2  | 17,905    | 16    | 17.2  | 17,905    | りそなホールディングス        | 1,227.4 | 1,328   | 687,505   | 1,227.4 | 1,328   | 687,505   |
| グスリのアオキホールディングス      | 8.9     | 12    | 86,520    | 12    | 12    | 86,520    | コメリ              | 17.2    | 18.7  | 51,574    | 17.2  | 18.7  | 51,574    | 三井住友トラスト・ホールディングス  | 219.9   | 237.9   | 971,107   | 219.9   | 237.9   | 971,107   |
| カノ源ホールディングス          | -       | 3.4   | 2,652     | 3.4   | 3.4   | 2,652     | 青山商事             | 21.4    | 21.1  | 57,265    | 21.4  | 21.1  | 57,265    | 三井住友フィナンシャルグループ    | 846.5   | 853     | 3,350,584 | 846.5   | 853     | 3,350,584 |
| スロローホールディングス         | 10.7    | 13.3  | 86,450    | 13.3  | 13.3  | 86,450    | しまむら             | 13      | 14.1  | 133,950   | 13    | 14.1  | 133,950   | 第四銀行               | 13.7    | -       | -         | 13.7    | -       | -         |
| LIXILビバ              | 10.6    | 10.2  | 14,983    | 10.2  | 10.2  | 14,983    | はせがわ             | 5.9     | 6.1   | 2,403     | 5.9   | 6.1   | 2,403     | 北越銀行               | 11.2    | -       | -         | 11.2    | -       | -         |
| メディカルシステムネットワーク      | 12.7    | 12.9  | 5,830     | 12.9  | 12.9  | 5,830     | 高島屋              | 175     | 94.7  | 135,610   | 175   | 94.7  | 135,610   | 千葉銀行               | 401     | 428.7   | 288,943   | 401     | 428.7   | 288,943   |
| 総合メディカル              | 4.9     | -     | -         | -     | -     | -         | 松屋               | 22.5    | 24.3  | 25,636    | 22.5  | 24.3  | 25,636    | 群馬銀行               | 227.1   | 242     | 112,046   | 227.1   | 242     | 112,046   |
| はるやまホールディングス         | 5.2     | 5.5   | 4,526     | 5.5   | 5.5   | 4,526     | エイチ・ツー・オー リテイリング | 52.9    | 62.1  | 95,261    | 52.9  | 62.1  | 95,261    | 武蔵野銀行              | 17.8    | 18      | 43,182    | 17.8    | 18      | 43,182    |
| ノジマ                  | 19.6    | 21.6  | 42,098    | 21.6  | 21.6  | 42,098    | 近鉄百貨店            | 4.3     | 4.7   | 15,933    | 4.3   | 4.7   | 15,933    | 千葉興業銀行             | 30.8    | 33.3    | 11,322    | 30.8    | 33.3    | 11,322    |
| カッパ・クワイエット           | 13.9    | 16.9  | 23,085    | 16.9  | 16.9  | 23,085    | パルコ              | 10.7    | 11.7  | 12,343    | 10.7  | 11.7  | 12,343    | 筑波銀行               | 46.6    | 50.4    | 10,735    | 46.6    | 50.4    | 10,735    |
| ライトオン                | 9.4     | 10.2  | 8,282     | 10.2  | 10.2  | 8,282     | 丸井グループ           | 107     | 102.3 | 206,134   | 107   | 102.3 | 206,134   | 七十七銀行              | 35.1    | 37.9    | 68,182    | 35.1    | 37.9    | 68,182    |
| ジーンズメイト              | 3.4     | 3.7   | 1,439     | 3.7   | 3.7   | 1,439     | アクシアル リテイリング     | 9.3     | 10    | 34,350    | 9.3   | 10    | 34,350    | 青森銀行               | 8.7     | 9.4     | 24,947    | 8.7     | 9.4     | 24,947    |
| 良品計画                 | 14.8    | 17.1  | 458,622   | 17.1  | 17.1  | 458,622   | 井筒屋              | 6.3     | 6.4   | 1,267     | 6.3   | 6.4   | 1,267     | 秋田銀行               | 7.2     | 7.7     | 16,285    | 7.2     | 7.7     | 16,285    |
| 三城ホールディングス           | 13.8    | 15.1  | 6,160     | 15.1  | 15.1  | 6,160     | イオン              | 429.7   | 465.1 | 1,040,196 | 429.7 | 465.1 | 1,040,196 | 山形銀行               | 12.6    | 13.7    | 26,098    | 12.6    | 13.7    | 26,098    |
| アドヴァン                | 11.4    | 18.6  | 18,432    | 18.6  | 18.6  | 18,432    | イズミ              | 20.2    | 24.5  | 130,830   | 20.2  | 24.5  | 130,830   | 岩手銀行               | 7.8     | 8.5     | 27,497    | 7.8     | 8.5     | 27,497    |
| アルビス                 | 2.5     | 4.6   | 10,925    | 4.6   | 4.6   | 10,925    | 東武ストア            | 1.3     | -     | -         | 1.3   | -     | -         | 東邦銀行               | 99.9    | 108.2   | 32,676    | 99.9    | 108.2   | 32,676    |
| コナカ                  | 14.3    | 15.7  | 6,923     | 15.7  | 15.7  | 6,923     | 平和堂              | 22.7    | 24.5  | 61,127    | 22.7  | 24.5  | 61,127    | 東北銀行               | 5.8     | 6.3     | 6,659     | 5.8     | 6.3     | 6,659     |
| ハウス オブ ローゼ           | 3.4     | 1.5   | 2,755     | 1.5   | 1.5   | 2,755     | フジ               | 13.1    | 14.6  | 26,980    | 13.1  | 14.6  | 26,980    | みちのく銀行             | 7.2     | 7.7     | 12,435    | 7.2     | 7.7     | 12,435    |
| G-7ホールディングス          | 1.3     | 3.5   | 8,011     | 3.5   | 3.5   | 8,011     | ヤオコー             | 12.7    | 13.8  | 80,454    | 12.7  | 13.8  | 80,454    | ふくおかフィナンシャルグループ    | 454     | 98.3    | 229,235   | 454     | 98.3    | 229,235   |
| イオン北海道               | 11.2    | 1     |           |       |       |           |                  |         |       |           |       |       |           |                    |         |         |           |         |         |           |

| 銘柄                       | 期首(前期末)  |          |           | 当 期 末     |       |    | 銘柄                       | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |   |    | 銘柄                  | 期首(前期末)   |       |           | 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 |
|                          |          | 千株       |           | 千株        |       | 千円 |                          |         | 千株    |           | 千株    |   | 千円 |                     |           | 千株    |           | 千株        |   | 千株 |   | 千円    |
| 百五銀行                     | 107.3    | 108.8    | 40,256    | 40,256    |       |    | <b>保険業 (2.3%)</b>        |         |       |           |       |   |    |                     | シーアールイー   | 1.8   | 4         | 3,612     |   |    |   |       |
| 京都銀行                     | 42.7     | 43.4     | 194,649   | 194,649   |       |    | かんぽ生命保険                  | 42.2    | 45.7  | 113,244   |       |   |    |                     | プロバリエーション | -     | 1.1       | 1,300     |   |    |   |       |
| 紀陽銀行                     | 42.2     | 42.9     | 65,250    | 65,250    |       |    | SOMPホールディングス             | 219.3   | 213.3 | 853,839   |       |   |    |                     | ケイイスター不動産 | 4     | 3.2       | 6,092     |   |    |   |       |
| 三重銀行                     | 5        | -        | -         | -         |       |    | アニコム ホールディングス            | 7.6     | 9.4   | 27,664    |       |   |    |                     | アグレ都市デザイン | -     | 1.5       | 915       |   |    |   |       |
| ほくふくフィナンシャルグループ          | 74.4     | 80.6     | 97,284    | 97,284    |       |    | MS&ADインフラストラクチャーホールディングス | 292.4   | 316.5 | 1,019,763 |       |   |    |                     | グッドコムアセット | -     | 2.2       | 3,399     |   |    |   |       |
| 広島銀行                     | 165.1    | 178.5    | 107,635   | 107,635   |       |    | ソニーフィナンシャルホールディングス       | 91.9    | 99.4  | 208,143   |       |   |    |                     | ジェイ・エス・ビー | -     | 0.4       | 1,570     |   |    |   |       |
| 山陰合同銀行                   | 66.3     | 71.8     | 54,137    | 54,137    |       |    | 第一生命ホールディングス             | 632.7   | 684.7 | 1,195,143 |       |   |    |                     | パーク24     | 62    | 70.6      | 184,124   |   |    |   |       |
| 中国銀行                     | 77.3     | 78.1     | 78,334    | 78,334    |       |    | 東京海上ホールディングス             | 421.3   | 438.8 | 2,343,630 |       |   |    |                     | パラカ       | 3.6   | 3.1       | 5,266     |   |    |   |       |
| 鳥取銀行                     | 3.6      | 4.3      | 5,779     | 5,779     |       |    | T&Dホールディングス              | 345.9   | 374.2 | 506,105   |       |   |    |                     | 三井不動産     | 558.5 | 642.2     | 1,702,793 |   |    |   |       |
| 伊予銀行                     | 159.6    | 160.3    | 95,218    | 95,218    |       |    | アドバンスクリエイト               | 2.6     | 2.8   | 4,958     |       |   |    |                     | 三菱地所      | 832.5 | 847.9     | 1,617,793 |   |    |   |       |
| 百十四銀行                    | 119      | 12.9     | 31,243    | 31,243    |       |    | <b>その他金融業 (1.2%)</b>     |         |       |           |       |   |    | 平和不動産               | 19.8      | 23    | 47,564    |           |   |    |   |       |
| 四国銀行                     | 17.1     | 17.3     | 17,697    | 17,697    |       |    | 全国保証                     | 31.5    | 34.1  | 133,331   |       |   |    |                     | 東京建物      | 122.2 | 132.2     | 176,883   |   |    |   |       |
| 阿波銀行                     | 90       | 19.4     | 58,976    | 58,976    |       |    | ジェイリース                   | -       | 2.6   | 949       |       |   |    | ダイビル                | 28.8      | 35.6  | 38,092    |           |   |    |   |       |
| 大分銀行                     | 6.4      | 7.4      | 24,198    | 24,198    |       |    | イントラスト                   | -       | 3.4   | 1,485     |       |   |    | 京阪神ビルディング           | 18.6      | 21.7  | 19,356    |           |   |    |   |       |
| 宮崎銀行                     | 7.4      | 8        | 21,120    | 21,120    |       |    | 日本モーゲージサービス              | -       | 1.6   | 2,118     |       |   |    | 住友不動産               | 268       | 272   | 1,120,640 |           |   |    |   |       |
| 佐賀銀行                     | 6.8      | 7.3      | 12,577    | 12,577    |       |    | C A S A                  | -       | 4.1   | 4,739     |       |   |    | 大京                  | 17.8      | -     | -         |           |   |    |   |       |
| 十八銀行                     | 69       | 7.4      | 19,158    | 19,158    |       |    | アルヒ                      | 9.6     | 11    | 25,300    |       |   |    | テーオーシー              | 38.6      | 27.7  | 22,935    |           |   |    |   |       |
| 沖縄銀行                     | 10.9     | 11.1     | 34,798    | 34,798    |       |    | プレミアグループ                 | -       | 2.5   | 7,975     |       |   |    | 東京楽天地               | 1.8       | 1.9   | 8,787     |           |   |    |   |       |
| 琉球銀行                     | 21.7     | 27.9     | 29,685    | 29,685    |       |    | クレディセゾン                  | 84.9    | 84.7  | 118,749   |       |   |    | レオパレス21             | 133.5     | 149.3 | 76,889    |           |   |    |   |       |
| セブン銀行                    | 419.5    | 408.8    | 139,400   | 139,400   |       |    | アクリーティブ                  | 6.3     | -     | -         |       |   |    | スターツコボレーション         | 15.2      | 16.4  | 40,508    |           |   |    |   |       |
| みずほフィナンシャルグループ           | 15,195.2 | 16,445.7 | 2,851,684 | 2,851,684 |       |    | 芙蓉総合リース                  | 12.8    | 13.9  | 75,338    |       |   |    | フジ住宅                | 14.3      | 15.4  | 13,167    |           |   |    |   |       |
| 高知銀行                     | 4.1      | 4.5      | 3,312     | 3,312     |       |    | 興銀リース                    | 21      | 22.7  | 57,113    |       |   |    | 空港施設                | 11.7      | 14.4  | 7,804     |           |   |    |   |       |
| 山口フィナンシャルグループ            | 105      | 151.1    | 165,152   | 165,152   |       |    | 東京センチュリー                 | 22.5    | 24.4  | 122,976   |       |   |    | 明和地所                | 6.2       | 6.7   | 4,087     |           |   |    |   |       |
| 長野銀行                     | 3        | 4.1      | 6,154     | 6,154     |       |    | 日本証券金融                   | 45.8    | 53.3  | 32,353    |       |   |    | ゴールドクレスト            | 8.8       | 9.5   | 15,333    |           |   |    |   |       |
| 名古屋銀行                    | 9.7      | 9.8      | 31,556    | 31,556    |       |    | アイフル                     | 187.8   | 184.4 | 51,263    |       |   |    | 日本エスリード             | 4.4       | 4.7   | 7,440     |           |   |    |   |       |
| 北洋銀行                     | 168.6    | 182.3    | 51,773    | 51,773    |       |    | リコーリース                   | 8.8     | 9.5   | 32,347    |       |   |    | 日神不動産               | 14.9      | 17.8  | 7,938     |           |   |    |   |       |
| 愛知銀行                     | 3.8      | 4.4      | 14,960    | 14,960    |       |    | イオンフィナンシャルサービス           | 79.4    | 77.2  | 162,274   |       |   |    | 日本エスコ               | 20.1      | 21.9  | 17,979    |           |   |    |   |       |
| 第三銀行                     | 6.3      | -        | -         | -         |       |    | アコム                      | 224.9   | 243.2 | 88,768    |       |   |    | タカラレーベン             | 52.4      | 56.6  | 19,753    |           |   |    |   |       |
| 中京銀行                     | 4.6      | 5        | 10,660    | 10,660    |       |    | ジャックス                    | 13.6    | 13.4  | 25,285    |       |   |    | サンヨーハウジング名古屋        | 5.8       | 6.8   | 6,276     |           |   |    |   |       |
| 大光銀行                     | 3.8      | 4        | 6,564     | 6,564     |       |    | オリエントコーポレーション            | 242.1   | 327.1 | 39,906    |       |   |    | イオンモール              | 72.1      | 60.6  | 111,988   |           |   |    |   |       |
| 愛媛銀行                     | 15.6     | 16.9     | 17,491    | 17,491    |       |    | 日立キャピタル                  | 30.8    | 28.6  | 70,070    |       |   |    | ファースト住建             | 4.2       | 4.6   | 5,345     |           |   |    |   |       |
| トマト銀行                    | 4.3      | 4.8      | 5,020     | 5,020     |       |    | アプラスフィナンシャル              | 54.4    | 58.7  | 4,813     |       |   |    | ランド                 | 241.4     | 492.6 | 4,433     |           |   |    |   |       |
| みなと銀行                    | 10.1     | -        | -         | -         |       |    | オリックス                    | 746     | 807.5 | 1,328,337 |       |   |    | カチヤス                | 11.4      | 13.5  | 47,452    |           |   |    |   |       |
| 京葉銀行                     | 99       | 53.4     | 34,977    | 34,977    |       |    | 三菱UFJリース                 | 283.9   | 273.1 | 153,209   |       |   |    | トーセイ                | 13.6      | 16.6  | 17,944    |           |   |    |   |       |
| 関西アーバン銀行                 | 15.6     | -        | -         | -         |       |    | 九州リースサービス                | 4.8     | 5.9   | 4,082     |       |   |    | 穴吹興産                | 1.2       | 1.3   | 3,602     |           |   |    |   |       |
| 栃木銀行                     | 57.9     | 62.7     | 14,295    | 14,295    |       |    | 日本取引所グループ                | 328.6   | 326.8 | 615,691   |       |   |    | エヌ・ティ・ティ都市開発        | 69.5      | -     | -         |           |   |    |   |       |
| 北日本銀行                    | 3.5      | 3.9      | 7,959     | 7,959     |       |    | イー・ギャランティ                | 3       | 11.3  | 12,068    |       |   |    | サンフロンティア不動産         | 12.6      | 16.7  | 20,958    |           |   |    |   |       |
| 東和銀行                     | 19.6     | 21.2     | 14,416    | 14,416    |       |    | アサックス                    | 1.6     | 4.9   | 2,631     |       |   |    | エフ・ジェー・ネクスト         | 8.6       | 10.5  | 9,114     |           |   |    |   |       |
| 福島銀行                     | 10.6     | 10.5     | 4,021     | 4,021     |       |    | NECキャピタルソリューション          | 4.6     | 5     | 8,020     |       |   |    | インテリクス              | 3.2       | 3.5   | 2,271     |           |   |    |   |       |
| 大東銀行                     | 5.4      | 5.8      | 3,520     | 3,520     |       |    | <b>不動産業 (2.5%)</b>       |         |       |           |       |   |    | ランドビジネス             | 6.9       | 6.2   | 4,817     |           |   |    |   |       |
| トモニホールディングス              | 92.2     | 93.5     | 36,839    | 36,839    |       |    | いちご                      | 159.8   | 153.9 | 57,712    |       |   |    | ブランドビルハウス           | 9.9       | 10.6  | 4,526     |           |   |    |   |       |
| フィデアホールディングス             | 108.6    | 117.8    | 15,903    | 15,903    |       |    | 日本駐車場開発                  | 135.1   | 145.8 | 23,328    |       |   |    | 日本空港ビルデング           | 32.7      | 38.6  | 165,015   |           |   |    |   |       |
| 池田泉州ホールディングス             | 118.6    | 128.5    | 38,164    | 38,164    |       |    | ヒューリック                   | 233.5   | 252.6 | 252,600   |       |   |    | <b>サービス業 (4.8%)</b> |           |       |           |           |   |    |   |       |
| <b>証券・商品先物取引業 (0.8%)</b> |          |          |           |           |       |    | 三栄建築設計                   | 4.5     | 4.9   | 8,202     |       |   |    | 日本工営                | 7.3       | 7.8   | 19,624    |           |   |    |   |       |
| F P G                    | 39.1     | 38.7     | 39,938    | 39,938    |       |    | スター・マイカ                  | 4.1     | 5.5   | 8,019     |       |   |    | L I F U L L         | 37.7      | 40.7  | 27,798    |           |   |    |   |       |
| マーズキャピタルメント              | 2.3      | 4.7      | 3,431     | 3,431     |       |    | 野村不動産ホールディングス            | 74.4    | 80.6  | 172,967   |       |   |    | ジェイエイシーフルタイム        | 8.7       | 9.4   | 21,291    |           |   |    |   |       |
| S B Iホールディングス            | 126.5    | 144.2    | 317,384   | 317,384   |       |    | 三重交通グループホールディングス         | 22.7    | 24.6  | 15,055    |       |   |    | 日本M&Aセンター           | 37.5      | 87.3  | 247,320   |           |   |    |   |       |
| 日本アジア投資                  | 10.1     | 10.5     | 2,089     | 2,089     |       |    | サムティ                     | 9.5     | 16.7  | 24,949    |       |   |    | メンバーズ               | 2.7       | 4     | 5,588     |           |   |    |   |       |
| ジャフコ                     | 16.1     | 19.8     | 74,646    | 74,646    |       |    | ディア・ライフ                  | 11.3    | 15.4  | 6,945     |       |   |    | 中広                  | 1.2       | 1.1   | 612       |           |   |    |   |       |
| 大和証券グループ本社               | 957      | 971.1    | 541,776   | 541,776   |       |    | コーセーアールイー                | 1.9     | 3.7   | 2,793     |       |   |    | タケエイ                | 11.3      | 12.2  | 9,064     |           |   |    |   |       |
| 野村ホールディングス               | 1,924    | 2,129.4  | 925,224   | 925,224   |       |    | エー・ディー・ワークス              | 150     | 171.5 | 5,831     |       |   |    | E・Jホールディングス         | -         | 1.5   | 1,570     |           |   |    |   |       |
| 岡三証券グループ                 | 95       | 103.1    | 48,766    | 48,766    |       |    | 日本商業開発                   | 6.3     | 7.5   | 11,392    |       |   |    | トラスト・テック            | 4.9       | 5.6   | 18,452    |           |   |    |   |       |
| 丸三証券                     | 35.6     | 35.9     | 28,684    | 28,684    |       |    | フレックスコーポレーション            | 15.3    | 19.1  | 29,261    |       |   |    | コジカホールディングス         | 5.7       | 31.3  | 50,048    |           |   |    |   |       |
| 東洋証券                     | 40       | 43.4     | 7,030     | 7,030     |       |    | エニソホールディングス              | 13.1    | 18.3  | 39,820    |       |   |    | アルトナー               | -         | 2.2   | 1,975     |           |   |    |   |       |
| 東証フィナンシャル・ホールディングス       | 123.8    | 144.3    | 67,676    | 67,676    |       |    | T H E グローバル社             | 5.3     | 5.5   | 2,695     |       |   |    | パソナグループ             | 10.3      | 14.3  | 19,919    |           |   |    |   |       |
| 光世証券                     | 2.7      | 2.9      | 2,108     | 2,108     |       |    | 日本管理センター                 | 7.4     | 7.9   | 6,809     |       |   |    | C D S               | 3         | 2.9   | 3,262     |           |   |    |   |       |
| 水戸証券                     | 34.7     | 35.1     | 9,126     | 9,126     |       |    | サンセイランディック               | 3.3     | 3.2   | 2,512     |       |   |    | リクアンドモチベーション        | 19.9      | 21.6  | 19,548    |           |   |    |   |       |
| いちよし証券                   | 23.5     | 25.4     | 21,793    | 21,793    |       |    | エストラスト                   | 1.6     | 1.6   | 1,228     |       |   |    | G C A               | 12.4      | 12    | 9,408     |           |   |    |   |       |
| 松井証券                     | 54.7     | 59.3     | 68,788    | 68,788    |       |    | フジヤースホールディングス            | 27.2    | 27    | 18,144    |       |   |    | エス・エム・エス            | 21.4      | 43.1  | 79,691    |           |   |    |   |       |
| だいがう証券ビジネス               | 5.5      | 5        | 1,995     | 1,995     |       |    | オープンハウス                  | 18.2    | 19.7  | 89,438    |       |   |    | パソルホールディングス         | 100       | 117.3 | 228,148   |           |   |    |   |       |
| マネックスグループ                | 118.7    | 113      | 42,488    | 42,488    |       |    | 東急不動産ホールディングス            | 270.8   | 325.4 | 197,192   |       |   |    | リニカル                | 7         | 6.6   | 9,292     |           |   |    |   |       |
| カブドットコム証券                | 71.6     | 90.4     | 47,460    | 47,460    |       |    | 阪田グループホールディングス           | 93.3    | 101   | 202,808   |       |   |    | グックパッド              | 34.1      | 36.7  | 11,010    |           |   |    |   |       |
| 極東証券                     | 15       | 16.2     | 18,500    | 18,500    |       |    | イープランド                   | -       | 1.8   | 1,225     |       |   |    | エスクリ                | 3.8       | 3.2   | 1,913     |           |   |    |   |       |
| 岩井コスモホールディングス            | 11.4     | 12.4     | 14,892    | 14,892    |       |    | ムゲンエステート                 | 6.9     | 8.5   | 5,015     |       |   |    | アイ・ケイ・ケイ            | 6.4       | 5.8   | 4,170     |           |   |    |   |       |
| 藍澤證券                     | 20.9     | 22.7     | 1         |           |       |    |                          |         |       |           |       |   |    |                     |           |       |           |           |   |    |   |       |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |       |           | 銘柄                  | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |         |         | 銘柄        | 期首(前期末)   |             |         | 当 期 末     |         |           |           |             |         |         |         |
|------------------|---------|-------|-----------|-------|-------|-----------|---------------------|---------|-------|-----------|-------|---------|---------|-----------|-----------|-------------|---------|-----------|---------|-----------|-----------|-------------|---------|---------|---------|
|                  | 株       | 数     | 評 価 額     | 株     | 数     | 評 価 額     |                     | 株       | 数     | 評 価 額     | 株     | 数       | 評 価 額   |           | 株         | 数           | 評 価 額   | 株         | 数       | 評 価 額     |           |             |         |         |         |
| N J S            |         | 千株    | 千円        |       | 千株    | 千円        |                     | 千株      | 千株    | 千円        |       | 千株      | 千株      | 千円        |           | 千株          | 千株      | 千円        |         | 千株        | 千円        |             |         |         |         |
| 総合警備保障           | 43.1    | 46.6  | 222,748   |       | 2.6   | 3,900     | 東京個別指導学院            | 3.8     | 4.2   | 5,590     |       | 6.7     | 7.2     | 24,048    |           | 6.7         | 7.2     | 24,048    |         | 6.7       | 7.2       |             |         |         |         |
| カカコム             | 83.3    | 88.3  | 177,306   |       | 4.6   | 222,748   | サイバーエージェント          | 71.2    | 72.3  | 226,660   |       | 16.9    | 20.9    | 88,616    |           | 16.9        | 20.9    | 88,616    |         | 16.9      | 20.9      |             |         |         |         |
| アイロムグループ         | 3.7     | 4.5   | 6,984     |       | 88.3  | 177,306   | 楽天                  | 555.6   | 546.6 | 442,199   |       | 2.1     | 2.3     | 4,462     |           | 2.1         | 2.3     | 4,462     |         | 2.1       | 2.3       |             |         |         |         |
| セントレア・ホールディング    | 4.6     | 6.4   | 3,545     |       | 4.5   | 6,984     | クロー・アンド・リバー社        | 5.6     | 6.8   | 7,786     |       | 19.3    | 17.8    | 88,377    |           | 19.3        | 17.8    | 88,377    |         | 19.3      | 17.8      |             |         |         |         |
| サイネックス           | 1.6     | 1.8   | 1,314     |       | 3.7   | 3,545     | テフ・オー・ダブリュー         | 9.7     | 11.2  | 8,142     |       | 12.1    | 12.3    | 15,153    |           | 12.1        | 12.3    | 15,153    |         | 12.1      | 12.3      |             |         |         |         |
| ルネサンス            | 5.3     | 6.5   | 12,707    |       | 1.6   | 1,314     | セントラルスポーツ           | 4       | 4.4   | 14,850    |       | 7.5     | 8       | 11,192    |           | 7.5         | 8       | 11,192    |         | 7.5       | 8         |             |         |         |         |
| ディップ             | 15.3    | 18.9  | 37,308    |       | 5.3   | 12,707    | フルキャストホールディングス      | 9.5     | 11.8  | 23,163    |       | スベース    | 7       | 7.6       | 9,477     |             | 7       | 7.6       | 9,477   |           | 7         | 7.6         |         |         |         |
| オプトホールディング       | 7.6     | 7.1   | 11,381    |       | 15.3  | 37,308    | エン・ジャパン             | -       | 12.8  | 54,848    |       | 3.3     | 4.7     | 3,755     |           | 3.3         | 4.7     | 3,755     |         | 3.3       | 4.7       |             |         |         |         |
| 新日本科学            | 13.2    | 15.9  | 11,495    |       | 7.6   | 11,381    | リソルホールディングス         | 1.2     | 1.3   | 5,434     |       | 2.6     | 2.6     | 6,492     |           | 2.6         | 2.6     | 6,492     |         | 2.6       | 2.6       |             |         |         |         |
| ツクイ              | 25.5    | 27.6  | 22,024    |       | 13.2  | 11,495    | テクノプロ・ホールディングス      | 19.3    | 23.6  | 142,072   |       | 0.8     | 0.7     | 3,885     |           | 0.8         | 0.7     | 3,885     |         | 0.8       | 0.7       |             |         |         |         |
| キャリアデザインセンター     | 2.5     | 3     | 3,594     |       | 25.5  | 22,024    | アトラ                 | 1.9     | 2.3   | 931       |       | 4.5     | 4.6     | 5,805     |           | 4.5         | 4.6     | 5,805     |         | 4.5       | 4.6       |             |         |         |         |
| ベネフィット・ワン        | -       | 16.2  | 61,803    |       | 2.5   | 3,594     | インターワークス            | 2.4     | 2.3   | 1,720     |       | 2.1     | 2.3     | 2,948     |           | 2.1         | 2.3     | 2,948     |         | 2.1       | 2.3       |             |         |         |         |
| エムスリー            | 114     | 246.9 | 382,695   |       | -     | 61,803    | アイ・アールジャパンホールディングス  | -       | 3.8   | 4,841     |       | 2.2     | 3.3     | 18,018    |           | 2.2         | 3.3     | 18,018    |         | 2.2       | 3.3       |             |         |         |         |
| ツカガ・グローバルホールディング | 8.7     | 7.5   | 4,612     |       | 114   | 246.9     | KeepPer 技研          | 3.5     | 3.9   | 3,681     |       | 2.4     | 2.6     | 10,530    |           | 2.4         | 2.6     | 10,530    |         | 2.4       | 2.6       |             |         |         |         |
| プラス              | 0.6     | 0.8   | 468       |       | 8.7   | 7,546     | ファーストロジック           | 1.7     | 2.3   | 1,591     |       | 8.1     | 7.6     | 23,218    |           | 8.1         | 7.6     | 23,218    |         | 8.1       | 7.6       |             |         |         |         |
| アウトソーシング         | 32.3    | 61.8  | 81,205    |       | 0.6   | 468       | 三機サービス              | 1.2     | 1.9   | 2,696     |       | 4.4     | 4.8     | 7,603     |           | 4.4         | 4.8     | 7,603     |         | 4.4       | 4.8       |             |         |         |         |
| ウエルネット           | 11      | 11.9  | 12,387    |       | 32.3  | 81,205    | Gunosy              | 4.9     | 7.2   | 18,194    |       | 16.5    | 17.4    | 51,591    |           | 16.5        | 17.4    | 51,591    |         | 16.5      | 17.4      |             |         |         |         |
| ワールドホールディングス     | 3.6     | 3.2   | 8,755     |       | 11    | 12,387    | デザインワン・ジャパン         | 2.1     | 2.3   | 729       |       | 43.9    | 43.8    | 42,310    |           | 43.9        | 43.8    | 42,310    |         | 43.9      | 43.8      |             |         |         |         |
| ディー・エヌ・エー        | 58.4    | 63.2  | 109,209   |       | 3.6   | 8,755     | イー・ガーディアン           | 5.5     | 5.5   | 12,012    |       | 9.5     | 12      | 39,300    |           | 9.5         | 12      | 39,300    |         | 9.5       | 12        |             |         |         |         |
| 情報D Yホールディングス    | 150.6   | 163   | 267,809   |       | 58.4  | 109,209   | リブセンス               | 7.1     | 6.3   | 1,814     |       | 62      | 63      | 1,827     |           | 62          | 63      | 1,827     |         | 62        | 63        |             |         |         |         |
| ぐるなび             | 17.2    | 16.6  | 11,387    |       | 150.6 | 267,809   | ジャパネットマテリアル         | 9.9     | 32.1  | 42,660    |       | 12      | 13      | 27,079    |           | 12          | 13      | 27,079    |         | 12        | 13        |             |         |         |         |
| エスアールジータカミヤ      | 12.8    | 12.2  | 8,381     |       | 17.2  | 16,611    | ベクトル                | 13      | 14.3  | 19,934    |       | 25.3    | 27.3    | 81,627    |           | 25.3        | 27.3    | 81,627    |         | 25.3      | 27.3      |             |         |         |         |
| ジャパネットシステム       | 13.5    | 9.3   | 11,522    |       | 12.8  | 8,381     | ウチヤマホールディングス        | 5.4     | 5.9   | 2,708     |       | 4.3     | 4.7     | 12,657    |           | 4.3         | 4.7     | 12,657    |         | 4.3       | 4.7       |             |         |         |         |
| ファンコミュニケーションズ    | 30.2    | 32.2  | 18,450    |       | 13.5  | 11,522    | ライクキッズネクスト          | 1.1     | 2.5   | 2,170     |       | 6.7     | 6.3     | 7,673     |           | 6.7         | 6.3     | 7,673     |         | 6.7       | 6.3       |             |         |         |         |
| ライク              | 4.3     | 4.6   | 4,604     |       | 30.2  | 18,450    | キャリアリンク             | 3.1     | 4.3   | 1,522     |       | 11.6    | 12.6    | 24,028    |           | 11.6        | 12.6    | 24,028    |         | 11.6      | 12.6      |             |         |         |         |
| ビジネス・ブレークスルー     | 5.2     | 4.9   | 1,631     |       | 4.3   | 4,604     | I B J               | 8.6     | 7.8   | 6,466     |       | 10.5    | 11.3    | 31,425    |           | 10.5        | 11.3    | 31,425    |         | 10.5      | 11.3      |             |         |         |         |
| WDBホールディングス      | 5       | 5.3   | 13,901    |       | 5.2   | 4,916     | アサシテック              | 3.9     | 4.7   | 10,283    |       | 1.2     | 1.3     | 3,590     |           | 1.2         | 1.3     | 3,590     |         | 1.2       | 1.3       |             |         |         |         |
| ティア              | 5.7     | 5.4   | 3,348     |       | 5     | 13,901    | N・フィールド             | 6.1     | 7.5   | 6,720     |       | 115     | 124.4   | 1,124,824 |           | 115         | 124.4   | 1,124,824 |         | 115       | 124.4     |             |         |         |         |
| CDG              | 1       | 1     | 1,324     |       | 5.7   | 3,348     | パリュウHR              | 2.5     | 2.5   | 4,560     |       | 5.2     | 5.6     | 23,968    |           | 5.2         | 5.6     | 23,968    |         | 5.2       | 5.6       |             |         |         |         |
| パリュウコマース         | 9.7     | 7.8   | 15,038    |       | 1     | 1,324     | M&Aキャピタルパートナーズ      | 2.2     | 3     | 17,070    |       | 22.2    | 22.2    | 25,885    |           | 22.2        | 22.2    | 25,885    |         | 22.2      | 22.2      |             |         |         |         |
| インフォーマット         | 54.8    | 64.3  | 76,517    |       | 9.7   | 15,038    | ライドエクスプレスホールディングス   | 4.4     | 4.8   | 6,158     |       | 12.7    | 14.8    | 71,114    |           | 12.7        | 14.8    | 71,114    |         | 12.7      | 14.8      |             |         |         |         |
| J Pホールディングス      | 34.1    | 33.5  | 9,916     |       | 54.8  | 76,517    | ER Iホールディングス        | 3.1     | 3.3   | 2,517     |       | 12.2    | 12.6    | 14,905    |           | 12.2        | 12.6    | 14,905    |         | 12.2      | 12.6      |             |         |         |         |
| Eコナックホールディングス    | 21.7    | 22.2  | 2,686     |       | 34.1  | 9,916     | アビスト                | 1.5     | 1.9   | 9,596     |       | 22.5    | 24.3    | 55,209    |           | 22.5        | 24.3    | 55,209    |         | 22.5      | 24.3      |             |         |         |         |
| E P Sホールディングス    | 16.3    | 17.6  | 30,606    |       | 21.7  | 2,686     | シグマクシス              | 4.3     | 5.5   | 4,515     |       | 5       | 5.2     | 3,078     |           | 5           | 5.2     | 3,078     |         | 5         | 5.2       |             |         |         |         |
| レップス             | 2.7     | 2.9   | 2,784     |       | 16.3  | 30,606    | ウィルグループ             | 4.7     | 7.5   | 6,982     |       | 8.6     | 9.3     | 5,635     |           | 8.6         | 9.3     | 5,635     |         | 8.6       | 9.3       |             |         |         |         |
| フレタージ・インターナショナル  | 22.5    | 22    | 28,974    |       | 2.7   | 2,784     | エスコロー・エージェンツ・ジャパン   | 14.9    | 16.1  | 4,025     |       | 2.2     | 2.3     | 2,267     |           | 2.2         | 2.3     | 2,267     |         | 2.2       | 2.3       |             |         |         |         |
| アミューズ            | 7.2     | 7.1   | 17,984    |       | 22.5  | 28,974    | 日本ビューホテル            | 2.4     | 3.8   | 4,195     |       | 3       | 4       | 5,500     |           | 3           | 4       | 5,500     |         | 3         | 4         |             |         |         |         |
| ドリムインキュベーター      | 3.6     | 3.5   | 5,155     |       | 7.2   | 17,984    | リクルートホールディングス       | 835.9   | 839.9 | 2,449,148 |       | 39.7    | 43      | 125,732   |           | 39.7        | 43      | 125,732   |         | 39.7      | 43        |             |         |         |         |
| クイック             | 6.7     | 7.2   | 11,556    |       | 3.6   | 5,155     | エラン                 | 2.7     | 8     | 10,168    |       | 13.4    | 14.4    | 58,248    |           | 13.4        | 14.4    | 58,248    |         | 13.4      | 14.4      |             |         |         |         |
| T A C            | 6.7     | 6.8   | 1,591     |       | 6.7   | 11,556    | 土木管理総合試験所           | 3.3     | 5.1   | 2,754     |       | 7.3     | 7.4     | 7,718     |           | 7.3         | 7.4     | 7,718     |         | 7.3       | 7.4       |             |         |         |         |
| ケネディクス           | 143.5   | 103   | 61,491    |       | 6.7   | 1,591     | 日本郵政                | 614.8   | 961.1 | 1,270,574 |       | 20.6    | 16.7    | 21,693    |           | 20.6        | 16.7    | 21,693    |         | 20.6      | 16.7      |             |         |         |         |
| 電通               | 132     | 142.9 | 718,787   |       | 143.5 | 61,491    | ベルシテム24ホールディングス     | 18.2    | 19.6  | 27,871    |       | 18.2    | 19.6    | 50,509    |           | 18.2        | 19.6    | 50,509    |         | 18.2      | 19.6      |             |         |         |         |
| テイクアンドグヴ・ニーズ     | 5.1     | 4.5   | 8,883     |       | 132   | 718,787   | 鎌倉新書                | 1.5     | 8.6   | 13,295    |       | 4       | 4.4     | 6,261     |           | 4           | 4.4     | 6,261     |         | 4         | 4.4       |             |         |         |         |
| ぴあ               | 3.6     | 3.3   | 12,952    |       | 5.1   | 8,883     | 一蔵                  | 1.4     | 1.5   | 933       |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| イオンファンタジー        | 3.5     | 3.8   | 9,975     |       | 3.6   | 12,952    | L I T A L I C O     | 1.9     | 2.7   | 5,470     |       | 合計      | 株数・金額   | 137,421.8 | 142,571.8 | 275,040,369 |         | 合計        | 株数・金額   | 137,421.8 | 142,571.8 | 275,040,369 |         |         |         |
| シーティーエス          | 11.1    | 13.3  | 8,684     |       | 3.5   | 9,975     | グローバルグループ           | 1.2     | 1.4   | 1,332     |       | 銘柄数<比率> | 2,049銘柄 | 2,113銘柄   | <98.5%>   |             | 銘柄数<比率> | 2,049銘柄   | 2,113銘柄 | <98.5%>   |           | 銘柄数<比率>     | 2,049銘柄 | 2,113銘柄 | <98.5%> |
| ネクシィーズグループ       | 4.3     | 3.7   | 6,278     |       | 11.1  | 8,684     | エポラブルアジア            | 2.2     | 3.3   | 7,652     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| みらいホールディングス      | 32.3    | 32.9  | 94,686    |       | 4.3   | 6,278     | アトラエ                | -       | 2.3   | 4,935     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| アルプス技研           | 9.5     | 10.2  | 18,492    |       | 32.3  | 94,686    | ストライク               | 1       | 3     | 6,429     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| サンニクス            | 17.4    | 20.5  | 4,223     |       | 9.5   | 18,492    | ソラスト                | 6.5     | 28.5  | 30,922    |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| ダイオーズ            | 2.2     | 2.8   | 3,628     |       | 17.4  | 20,542    | セラク                 | 1.9     | 2.6   | 1,549     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| 日本空調サービス         | 11.4    | 13.4  | 8,656     |       | 2.2   | 3,628     | インソース               | 1.3     | 3.9   | 8,572     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| オリエンタルランド        | 128     | 138.6 | 1,608,453 |       | 11.4  | 8,656     | ペイカレント・コンサルティング     | -       | 6.2   | 19,313    |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| ダスキン             | 29.1    | 31.6  | 79,537    |       | 128   | 1,608,453 | アイモパイル              | -       | 2.8   | 2,007     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| 明光ネットワークジャパン     | 13.7    | 14.8  | 13,571    |       | 29.1  | 79,537    | キャリアインテックス          | 1.1     | 4     | 5,116     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| ファルコホールディングス     | 5.6     | 6.5   | 9,321     |       | 13.7  | 13,571    | MS - Japan          | 0.8     | 4.7   | 8,460     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| 秀英予備校            | 2.4     | 2.5   | 1,215     |       | 5.6   | 9,321     | 船場                  | -       | 2.1   | 1,801     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| 田谷               | 2       | 2.1   | 1,316     |       | 2.4   | 1,215     | グレイステクノロジー          | -       | 3.2   | 7,120     |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| ラウンドワン           | 33.6    | 36.3  | 46,972    |       | 2     | 1,316     | ジャウエレクトロニクスホールディングス | -       | 6.9   | 11,964    |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |
| リゾートトラスト         | 45.9    | 49.6  | 77,921    |       | 33.6  | 46,972    |                     |         |       |           |       |         |         |           |           |             |         |           |         |           |           |             |         |         |         |



## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 |           | 当 期          |       | 末        |
|-----|-----------|--------------|-------|----------|
|     |           | 買 建 額        | 売 建 額 | 額        |
| 国内  | T O P I X | 百万円<br>4,121 |       | 百万円<br>- |

## ■投資信託財産の構成

2019年2月7日現在

| 項 目                     | 当 期               |   | 末         |
|-------------------------|-------------------|---|-----------|
|                         | 評 価 額             | 比 | 率         |
| 株 式                     | 千円<br>275,040,369 |   | %<br>98.4 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 4,522,857         |   | 1.6       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 279,563,227       |   | 100.0     |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月7日)現在

| 項 目                       | 当 期 末            |
|---------------------------|------------------|
| (A) 資 産                   | 281,168,547,397円 |
| 一 般 株 式                   | 4,125,464,360    |
| 株 式 (評 価 額)               | 275,040,369,410  |
| 未 収 入 金                   | 89,044,788       |
| 未 収 入 委 託 配 当 証 拠         | 424,228,839      |
| (B) 負 債                   | 1,984,233,000    |
| 未 払 託 証 拠 金 代 用 約 有 価 証 券 | 376,733,000      |
| (C) 純 資 産                 | 279,184,314,397  |
| 元 本                       | 115,232,523,115  |
| 次 期 繰 越 損 益               | 163,951,791,282  |
| (D) 受 取 金 数               | 115,232,523,115円 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)  | 24,228円          |

(注1) 期首元本額 109,428,148,369円  
 追加設定元本額 39,063,771,527円  
 一部解約元本額 33,259,396,781円

(注2) 期末における元本の内訳

|                                 |                 |
|---------------------------------|-----------------|
| D I A M D C 国内株式インデックスファンド      | 12,470,165,201円 |
| D I A M国内株式バシッパ・ファンド            | 2,422,782,745円  |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型)          | 3,584,623円      |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型)          | 7,945,181円      |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型)          | 13,986,982円     |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)           | 29,918,491円     |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)           | 21,960,170円     |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)           | 16,943,092円     |
| たわらノーロード TOP I X                | 392,245,080円    |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)          | 110,161,759円    |
| たわらノーロード バランス (堅実型)             | 2,948,338円      |
| たわらノーロード バランス (標準型)             | 20,703,269円     |
| たわらノーロード バランス (積極型)             | 40,994,687円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)    | 224,069円        |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)    | 11,759,993円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)  | 36,734,333円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)    | 27,744,281円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)    | 74,154,128円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型)          | 66,600円         |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)          | 177,452円        |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)        | 1,070,868円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)          | 690,488円        |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)          | 2,408,866円      |
| D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>     | 38,649,342,706円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型     | 937,399,472円    |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型  | 3,139,647,393円  |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型     | 3,204,466,039円  |
| D I A M D C バランス30インデックスファンド    | 360,910,846円    |
| D I A M D C バランス50インデックスファンド    | 1,178,711,664円  |
| D I A M D C バランス70インデックスファンド    | 1,114,346,617円  |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)           | 40,917,509円     |
| マネックス資産設計ファンド (育成型)             | 1,087,561,549円  |
| マネックス資産設計ファンド エゴリユーション          | 25,501,335円     |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) | 297,908,998円    |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) | 199,184,916円    |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) | 344,970,555円    |
| 投資のソムリエ                         | 4,315,294,876円  |
| クルーズコントロール                      | 1,257,278,344円  |
| 投資のソムリエ<DC年金>                   | 401,357,411円    |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>      | 222,726,425円    |
| D I A M D C バランス・F (成長型)        | 277,618,478円    |
| クルーズコントロール<DC年金>                | 891,895円        |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)         | 12,880,608円     |
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)         | 33,987,494円     |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型             | 55,644,561円     |
| ダイナミック・ナビゲーション                  | 534,098円        |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド              | 935,961,743円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)         | 2,300,413円      |

|  |                  |
|--|------------------|
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)                      | 1,690,960円       |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)                     | 363,286円         |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)                      | 3,177,605円       |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>                         | 15,276,644円      |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                          | 133,194,060円     |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                         | 18,666円          |
| D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)              | 70,041,061円      |
| 日米資産分散戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定) | 14,119,938円      |
| D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)        | 116,779,397円     |
| D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)        | 280,053,245円     |
| D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)          | 15,178,664円      |
| D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)          | 64,049,107円      |
| D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)          | 16,881,660円      |
| D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)          | 13,764,104円      |
| D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)            | 26,737,416円      |
| D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)            | 55,134,608円      |
| D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)              | 1,036,891,666円   |
| D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)            | 979,267,957円     |
| D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)              | 2,714,393,012円   |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)         | 197,056,346円     |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)        | 52,699,951円      |
| D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)   | 565,823,049円     |
| D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)          | 356,264,357円     |
| D I A Mグローバル8私算ファンド (適格機関投資家向け)              | 10,473,598円      |
| D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)            | 7,863,061円       |
| D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)            | 51,727,826円      |
| D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)         | 9,107,706,646円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)        | 163,483,865円     |
| D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)        | 1,823,334,497円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)         | 10,421,255,147円  |
| D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)                  | 4,948,207円       |
| D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)                  | 296,109円         |
| D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)                  | 3,683,923円       |
| D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)         | 9,276,101,711円   |
| D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)                | 66,616,336円      |
| D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)                | 28,932,320円      |
| D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)                  | 26,843,008円      |
| D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)                  | 107,564円         |
| D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)                  | 120,467円         |
| D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定)   | 426,124,037円     |
| D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)   | 1,366,625,210円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)   | 1,837,729,242円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)   | 72,976,941円      |
| 期末元本合計                                       | 115,232,523,115円 |
| (注3) 担保資産                                    |                  |
| 代用として担保を提供している資産は次の通りです。                     |                  |
| 株式   | 3,287,500,000円   |

## ■損益の状況

当期 自2018年2月8日 至2019年2月7日

| 項   | 目              | 当               | 期 |
|-----|----------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益          | 6,275,204,545円  |   |
|     | 受取配当金          | 6,228,808,737   |   |
|     | その他の収益         | 52,719,900      |   |
|     | 支払利息           | △6,324,092      |   |
| (B) | 有価証券売買損益       | △27,670,046,291 |   |
|     | 売買益            | 11,457,593,174  |   |
|     | 売買損            | △39,127,639,465 |   |
| (C) | 先物取引等取引損益      | △882,002,368    |   |
|     | 取引益            | 1,171,869,352   |   |
|     | 取引損            | △2,053,871,720  |   |
| (D) | その他費用          | △6,516          |   |
| (E) | 当期損益金(A+B+C+D) | △22,276,850,630 |   |
| (F) | 前期繰越損益金        | 179,810,421,658 |   |
| (G) | 解約差損益金         | △53,943,765,219 |   |
| (H) | 追加信託差損益金       | 60,361,985,473  |   |
| (I) | 計(E+F+G+H)     | 163,951,791,282 |   |
|     | 次期繰越損益金(I)     | 163,951,791,282 |   |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

## 《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

# 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第16期 (決算日 2019年2月14日)

(計算期間 2018年2月15日～2019年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第16期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。

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 2002年12月3日から無期限です。   |
| 運用方針   | NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。  |
| 主要投資対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。  |
| 主な組入制限 | 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。<br>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 |

### ■最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額   |       | NOMURA-BPI総合   |          | 債券組入比率    | 新株予約権付社債(転換社債)比率 | 債券先物比率 | 純資産総額          |
|------------------|--------|-------|----------------|----------|-----------|------------------|--------|----------------|
|                  | 円      | 期中騰落率 | (ベンチマーク)       | 期中騰落率    |           |                  |        |                |
| 12期 (2015年2月16日) | 12,161 | 1.8   | ポイント<br>359.95 | %<br>1.8 | %<br>98.5 | %<br>-           | %<br>- | 百万円<br>422,496 |
| 13期 (2016年2月15日) | 12,614 | 3.7   | 373.37         | 3.7      | 98.6      | -                | -      | 400,593        |
| 14期 (2017年2月14日) | 12,730 | 0.9   | 376.81         | 0.9      | 98.6      | -                | -      | 379,734        |
| 15期 (2018年2月14日) | 12,855 | 1.0   | 380.56         | 1.0      | 99.5      | -                | -      | 355,598        |
| 16期 (2019年2月14日) | 13,042 | 1.5   | 386.15         | 1.5      | 99.3      | -                | -      | 292,112        |

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません(以下同じ)。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

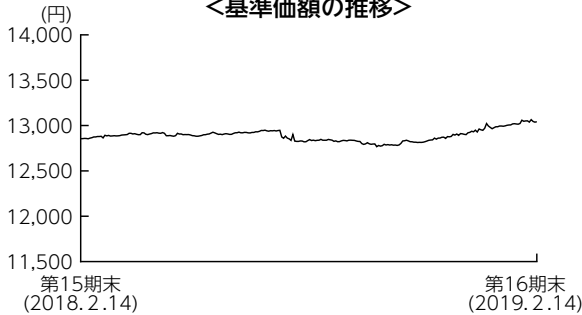
| 年 月 日              | 基 準 価 額     |          | NOMURA-BPI総合   |        | 債券組入率<br>比 | 新株予約債<br>権付社債<br>(転換社債)<br>率<br>比 | 債券先物率<br>比 |
|--------------------|-------------|----------|----------------|--------|------------|-----------------------------------|------------|
|                    | 騰 落 率       | (ベンチマーク) | 騰 落 率          |        |            |                                   |            |
| (期首)<br>2018年2月14日 | 円<br>12,855 | %<br>-   | ポイント<br>380.56 | %<br>- | %<br>99.5  | %<br>-                            | %<br>-     |
| 2月 末               | 12,879      | 0.2      | 381.29         | 0.2    | 99.2       | -                                 | -          |
| 3月 末               | 12,899      | 0.3      | 381.91         | 0.4    | 99.4       | -                                 | -          |
| 4月 末               | 12,889      | 0.3      | 381.64         | 0.3    | 99.5       | -                                 | -          |
| 5月 末               | 12,919      | 0.5      | 382.50         | 0.5    | 99.4       | -                                 | -          |
| 6月 末               | 12,924      | 0.5      | 382.67         | 0.6    | 99.2       | -                                 | -          |
| 7月 末               | 12,901      | 0.4      | 381.98         | 0.4    | 98.8       | -                                 | -          |
| 8月 末               | 12,831      | △0.2     | 379.89         | △0.2   | 99.1       | -                                 | -          |
| 9月 末               | 12,799      | △0.4     | 378.99         | △0.4   | 99.3       | -                                 | -          |
| 10月 末              | 12,822      | △0.3     | 379.64         | △0.2   | 99.7       | -                                 | -          |
| 11月 末              | 12,876      | 0.2      | 381.24         | 0.2    | 98.3       | -                                 | -          |
| 12月 末              | 12,970      | 0.9      | 384.13         | 0.9    | 99.0       | -                                 | -          |
| 2019年1月 末          | 13,023      | 1.3      | 385.58         | 1.3    | 99.7       | -                                 | -          |
| (期末)<br>2019年2月14日 | 13,042      | 1.5      | 386.15         | 1.5    | 99.3       | -                                 | -          |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年2月15日から2019年2月14日まで）

### <基準価額の推移>



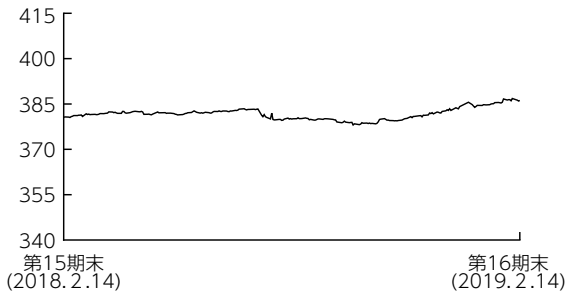
### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は13,042円となり、前期末比で1.5%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

国内債券市場の上昇を受けて、基準価額は上昇しました。期首から7月にかけては、日本銀行（以下、日銀）が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続する中、基準価額は上昇基調で推移しました。7月から10月にかけては、日銀の大規模金融緩和の修正観測などを背景に下落しました。10月から期末にかけては、世界景気の減速懸念などから、基準価額は再び上昇基調に転じました。

### <NOMURA-BPI総合の推移>



### 投資環境

国内債券市場は上昇（利回りは低下）しました。期首から7月にかけては、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続する中、10年国債利回りは0.02～0.07%程度で揉み合いました。7月から10月にかけては、日銀の大規模金融緩和の修正観測などから利回りは上昇基調で推移し、一時0.16%程度まで上昇しました。10月から期末にかけては、世界景気の減速懸念などから低下基調に転じ、通期では10年国債利回りは低下しました。

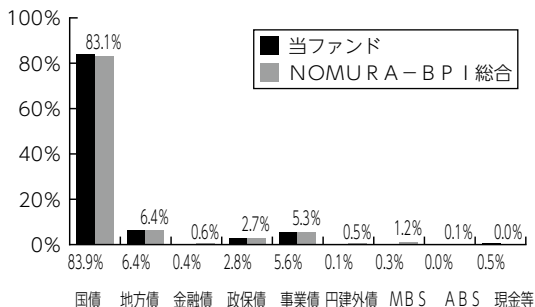
### ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

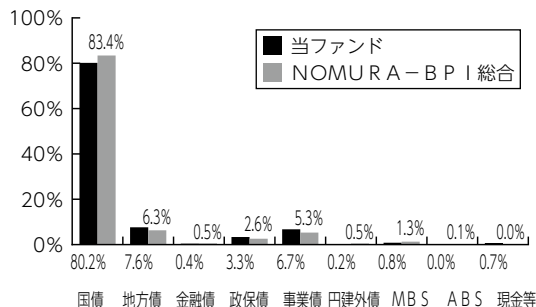
**【運用状況】** (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

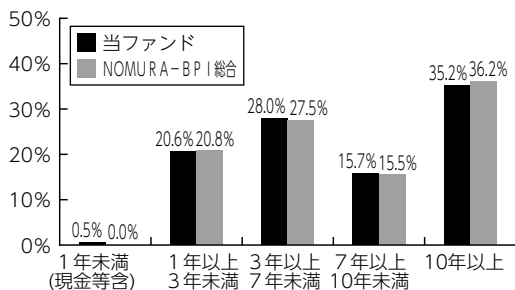


期末

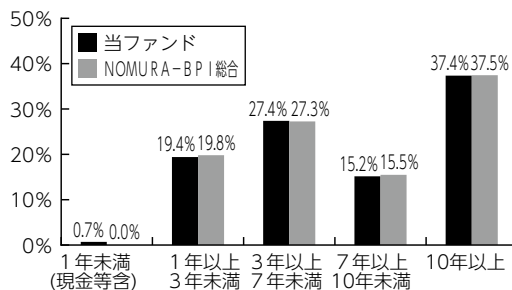


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



**ベンチマークとの差異について**

ベンチマークは、前期末比で1.5%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

**今後の運用方針**

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目                | 当 期       |                   |
|--------------------|-----------|-------------------|
|                    | 金 額       | 比 率               |
| (a) その他費用<br>(その他) | 0円<br>(0) | 0.000%<br>(0.000) |
| 合 計                | 0         | 0.000             |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(12,890円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については13ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (2018年2月15日から2019年2月14日まで)

公社債

|     |           | 買 付 額       | 売 付 額                  |
|-----|-----------|-------------|------------------------|
| 国 内 |           | 千円          | 千円                     |
|     | 国 債 証 券   | 112,293,075 | 178,348,272<br>(-)     |
|     | 地 方 債 証 券 | 1,197,076   | 1,724,083<br>(-)       |
|     | 特 殊 債 券   | 7,828,993   | 4,643,553<br>(170,164) |
|     | 社 債 券     | 805,348     | 2,641,084<br>(-)       |

(注1) 金額は受渡代金です(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(転換社債)は含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2018年2月15日から2019年2月14日まで)

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 当              |                    |          | 期              |                    |          |
|-------|----------------|--------------------|----------|----------------|--------------------|----------|
|       | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 公 社 債 | 百万円<br>122,124 | 百万円<br>8,273       | %<br>6.8 | 百万円<br>187,356 | 百万円<br>10,434      | %<br>5.6 |

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当        |            | 期           |
|-----|----------|------------|-------------|
|     | 買 付 額    | 売 付 額      | 当 期 末 保 有 額 |
| 債 券 | 百万円<br>- | 百万円<br>310 | 百万円<br>-    |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ銀行です。



## ■組入資産の明細

### 公社債

#### (A) 債券種類別開示

##### 国内（邦貨建）公社債

| 区 分       | 当 期               |                   |           | 末               |                   |           |          |
|-----------|-------------------|-------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------|----------|
|           | 額 面 金 額           | 評 価 額             | 組 入 比 率   | うちBB格<br>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  |
| 国 債 証 券   | 千円<br>212,600,000 | 千円<br>234,177,067 | %<br>80.2 | %<br>-          | %<br>55.6         | %<br>16.8 | %<br>7.8 |
| 地 方 債 証 券 | 21,443,900        | 22,249,515        | 7.6       | -               | 2.7               | 4.0       | 1.0      |
| 特 殊 債 券   | 16,423,867        | 17,541,186        | 6.0       | -               | 3.4               | 2.3       | 0.3      |
| 金 融 債 券   | 1,200,000         | 1,201,430         | 0.4       | -               | -                 | 0.2       | 0.2      |
| 普 通 社 債 券 | 14,381,000        | 14,908,641        | 5.1       | -               | 1.1               | 2.3       | 1.7      |
| 合 計       | 266,048,767       | 290,077,840       | 99.3      | -               | 62.7              | 25.6      | 11.0     |

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

#### (B) 個別銘柄開示

##### 国内（邦貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄              | 当 期    |           |           | 末          |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                  | 利 率    | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| (国債証券)           | %      | 千円        | 千円        |            |
| 306回 利付国庫債券(10年) | 1.4000 | 1,500,000 | 1,525,800 | 2020/03/20 |
| 387回 利付国庫債券(2年)  | 0.1000 | 1,000,000 | 1,003,250 | 2020/04/15 |
| 388回 利付国庫債券(2年)  | 0.1000 | 800,000   | 802,792   | 2020/05/15 |
| 124回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 2,200,000 | 2,208,272 | 2020/06/20 |
| 308回 利付国庫債券(10年) | 1.3000 | 800,000   | 815,872   | 2020/06/20 |
| 309回 利付国庫債券(10年) | 1.1000 | 1,000,000 | 1,017,150 | 2020/06/20 |
| 46回 利付国庫債券(20年)  | 2.2000 | 500,000   | 516,040   | 2020/06/22 |
| 390回 利付国庫債券(2年)  | 0.1000 | 1,200,000 | 1,204,620 | 2020/07/01 |
| 392回 利付国庫債券(2年)  | 0.1000 | 800,000   | 803,400   | 2020/09/01 |
| 125回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 3,000,000 | 3,013,170 | 2020/09/20 |
| 310回 利付国庫債券(10年) | 1.0000 | 1,500,000 | 1,528,050 | 2020/09/20 |
| 311回 利付国庫債券(10年) | 0.8000 | 1,020,000 | 1,035,810 | 2020/09/20 |
| 47回 利付国庫債券(20年)  | 2.2000 | 250,000   | 259,487   | 2020/09/21 |
| 393回 利付国庫債券(2年)  | 0.1000 | 1,000,000 | 1,004,480 | 2020/10/01 |
| 394回 利付国庫債券(2年)  | 0.1000 | 700,000   | 703,234   | 2020/11/01 |
| 126回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 2,500,000 | 2,512,700 | 2020/12/20 |
| 312回 利付国庫債券(10年) | 1.2000 | 2,200,000 | 2,255,726 | 2020/12/20 |
| 48回 利付国庫債券(20年)  | 2.5000 | 500,000   | 524,725   | 2020/12/21 |
| 127回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 1,220,000 | 1,226,905 | 2021/03/20 |
| 313回 利付国庫債券(10年) | 1.3000 | 1,790,000 | 1,845,185 | 2021/03/20 |
| 314回 利付国庫債券(10年) | 1.1000 | 800,000   | 821,312   | 2021/03/20 |
| 128回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 2,200,000 | 2,213,948 | 2021/06/20 |

| 銘 柄              | 当 期    |           |           | 末          |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                  | 利 率    | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| (国債証券)           | %      | 千円        | 千円        |            |
| 315回 利付国庫債券(10年) | 1.2000 | 1,500,000 | 1,548,330 | 2021/06/20 |
| 316回 利付国庫債券(10年) | 1.1000 | 500,000   | 514,930   | 2021/06/20 |
| 51回 利付国庫債券(20年)  | 2.0000 | 600,000   | 630,654   | 2021/06/21 |
| 129回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 2,420,000 | 2,437,012 | 2021/09/20 |
| 317回 利付国庫債券(10年) | 1.1000 | 1,000,000 | 1,033,090 | 2021/09/20 |
| 318回 利付国庫債券(10年) | 1.0000 | 1,600,000 | 1,648,784 | 2021/09/20 |
| 52回 利付国庫債券(20年)  | 2.1000 | 550,000   | 582,565   | 2021/09/21 |
| 130回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 1,100,000 | 1,108,481 | 2021/12/20 |
| 319回 利付国庫債券(10年) | 1.1000 | 800,000   | 829,032   | 2021/12/20 |
| 320回 利付国庫債券(10年) | 1.0000 | 1,500,000 | 1,550,145 | 2021/12/20 |
| 131回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 2,020,000 | 2,036,927 | 2022/03/20 |
| 321回 利付国庫債券(10年) | 1.0000 | 1,600,000 | 1,658,144 | 2022/03/20 |
| 322回 利付国庫債券(10年) | 0.9000 | 1,000,000 | 1,033,240 | 2022/03/20 |
| 55回 利付国庫債券(20年)  | 2.0000 | 410,000   | 437,662   | 2022/03/21 |
| 132回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 2,000,000 | 2,018,140 | 2022/06/20 |
| 323回 利付国庫債券(10年) | 0.9000 | 750,000   | 776,970   | 2022/06/20 |
| 324回 利付国庫債券(10年) | 0.8000 | 850,000   | 877,710   | 2022/06/20 |
| 133回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 1,170,000 | 1,181,629 | 2022/09/20 |
| 325回 利付国庫債券(10年) | 0.8000 | 1,500,000 | 1,552,620 | 2022/09/20 |
| 58回 利付国庫債券(20年)  | 1.9000 | 600,000   | 644,916   | 2022/09/20 |
| 134回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 780,000   | 788,299   | 2022/12/20 |
| 326回 利付国庫債券(10年) | 0.7000 | 500,000   | 516,830   | 2022/12/20 |

| 銘柄                     | 当      | 期 末       |           |            |
|------------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                        |        | 利率        | 額面金額      | 評 価 額      |
| <b>(国債証券)</b>          | %      | 千円        | 千円        |            |
| 3 2 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,450,000 | 1,504,418 | 2022/12/20 |
| 1 3 5 回 利付国庫債券 (5 年)   | 0.1000 | 2,100,000 | 2,123,352 | 2023/03/20 |
| 3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 2,390,000 | 2,465,285 | 2023/03/20 |
| 6 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 1.0000 | 500,000   | 523,985   | 2023/03/20 |
| 1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年)   | 0.1000 | 1,700,000 | 1,720,077 | 2023/06/20 |
| 3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 2,270,000 | 2,365,794 | 2023/06/20 |
| 1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年)   | 0.1000 | 1,400,000 | 1,417,500 | 2023/09/20 |
| 3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,450,000 | 1,515,119 | 2023/09/20 |
| 3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 650,000   | 673,172   | 2023/09/20 |
| 6 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 1.9000 | 600,000   | 657,360   | 2023/09/20 |
| 3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 2,460,000 | 2,552,496 | 2023/12/20 |
| 3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 1,800,000 | 1,871,154 | 2024/03/20 |
| 3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 2,120,000 | 2,208,001 | 2024/06/20 |
| 3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.5000 | 1,950,000 | 2,023,788 | 2024/09/20 |
| 7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.1000 | 350,000   | 394,761   | 2024/09/20 |
| 3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.5000 | 850,000   | 883,609   | 2024/12/20 |
| 3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.3000 | 1,610,000 | 1,654,661 | 2024/12/20 |
| 7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.0000 | 340,000   | 383,435   | 2024/12/20 |
| 3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 1,860,000 | 1,924,653 | 2025/03/20 |
| 7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.1000 | 440,000   | 501,155   | 2025/03/20 |
| 3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 2,440,000 | 2,528,352 | 2025/06/20 |
| 7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 1.9000 | 640,000   | 724,473   | 2025/06/20 |
| 3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 2,450,000 | 2,542,267 | 2025/09/20 |
| 8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.0000 | 240,000   | 274,550   | 2025/09/20 |
| 3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.3000 | 2,510,000 | 2,590,771 | 2025/12/20 |
| 8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.1000 | 780,000   | 901,976   | 2025/12/20 |
| 3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,600,000 | 2,649,426 | 2026/03/20 |
| 8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.1000 | 440,000   | 511,130   | 2026/03/20 |
| 3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,500,000 | 2,548,275 | 2026/06/20 |
| 8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.3000 | 750,000   | 886,417   | 2026/06/20 |
| 3 4 4 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,730,000 | 2,782,416 | 2026/09/20 |
| 9 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.2000 | 700,000   | 825,734   | 2026/09/20 |
| 3 4 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,610,000 | 2,659,668 | 2026/12/20 |
| 9 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.1000 | 1,300,000 | 1,529,723 | 2026/12/20 |
| 3 4 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,370,000 | 2,414,556 | 2027/03/20 |
| 9 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.0000 | 700,000   | 821,233   | 2027/03/20 |
| 9 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.1000 | 800,000   | 945,088   | 2027/03/20 |
| 3 4 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,000,000 | 2,036,220 | 2027/06/20 |
| 9 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.3000 | 350,000   | 420,840   | 2027/06/20 |
| 3 4 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,230,000 | 2,268,645 | 2027/09/20 |
| 9 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.2000 | 500,000   | 599,430   | 2027/09/20 |
| 3 4 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 1,960,000 | 1,992,300 | 2027/12/20 |
| 9 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)   | 2.1000 | 900,000   | 1,074,744 | 2027/12/20 |
| 3 5 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,850,000 | 2,892,978 | 2028/03/20 |

| 銘柄                     | 当      | 期 末       |           |            |
|------------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                        |        | 利率        | 額面金額      | 評 価 額      |
| <b>(国債証券)</b>          | %      | 千円        | 千円        |            |
| 1 0 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 850,000   | 1,025,576 | 2028/03/20 |
| 3 5 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,360,000 | 2,393,205 | 2028/06/20 |
| 1 0 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.4000 | 660,000   | 811,390   | 2028/06/20 |
| 3 5 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,270,000 | 2,298,375 | 2028/09/20 |
| 1 0 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 700,000   | 843,465   | 2028/09/20 |
| 1 0 6 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 350,000   | 425,099   | 2028/09/20 |
| 1 0 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 650,000   | 785,525   | 2028/12/20 |
| 1 0 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 750,000   | 891,585   | 2028/12/20 |
| 1 0 9 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 770,000   | 918,078   | 2029/03/20 |
| 1 1 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 750,000   | 909,382   | 2029/03/20 |
| 1 1 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 570,000   | 699,327   | 2029/06/20 |
| 1 1 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 750,000   | 912,420   | 2029/06/20 |
| 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)     | 2.8000 | 100,000   | 129,117   | 2029/09/20 |
| 1 1 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,170,000 | 1,427,283 | 2029/09/20 |
| 1 1 4 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 500,000   | 611,865   | 2029/12/20 |
| 1 1 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 400,000   | 493,816   | 2029/12/20 |
| 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)     | 2.4000 | 100,000   | 125,947   | 2030/02/20 |
| 1 1 6 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 350,000   | 433,471   | 2030/03/20 |
| 1 1 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 950,000   | 1,166,077 | 2030/03/20 |
| 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)     | 2.3000 | 200,000   | 250,514   | 2030/05/20 |
| 1 1 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 290,000   | 353,779   | 2030/06/20 |
| 1 1 9 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 300,000   | 359,211   | 2030/06/20 |
| 1 2 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.6000 | 600,000   | 704,886   | 2030/06/20 |
| 1 2 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 730,000   | 884,657   | 2030/09/20 |
| 1 2 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 500,000   | 600,175   | 2030/09/20 |
| 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)     | 2.9000 | 200,000   | 266,182   | 2030/11/20 |
| 1 2 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 680,000   | 842,146   | 2030/12/20 |
| 1 2 4 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 500,000   | 613,350   | 2030/12/20 |
| 1 2 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 260,000   | 326,003   | 2031/03/20 |
| 1 2 6 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 450,000   | 553,459   | 2031/03/20 |
| 1 2 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 450,000   | 548,068   | 2031/03/20 |
| 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)     | 2.2000 | 200,000   | 251,162   | 2031/05/20 |
| 1 2 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 850,000   | 1,037,161 | 2031/06/20 |
| 1 2 9 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 240,000   | 289,920   | 2031/06/20 |
| 1 3 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 900,000   | 1,089,621 | 2031/09/20 |
| 1 3 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 450,000   | 539,217   | 2031/09/20 |
| 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)     | 2.4000 | 200,000   | 257,638   | 2031/11/20 |
| 1 3 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 660,000   | 792,402   | 2031/12/20 |
| 1 3 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 720,000   | 873,547   | 2031/12/20 |
| 1 3 4 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 470,000   | 571,393   | 2032/03/20 |
| 1 3 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 500,000   | 601,425   | 2032/03/20 |
| 1 3 6 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.6000 | 500,000   | 594,985   | 2032/03/20 |
| 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)     | 2.3000 | 300,000   | 384,843   | 2032/05/20 |
| 1 3 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 490,000   | 590,116   | 2032/06/20 |

| 銘柄               | 当      | 期 末       |           |            |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                  |        | 利率        | 額面金額      | 評価額        |
| (国債証券)           | %      | 千円        | 千円        |            |
| 138回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 250,000   | 294,532   | 2032/06/20 |
| 139回 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 580,000   | 690,907   | 2032/06/20 |
| 140回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 990,000   | 1,194,435 | 2032/09/20 |
| 8回 利付国庫債券(30年)   | 1.8000 | 200,000   | 244,346   | 2032/11/22 |
| 141回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 900,000   | 1,087,713 | 2032/12/20 |
| 142回 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 600,000   | 733,266   | 2032/12/20 |
| 143回 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 660,000   | 789,868   | 2033/03/20 |
| 144回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 410,000   | 485,034   | 2033/03/20 |
| 11回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 200,000   | 242,502   | 2033/06/20 |
| 145回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 1,200,000 | 1,455,012 | 2033/06/20 |
| 12回 利付国庫債券(30年)  | 2.1000 | 200,000   | 254,426   | 2033/09/20 |
| 146回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 1,100,000 | 1,335,873 | 2033/09/20 |
| 13回 利付国庫債券(30年)  | 2.0000 | 300,000   | 378,117   | 2033/12/20 |
| 147回 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 1,280,000 | 1,538,329 | 2033/12/20 |
| 14回 利付国庫債券(30年)  | 2.4000 | 290,000   | 383,455   | 2034/03/20 |
| 148回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 1,080,000 | 1,283,774 | 2034/03/20 |
| 15回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 200,000   | 268,074   | 2034/06/20 |
| 149回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 1,250,000 | 1,487,462 | 2034/06/20 |
| 16回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 400,000   | 537,504   | 2034/09/20 |
| 150回 利付国庫債券(20年) | 1.4000 | 1,260,000 | 1,480,815 | 2034/09/20 |
| 17回 利付国庫債券(30年)  | 2.4000 | 200,000   | 266,140   | 2034/12/20 |
| 151回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,160,000 | 1,327,944 | 2034/12/20 |
| 18回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 420,000   | 553,606   | 2035/03/20 |
| 152回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,140,000 | 1,305,493 | 2035/03/20 |
| 19回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 200,000   | 264,166   | 2035/06/20 |
| 153回 利付国庫債券(20年) | 1.3000 | 1,110,000 | 1,288,943 | 2035/06/20 |
| 20回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 300,000   | 406,902   | 2035/09/20 |
| 154回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,150,000 | 1,317,773 | 2035/09/20 |
| 21回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 300,000   | 397,794   | 2035/12/20 |
| 155回 利付国庫債券(20年) | 1.0000 | 1,180,000 | 1,313,481 | 2035/12/20 |
| 22回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 470,000   | 640,177   | 2036/03/20 |
| 156回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 870,000   | 881,275   | 2036/03/20 |
| 23回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 200,000   | 272,982   | 2036/06/20 |
| 157回 利付国庫債券(20年) | 0.2000 | 900,000   | 880,083   | 2036/06/20 |
| 24回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 300,000   | 410,643   | 2036/09/20 |
| 158回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 980,000   | 1,006,861 | 2036/09/20 |
| 25回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 400,000   | 534,588   | 2036/12/20 |
| 159回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 920,000   | 959,431   | 2036/12/20 |
| 26回 利付国庫債券(30年)  | 2.4000 | 700,000   | 949,795   | 2037/03/20 |
| 160回 利付国庫債券(20年) | 0.7000 | 1,050,000 | 1,112,517 | 2037/03/20 |
| 161回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 950,000   | 988,380   | 2037/06/20 |
| 27回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 700,000   | 966,119   | 2037/09/20 |
| 162回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 950,000   | 987,154   | 2037/09/20 |
| 163回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 960,000   | 996,259   | 2037/12/20 |

| 銘柄               | 当      | 期 末       |           |            |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                  |        | 利率        | 額面金額      | 評価額        |
| (国債証券)           | %      | 千円        | 千円        |            |
| 28回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 680,000   | 941,616   | 2038/03/20 |
| 164回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 1,210,000 | 1,231,453 | 2038/03/20 |
| 165回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 1,220,000 | 1,239,666 | 2038/06/20 |
| 29回 利付国庫債券(30年)  | 2.4000 | 900,000   | 1,233,792 | 2038/09/20 |
| 166回 利付国庫債券(20年) | 0.7000 | 880,000   | 925,443   | 2038/09/20 |
| 30回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 960,000   | 1,302,816 | 2039/03/20 |
| 31回 利付国庫債券(30年)  | 2.2000 | 700,000   | 939,736   | 2039/09/20 |
| 32回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 960,000   | 1,312,204 | 2040/03/20 |
| 33回 利付国庫債券(30年)  | 2.0000 | 1,070,000 | 1,403,326 | 2040/09/20 |
| 34回 利付国庫債券(30年)  | 2.2000 | 1,040,000 | 1,411,363 | 2041/03/20 |
| 35回 利付国庫債券(30年)  | 2.0000 | 1,120,000 | 1,477,548 | 2041/09/20 |
| 36回 利付国庫債券(30年)  | 2.0000 | 1,050,000 | 1,390,420 | 2042/03/20 |
| 37回 利付国庫債券(30年)  | 1.9000 | 1,020,000 | 1,332,619 | 2042/09/20 |
| 38回 利付国庫債券(30年)  | 1.8000 | 720,000   | 927,223   | 2043/03/20 |
| 39回 利付国庫債券(30年)  | 1.9000 | 630,000   | 826,786   | 2043/06/20 |
| 40回 利付国庫債券(30年)  | 1.8000 | 650,000   | 838,734   | 2043/09/20 |
| 41回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 510,000   | 647,388   | 2043/12/20 |
| 42回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 680,000   | 863,838   | 2044/03/20 |
| 43回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 700,000   | 889,931   | 2044/06/20 |
| 44回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 610,000   | 776,795   | 2044/09/20 |
| 45回 利付国庫債券(30年)  | 1.5000 | 700,000   | 859,222   | 2044/12/20 |
| 46回 利付国庫債券(30年)  | 1.5000 | 930,000   | 1,142,002 | 2045/03/20 |
| 47回 利付国庫債券(30年)  | 1.6000 | 760,000   | 952,371   | 2045/06/20 |
| 48回 利付国庫債券(30年)  | 1.4000 | 740,000   | 892,136   | 2045/09/20 |
| 49回 利付国庫債券(30年)  | 1.4000 | 790,000   | 952,637   | 2045/12/20 |
| 50回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 760,000   | 802,902   | 2046/03/20 |
| 51回 利付国庫債券(30年)  | 0.3000 | 650,000   | 604,194   | 2046/06/20 |
| 52回 利付国庫債券(30年)  | 0.5000 | 910,000   | 890,562   | 2046/09/20 |
| 53回 利付国庫債券(30年)  | 0.6000 | 650,000   | 652,333   | 2046/12/20 |
| 54回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 650,000   | 685,366   | 2047/03/20 |
| 55回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 740,000   | 779,627   | 2047/06/20 |
| 56回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 700,000   | 736,862   | 2047/09/20 |
| 57回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 760,000   | 799,337   | 2047/12/20 |
| 58回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 1,010,000 | 1,061,338 | 2048/03/20 |
| 59回 利付国庫債券(30年)  | 0.7000 | 800,000   | 818,936   | 2048/06/20 |
| 60回 利付国庫債券(30年)  | 0.9000 | 640,000   | 689,113   | 2048/09/20 |
| 2回 利付国庫債券(40年)   | 2.2000 | 460,000   | 658,503   | 2049/03/20 |
| 3回 利付国庫債券(40年)   | 2.2000 | 490,000   | 705,595   | 2050/03/20 |
| 4回 利付国庫債券(40年)   | 2.2000 | 640,000   | 928,032   | 2051/03/20 |
| 5回 利付国庫債券(40年)   | 2.0000 | 580,000   | 812,029   | 2052/03/20 |
| 6回 利付国庫債券(40年)   | 1.9000 | 580,000   | 799,042   | 2053/03/20 |
| 7回 利付国庫債券(40年)   | 1.7000 | 630,000   | 833,294   | 2054/03/20 |
| 8回 利付国庫債券(40年)   | 1.4000 | 720,000   | 886,924   | 2055/03/20 |
| 9回 利付国庫債券(40年)   | 0.4000 | 1,100,000 | 998,415   | 2056/03/20 |

| 銘 柄              | 当 期 末  |             |             |            |
|------------------|--------|-------------|-------------|------------|
|                  | 利率     | 額面金額        | 評 価 額       | 償還年月日      |
| <b>(国債証券)</b>    | %      | 千円          | 千円          |            |
| 10回 利付国庫債券(40年)  | 0.9000 | 1,050,000   | 1,123,279   | 2057/03/20 |
| 11回 利付国庫債券(40年)  | 0.8000 | 480,000     | 496,252     | 2058/03/20 |
| 小 計              | -      | 212,600,000 | 234,177,067 | -          |
| <b>(地方債証券)</b>   | %      | 千円          | 千円          |            |
| 680回 東京都公募公債     | 1.3900 | 200,000     | 202,988     | 2020/03/19 |
| 336回 大阪府公募公債     | 1.4600 | 200,000     | 203,202     | 2020/03/30 |
| 22年度1回 広島県公募公債   | 1.3700 | 200,000     | 203,454     | 2020/05/27 |
| 685回 東京都公募公債     | 1.1300 | 500,000     | 507,445     | 2020/06/19 |
| 2回 川崎市公募公債 15年   | 1.6300 | 100,000     | 102,174     | 2020/06/22 |
| 22年度6回 愛知県公募公債   | 1.1780 | 200,000     | 203,368     | 2020/07/30 |
| 22年度8回 静岡県公募公債   | 1.0590 | 200,000     | 203,170     | 2020/08/25 |
| 688回 東京都公募公債     | 0.9400 | 200,000     | 202,928     | 2020/09/18 |
| 22年度3回 横浜市公募公債   | 1.1680 | 200,000     | 203,654     | 2020/09/18 |
| 22年度5回 横浜市公募公債   | 1.2650 | 200,000     | 204,536     | 2020/12/11 |
| 345回 大阪府公募公債     | 1.2600 | 300,000     | 306,858     | 2020/12/25 |
| 94回 共同発行市場公募地方債  | 1.2400 | 100,000     | 102,372     | 2021/01/25 |
| 22年度12回 北海道公募公債  | 1.2900 | 200,000     | 204,918     | 2021/01/28 |
| 23年度1回 千葉市公募公債   | 1.3700 | 200,000     | 205,886     | 2021/04/21 |
| 23年度2回 埼玉県公募公債   | 1.1900 | 200,000     | 205,320     | 2021/05/25 |
| 697回 東京都公募公債     | 1.1100 | 500,000     | 512,750     | 2021/06/18 |
| 99回 共同発行市場公募地方債  | 1.1700 | 700,000     | 718,991     | 2021/06/25 |
| 701回 東京都公募公債     | 0.9900 | 700,000     | 717,570     | 2021/09/17 |
| 23年度4回 横浜市公募公債   | 1.0450 | 450,000     | 462,640     | 2021/11/12 |
| 23年度9回 静岡県公募公債   | 1.0450 | 200,000     | 205,690     | 2021/11/25 |
| 356回 大阪府公募公債     | 1.0600 | 200,000     | 205,900     | 2021/12/27 |
| 106回 共同発行市場公募地方債 | 0.9700 | 300,000     | 308,406     | 2022/01/25 |
| 23年度20回 愛知県公募公債  | 1.0820 | 500,000     | 516,625     | 2022/03/29 |
| 109回 共同発行市場公募地方債 | 1.0500 | 500,000     | 516,505     | 2022/04/25 |
| 708回 東京都公募公債     | 0.8900 | 500,000     | 514,625     | 2022/06/20 |
| 111回 共同発行市場公募地方債 | 0.8900 | 700,000     | 720,545     | 2022/06/24 |
| 364回 大阪府公募公債     | 0.7900 | 300,000     | 308,292     | 2022/09/27 |
| 194回 神奈川県公募公債    | 0.7910 | 300,000     | 308,949     | 2022/12/20 |
| 24年度7回 千葉県公募公債   | 0.7400 | 300,000     | 308,370     | 2022/12/22 |
| 119回 共同発行市場公募地方債 | 0.8000 | 500,000     | 515,795     | 2023/02/24 |
| 121回 共同発行市場公募地方債 | 0.5700 | 500,000     | 511,625     | 2023/04/25 |
| 25年度4回 愛知県公募公債   | 0.8560 | 300,000     | 310,809     | 2023/05/30 |
| 720回 東京都公募公債     | 0.8700 | 300,000     | 311,136     | 2023/06/20 |
| 25年度4回 札幌市公募公債   | 0.8000 | 200,000     | 206,816     | 2023/06/20 |
| 25年度2回 横浜市公募公債   | 0.8880 | 400,000     | 415,416     | 2023/07/14 |
| 374回 大阪府公募公債     | 0.9380 | 300,000     | 312,198     | 2023/07/28 |
| 25年度5回 千葉県公募公債   | 0.8400 | 200,000     | 207,496     | 2023/08/25 |
| 126回 共同発行市場公募地方債 | 0.8100 | 793,900     | 823,163     | 2023/09/25 |
| 127回 共同発行市場公募地方債 | 0.6800 | 500,000     | 515,710     | 2023/10/25 |
| 128回 共同発行市場公募地方債 | 0.6600 | 300,000     | 309,306     | 2023/11/24 |

| 銘 柄                    | 当 期 末  |            |            |            |
|------------------------|--------|------------|------------|------------|
|                        | 利率     | 額面金額       | 評 価 額      | 償還年月日      |
| <b>(地方債証券)</b>         | %      | 千円         | 千円         |            |
| 726回 東京都公募公債           | 0.7300 | 400,000    | 413,948    | 2023/12/20 |
| 25年度11回 福岡県公募公債        | 0.6940 | 200,000    | 206,880    | 2024/02/26 |
| 208回 神奈川県公募公債          | 0.5510 | 300,000    | 308,685    | 2024/06/20 |
| 1回 兵庫県公募公債(12年)        | 1.1000 | 300,000    | 317,364    | 2024/06/26 |
| 26年度5回 埼玉県公募公債         | 0.6110 | 400,000    | 413,108    | 2024/07/29 |
| 137回 共同発行市場公募地方債       | 0.5660 | 500,000    | 515,340    | 2024/08/23 |
| 488回 名古屋市公募公債 10年      | 0.5980 | 450,000    | 464,796    | 2024/09/20 |
| 139回 共同発行市場公募地方債       | 0.5440 | 500,000    | 515,190    | 2024/10/25 |
| 26年度11回 京都府公募公債        | 0.4760 | 350,000    | 359,534    | 2024/12/19 |
| 142回 共同発行市場公募地方債       | 0.3450 | 500,000    | 509,955    | 2025/01/24 |
| 26年度17回 兵庫県公募公債        | 0.4600 | 200,000    | 205,302    | 2025/02/26 |
| 5回 東京都公募公債 20年         | 2.1100 | 100,000    | 112,779    | 2025/03/19 |
| 144回 共同発行市場公募地方債       | 0.4700 | 400,000    | 411,228    | 2025/03/25 |
| 146回 共同発行市場公募地方債       | 0.5530 | 400,000    | 413,600    | 2025/05/23 |
| 148回 共同発行市場公募地方債       | 0.5530 | 500,000    | 517,470    | 2025/07/25 |
| 1回 静岡県公募公債 20年         | 2.1800 | 100,000    | 114,298    | 2025/09/19 |
| 9回 東京都公募公債 20年         | 2.4400 | 200,000    | 235,646    | 2026/06/19 |
| 10回 東京都公募公債 20年        | 2.3300 | 300,000    | 352,782    | 2026/09/18 |
| 4回 京都市公募公債 20年         | 2.5100 | 100,000    | 118,960    | 2026/09/18 |
| 166回 共同発行市場公募地方債       | 0.1800 | 500,000    | 505,355    | 2027/01/25 |
| 29年度4回 大阪市公募公債         | 0.1500 | 200,000    | 201,538    | 2027/09/21 |
| 30年度1回 神戸市公募公債 30年     | 0.2540 | 300,000    | 303,813    | 2028/09/20 |
| 24年度2回 福岡県公募公債(20年)    | 1.6350 | 300,000    | 351,966    | 2032/08/16 |
| 14回 埼玉県公募公債 20年        | 1.5460 | 300,000    | 352,377    | 2034/05/08 |
| 小 計                    | -      | 21,443,900 | 22,249,515 | -          |
| <b>(特殊債券)</b>          | %      | 千円         | 千円         |            |
| 10回 政保地方公共団体金融機構債券     | 1.3000 | 500,000    | 507,220    | 2020/03/13 |
| 15回 政保地方公共団体金融機構債券     | 1.0000 | 200,000    | 203,126    | 2020/08/14 |
| 20回 政保地方公共団体金融機構債券     | 1.2000 | 300,000    | 307,218    | 2021/01/20 |
| 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構   | 1.9000 | 100,000    | 104,106    | 2021/03/26 |
| 24回 地方公共団体金融機構債券       | 1.2080 | 300,000    | 308,169    | 2021/05/28 |
| 18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構  | 2.2000 | 300,000    | 317,124    | 2021/08/30 |
| 149回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.0000 | 400,000    | 411,680    | 2021/11/30 |
| 36回 政保地方公共団体金融機構債券     | 0.9010 | 300,000    | 309,315    | 2022/05/20 |
| 96回 高速道路機構債            | 0.7960 | 700,000    | 719,138    | 2022/09/20 |
| 180回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.7340 | 1,000,000  | 1,030,380  | 2022/12/28 |
| 44回 政保地方公共団体金融機構債券     | 0.8340 | 400,000    | 413,924    | 2023/01/20 |
| 55回 鉄道建設運輸施設債          | 0.8420 | 500,000    | 516,280    | 2023/03/20 |
| 189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.5410 | 500,000    | 512,435    | 2023/04/28 |
| 193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.8820 | 500,000    | 520,425    | 2023/06/30 |
| 50回 政保地方公共団体金融機構債券     | 0.9110 | 500,000    | 521,265    | 2023/07/14 |
| 195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.9110 | 330,000    | 344,196    | 2023/07/31 |
| 116回 高速道路機構債           | 0.7220 | 100,000    | 103,129    | 2023/09/20 |
| 56回 政保地方公共団体金融機構債券     | 0.7470 | 542,000    | 563,474    | 2024/01/19 |

| 銘 柄                        | 当 期 末  |            |            |            |
|----------------------------|--------|------------|------------|------------|
|                            | 利率     | 額面金額       | 評 価 額      | 償還年月日      |
| <b>(特殊債券)</b>              | %      | 千円         | 千円         |            |
| 6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券       | 0.5440 | 300,000    | 310,050    | 2024/09/13 |
| 2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構   | 0.4500 | 500,000    | 515,505    | 2025/03/31 |
| 8 3 回 地方公共団体金融機構債券 1 0 年   | 0.0900 | 400,000    | 401,432    | 2026/04/28 |
| 7 8 回 日本政策投資銀行債券           | 0.2250 | 200,000    | 202,362    | 2027/04/13 |
| 3 0 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構   | 0.1400 | 800,000    | 811,544    | 2027/04/30 |
| 2 2 2 回 住宅金融支援機構債券         | 0.2100 | 300,000    | 302,079    | 2027/11/19 |
| 2 3 0 回 住宅金融支援機構債券         | 0.2600 | 300,000    | 303,651    | 2028/02/18 |
| 1 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年     | 2.0700 | 200,000    | 236,678    | 2028/12/20 |
| 3 9 回 住宅金融支援機構債券           | 2.1500 | 200,000    | 240,610    | 2029/09/20 |
| 1 5 回 日本政策金融公庫債券           | 1.9110 | 200,000    | 237,772    | 2030/10/29 |
| 1 2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構   | 1.8000 | 500,000    | 592,880    | 2030/10/31 |
| 7 5 回 住宅金融支援機構債券           | 2.0660 | 350,000    | 424,739    | 2031/06/13 |
| 1 9 回 政保地方公共団体金融機構債券       | 1.8400 | 200,000    | 238,446    | 2031/12/26 |
| 1 3 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券      | 1.9600 | 16,924     | 17,384     | 2032/05/10 |
| 1 4 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券      | 1.7000 | 85,360     | 87,311     | 2032/05/10 |
| 1 5 回 国際協力機構債              | 1.7240 | 100,000    | 118,357    | 2032/09/17 |
| 2 4 回 政保地方公共団体金融機構債券 2 0 年 | 1.7020 | 200,000    | 236,216    | 2032/09/28 |
| 2 8 回 日本道路・機構承継債           | 2.8300 | 400,000    | 540,344    | 2033/12/20 |
| 2 3 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構   | 1.1600 | 300,000    | 338,991    | 2035/02/28 |
| 4 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年   | 1.2980 | 200,000    | 226,540    | 2035/06/28 |
| 1 7 2 回 高速道路機構債            | 0.2880 | 200,000    | 192,932    | 2036/06/20 |
| 6 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券        | 2.2600 | 42,762     | 44,886     | 2037/05/10 |
| 8 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券        | 2.1500 | 30,140     | 31,723     | 2037/05/10 |
| 9 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券        | 2.1900 | 44,832     | 47,035     | 2037/05/10 |
| 3 1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構   | 0.6300 | 200,000    | 205,962    | 2037/07/31 |
| 2 6 回 高速道路機構債              | 2.6700 | 200,000    | 275,914    | 2037/09/18 |
| 2 回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券      | 2.2700 | 47,898     | 50,841     | 2037/11/10 |
| 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 2.2800 | 16,027     | 16,931     | 2041/06/10 |
| 4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 2.3000 | 60,532     | 63,807     | 2041/07/10 |
| 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券        | 2.2100 | 45,024     | 47,286     | 2042/02/10 |
| 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 2.1300 | 76,495     | 80,007     | 2042/05/10 |
| 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.9500 | 160,090    | 172,354    | 2044/10/10 |
| 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.8100 | 277,296    | 294,929    | 2045/05/10 |
| 2 6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構   | 1.3900 | 200,000    | 235,020    | 2045/10/31 |
| 1 9 回 高速道路機構債              | 2.7500 | 150,000    | 223,767    | 2047/03/20 |
| 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.4300 | 285,063    | 287,925    | 2052/11/10 |
| 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.4200 | 286,293    | 288,944    | 2053/01/10 |
| 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.4000 | 290,136    | 292,329    | 2053/04/10 |
| 1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.4000 | 290,742    | 292,928    | 2053/05/10 |
| 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.4700 | 296,253    | 300,163    | 2053/10/10 |
| 小 計                        | -      | 16,423,867 | 17,541,186 | -          |
| <b>(金融債券)</b>              | %      | 千円         | 千円         |            |
| い第7 7 9 号 利付商工債            | 0.2200 | 200,000    | 200,430    | 2020/04/27 |
| い第7 8 3 号 利付商工債            | 0.2400 | 300,000    | 300,918    | 2020/08/27 |

| 銘 柄                         | 当 期 末  |           |           |            |
|-----------------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                             | 利率     | 額面金額      | 評 価 額     | 償還年月日      |
| <b>(金融債券)</b>               | %      | 千円        | 千円        |            |
| 2 2 0 号 利附商工債 (3 年)         | 0.1100 | 300,000   | 300,138   | 2021/05/27 |
| 3 2 5 回 利附信金中金債             | 0.0400 | 400,000   | 399,944   | 2021/12/27 |
| 小 計                         | -      | 1,200,000 | 1,201,430 | -          |
| <b>(普通社債券)</b>              | %      | 千円        | 千円        |            |
| 6 回 リそな銀行劣後社債               | 2.0840 | 100,000   | 102,079   | 2020/03/04 |
| 3 0 回 豊田自動織機社債              | 0.0010 | 200,000   | 199,946   | 2020/03/19 |
| 1 2 回 パナソニック社債              | 0.3870 | 200,000   | 200,722   | 2020/03/19 |
| 5 6 回 日産自動車社債               | 0.5540 | 100,000   | 100,500   | 2020/03/19 |
| 3 8 回 三井不動産社債               | 1.4970 | 200,000   | 203,142   | 2020/03/19 |
| 8 7 回 住友不動産社債               | 0.8770 | 100,000   | 100,818   | 2020/03/19 |
| 2 7 回 ラポバンク・ネダーランド円貨社債      | 0.3800 | 200,000   | 200,650   | 2020/05/22 |
| 2 6 0 回 北陸電力社債              | 2.3300 | 100,000   | 102,936   | 2020/05/25 |
| 1 4 回 大和証券グループ本社社債          | 1.2520 | 100,000   | 101,401   | 2020/05/27 |
| 7 回 三菱UFJ 信託銀行劣後社債          | 1.5900 | 200,000   | 203,932   | 2020/06/08 |
| 4 2 回 野村ホールディングス社債          | 1.2140 | 200,000   | 203,082   | 2020/06/19 |
| 9 回 日本たばこ産業社債               | 0.2170 | 200,000   | 200,542   | 2020/07/15 |
| 4 9 6 回 中部電力社債              | 1.2270 | 500,000   | 508,420   | 2020/07/24 |
| 1 5 回 トヨタファイナンス社債           | 1.8000 | 200,000   | 205,344   | 2020/08/21 |
| 1 5 回 東日本旅客鉄道社債             | 2.6500 | 300,000   | 312,039   | 2020/08/25 |
| 2 2 回 中日本高速道路債券             | 1.0360 | 300,000   | 304,848   | 2020/09/18 |
| 2 6 回 野村ホールディングス社債          | 1.5470 | 100,000   | 102,340   | 2020/09/24 |
| 2 2 回 三井住友銀行劣後社債            | 1.4300 | 200,000   | 204,300   | 2020/09/28 |
| 1 2 回 住友信託銀行劣後債             | 1.3730 | 100,000   | 102,212   | 2020/11/11 |
| 2 5 回 三菱東京UFJ 銀行劣後社債        | 1.3100 | 200,000   | 204,208   | 2020/11/12 |
| 2 3 回 三井住友銀行劣後社債            | 1.6100 | 400,000   | 411,088   | 2020/12/17 |
| 6 0 回 日本電信電話社債              | 1.3100 | 300,000   | 306,924   | 2020/12/18 |
| 2 8 回 三菱東京UFJ 銀行劣後社債        | 1.5600 | 200,000   | 205,510   | 2021/01/20 |
| 3 7 9 回 中国電力社債              | 0.6190 | 300,000   | 303,228   | 2021/01/25 |
| 3 3 7 回 東京交通債               | 2.2300 | 200,000   | 209,126   | 2021/03/19 |
| 4 7 3 回 東北電力社債              | 0.5970 | 300,000   | 303,417   | 2021/04/23 |
| 9 回 三菱UFJ 信託銀行劣後債           | 1.6800 | 100,000   | 103,402   | 2021/04/28 |
| 3 2 回 三菱東京UFJ 銀行劣後社債        | 1.6200 | 300,000   | 310,320   | 2021/06/09 |
| 3 2 0 回 北海道電力社債             | 0.5850 | 200,000   | 202,446   | 2021/12/24 |
| 6 回 東海旅客鉄道社債                | 2.3900 | 100,000   | 107,010   | 2022/02/15 |
| 1 9 回 東日本旅客鉄道社債             | 2.3600 | 100,000   | 106,984   | 2022/02/25 |
| 1 3 回 パナソニック社債              | 0.5680 | 100,000   | 101,306   | 2022/03/18 |
| 9 回 西日本旅客鉄道社債               | 2.2800 | 200,000   | 213,834   | 2022/03/25 |
| 4 5 回 住友商事社債                | 1.1170 | 100,000   | 103,049   | 2022/04/20 |
| 2 3 回 ジェイ エフイー ホールディングス社債   | 0.0900 | 100,000   | 99,860    | 2022/05/23 |
| 1 回 BPCE SA 円貨社債 (ソーシャルボンド) | 0.2140 | 200,000   | 199,158   | 2022/06/30 |
| 2 1 回 東日本旅客鉄道社債             | 2.0200 | 100,000   | 107,035   | 2022/09/20 |
| 9 4 回 丸紅社債                  | 1.1700 | 100,000   | 103,569   | 2022/10/12 |
| 5 7 回 東京三菱銀行社債              | 2.2200 | 200,000   | 215,582   | 2022/10/27 |
| 1 9 回 三菱ケミカルホールディングス社債      | 0.4760 | 100,000   | 101,337   | 2022/12/02 |

| 銘柄              | 当期     |         |         | 償還年月日      |
|-----------------|--------|---------|---------|------------|
|                 | 利率     | 額面金額    | 評価額     |            |
| (普通社債券)         | %      | 千円      | 千円      |            |
| 11回 東海旅客鉄道社債    | 1.1500 | 300,000 | 312,486 | 2022/12/20 |
| 18回 大阪ガス社債      | 1.4700 | 100,000 | 105,410 | 2022/12/20 |
| 518回 中部電力社債     | 0.1900 | 200,000 | 200,078 | 2023/01/25 |
| 14回 トヨタ自動車社債    | 0.9630 | 200,000 | 207,076 | 2023/03/20 |
| 10回 セブン銀行社債     | 0.8030 | 100,000 | 102,836 | 2023/03/20 |
| 47回 日立キャピタル社債   | 0.8740 | 200,000 | 205,664 | 2023/03/20 |
| 301回 北陸電力社債     | 1.1580 | 100,000 | 103,984 | 2023/03/24 |
| 23回 東京瓦斯社債      | 1.0100 | 300,000 | 312,129 | 2023/06/09 |
| 27回 NTTデータ社債    | 0.9000 | 100,000 | 103,527 | 2023/06/20 |
| 253回 四国電力社債     | 1.0000 | 200,000 | 207,264 | 2023/06/23 |
| 6回 JXホールディングス社債 | 1.1190 | 100,000 | 104,316 | 2023/07/19 |
| 377回 中国電力社債     | 1.1210 | 400,000 | 416,868 | 2023/08/25 |
| 10回 西日本旅客鉄道社債   | 2.0400 | 300,000 | 327,003 | 2023/09/20 |
| 48回 クレディセゾン社債   | 1.0380 | 100,000 | 103,512 | 2023/10/20 |
| 47回 住友商事社債      | 0.8580 | 100,000 | 103,114 | 2023/10/23 |
| 424回 九州電力社債     | 1.2330 | 200,000 | 209,670 | 2023/11/24 |
| 13回 東海旅客鉄道社債    | 2.0150 | 200,000 | 218,732 | 2023/12/20 |
| 38回 電源開発社債      | 0.9780 | 300,000 | 310,788 | 2023/12/20 |

| 銘柄                      | 当期     |             |             | 償還年月日      |
|-------------------------|--------|-------------|-------------|------------|
|                         | 利率     | 額面金額        | 評価額         |            |
| (普通社債券)                 | %      | 千円          | 千円          |            |
| 471回 東北電力社債             | 1.1680 | 400,000     | 418,232     | 2023/12/25 |
| 426回 九州電力社債             | 1.0640 | 400,000     | 416,568     | 2024/02/23 |
| 16回 トヨタ自動車社債            | 0.6450 | 200,000     | 205,518     | 2024/03/19 |
| 14回 東海旅客鉄道社債            | 2.2000 | 100,000     | 110,801     | 2024/03/19 |
| 72回 三菱地所社債              | 2.2800 | 100,000     | 111,836     | 2024/09/20 |
| 10回 三井住友信託銀行社債          | 0.5850 | 200,000     | 205,118     | 2024/10/28 |
| 6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債 | 0.8650 | 200,000     | 205,482     | 2024/11/28 |
| 321回 北海道電力社債            | 0.8860 | 161,000     | 166,007     | 2024/12/25 |
| 39回 東日本旅客鉄道社債           | 2.0500 | 300,000     | 337,086     | 2025/06/20 |
| 13回 電源開発社債              | 2.0400 | 200,000     | 221,980     | 2025/06/20 |
| 42回 東日本旅客鉄道社債           | 2.1100 | 200,000     | 226,254     | 2025/09/19 |
| 4回 東京地下鉄社債              | 2.3800 | 120,000     | 139,885     | 2026/06/19 |
| 307回 北陸電力社債             | 1.0550 | 100,000     | 105,548     | 2026/06/25 |
| 34回 政保西日本高速道路債券         | 0.3350 | 200,000     | 203,580     | 2027/02/16 |
| 340回 北海道電力社債            | 0.4800 | 300,000     | 301,323     | 2027/04/23 |
| 7回 ファーストリテイリング社債        | 0.4050 | 200,000     | 201,320     | 2028/06/06 |
| 小計                      | -      | 14,381,000  | 14,908,641  | -          |
| 合計                      | -      | 266,048,767 | 290,077,840 | -          |

## ■投資信託財産の構成

2019年2月14日現在

| 項目           | 当期          |    | 比率    |
|--------------|-------------|----|-------|
|              | 評価額         |    |       |
| 公社債          | 290,077,840 | 千円 | 92.9% |
| コール・ローン等、その他 | 22,099,018  |    | 7.1   |
| 投資信託財産総額     | 312,176,859 |    | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月14日)現在

| 項 目                         | 当 期 末            |
|-----------------------------|------------------|
| (A) 資 産                     | 312,176,859,148円 |
| コ ー ル ・ 公 司 債 等             | 21,292,428,667   |
| 未 前 社 債 (評価額)               | 290,077,840,370  |
| 利 費                         | 770,374,276      |
| 払 収 用 金                     | 36,215,835       |
| (B) 負 債                     | 20,063,933,000   |
| 未 払 金                       | 20,063,933,000   |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)       | 292,112,926,148  |
| 元 次 本 金                     | 223,973,156,427  |
| (D) 受 益 権 益 総 額             | 68,139,769,721   |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 223,973,156,427円 |
|                             | 13,042円          |

|                                |                  |                                       |                  |
|--------------------------------|------------------|---------------------------------------|------------------|
| (注1) 期首元本額                     | 276,633,033,886円 | 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                   | 518,138,794円     |
| 追加設定元本額                        | 113,380,695,236円 | ダイナミック・ナビゲーション                        | 1,967,915円       |
| 一部解約元本額                        | 166,040,572,695円 | リスク抑制世界8資産バランスファンド                    | 8,646,074,074円   |
| (注2) 期末における元本の内訳               |                  | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)               | 1,457,077円       |
| D I A M国内債券パッシブ・ファンド           | 18,190,812,393円  | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2015)               | 1,137,081円       |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型)         | 96,924,740円      | リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)               | 3,528,101円       |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型)         | 78,480,076円      | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)               | 2,289,786円       |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型)         | 24,093,695円      | 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>                  | 74,378,770円      |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)          | 812,042,492円     | リスクコントロール世界資産分散ファンド                   | 1,193,667,722円   |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)          | 224,528,250円     | 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                  | 290,676円         |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)          | 30,531,946円      | D I A Mエマージング債券ファンド                   | 9,450,010円       |
| たわらノーロード 国内債券                  | 5,608,098,569円   | D I A M国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)       | 7,747,418,144円   |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)         | 204,097,771円     | D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)       | 427,767,841円     |
| たわらノーロード バランス (堅実型)            | 49,073,204円      | One収益追求型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)     | 2,650,787,553円   |
| たわらノーロード バランス (標準型)            | 91,339,770円      | D I A Mグローバル・バランスファンド25VA             | 260,471,994円     |
| たわらノーロード バランス (積極型)            | 14,731,205円      | D I A Mグローバル・バランスファンド50VA             | 208,048,280円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)   | 5,325,112円       | D I A M国際分散バランスファンド30VA               | 65,779,975円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)   | 111,510,295円     | D I A M国際分散バランスファンド50VA               | 178,262,613円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 145,094,270円     | D I A M国内重視バランスファンド30VA               | 78,434,274円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)   | 38,636,385円      | D I A M国内重視バランスファンド50VA               | 34,112,030円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)   | 12,398,109円      | D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)     | 74,517,588円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型)         | 1,927,516円       | D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)     | 153,733,627円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)         | 1,439,484円       | D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)       | 5,107,603,663円   |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)       | 3,668,109円       | D I A Mバランスファンド35VA (適格機関投資家限定)       | 2,727,549,689円   |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)         | 652,905円         | D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)       | 5,036,022,852円   |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)         | 17,517円          | D I A Mグローバル・アセット・バランスVA              | 549,567,315円     |
| D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>    | 13,094,592,898円  | D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) | 244,393,101円     |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型     | 5,970,708,997円   | D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA        | 3,133,418,256円   |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型  | 8,327,473,971円   | D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)   | 651,756,777円     |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型     | 3,375,978,536円   | D I A Mグローバル8私募ファンド (適格機関投資家向け)       | 188,050,355円     |
| D I A M DCバランス30インデックスファンド     | 1,787,117,039円   | D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)     | 43,906,910円      |
| D I A M DCバランス50インデックスファンド     | 1,979,799,847円   | D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)     | 75,249,648円      |
| D I A M DCバランス70インデックスファンド     | 311,374,467円     | D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)  | 44,304,010,853円  |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)          | 87,494,470円      | D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 300,469,968円     |
| マネックス資産設計ファンド (育成型)            | 2,329,877,194円   | D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 6,766,577,431円   |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション         | 1,151,978円       | D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)  | 25,810,172,316円  |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 3,138,341,596円   | D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)           | 73,681,229円      |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 760,934,771円     | D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)           | 1,372,928円       |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 161,069,244円     | D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)           | 6,828,815円       |
| 投資のソムリエ                        | 4,442,528,933円   | D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)  | 28,718,365,712円  |
| クルーズコントロール                     | 2,280,157,246円   | D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)         | 406,399,314円     |
| 投資のソムリエ<DC年金>                  | 414,716,710円     | D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)         | 124,390,494円     |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>     | 2,350,099,207円   | D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)           | 499,470,914円     |
| D I A M DC バランス・F (成長型)        | 282,293,752円     | D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)           | 697,893円         |
| クルーズコントロール<DC年金>               | 1,617,997円       | D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)           | 371,935円         |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)        | 7,792,604円       | 期末元本合計                                | 223,973,156,427円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)        | 20,568,924円      |                                       |                  |

## ■損益の状況

当期 自2018年2月15日 至2019年2月14日

| 項                        | 目 | 当 期             |
|--------------------------|---|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益            |   | 3,244,221,605円  |
| 受 取 利 息                  |   | 3,246,909,909   |
| 支 払 利 息                  |   | △2,688,304      |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益      |   | 1,595,558,318   |
| 売 買 益                    |   | 3,108,405,375   |
| 売 買 損                    |   | △1,512,847,057  |
| (C) そ の 他 費 用            |   | △18,879         |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) |   | 4,839,761,044   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金        |   | 78,965,386,207  |
| (F) 解 約 差 損 益 金          |   | △48,373,562,294 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金      |   | 32,708,184,764  |
| (H) 合 計(D + E + F + G)   |   | 68,139,769,721  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)         |   | 68,139,769,721  |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

## 《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)



# 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第17期（決算日 2019年2月15日）

（計算期間 2018年2月16日～2019年2月15日）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17期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。

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 2002年9月2日から無期限です。  |
| 運用方針   | 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 海外の株式を主要投資対象とします。  |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。<br>外貨建資産への投資には、制限を設けません。                            |

### ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |       | MSCIコクサイ・インデックス                       |       | 株式組入<br>比率 | 株式先物<br>比率 | 純資産<br>総額 |
|-----------------|--------|-------|---------------------------------------|-------|------------|------------|-----------|
|                 | 円      | %     | （円換算ベース、配当込み、<br>為替ヘッジなし）<br>（ベンチマーク） | ポイント  |            |            |           |
| 13期(2015年2月16日) | 28,826 | 27.1  | 920,295.73                            | 27.4  | 94.1       | 3.4        | 319,197   |
| 14期(2016年2月15日) | 23,909 | △17.1 | 764,772.48                            | △16.9 | 96.1       | 1.2        | 242,694   |
| 15期(2017年2月15日) | 30,270 | 26.6  | 971,437.64                            | 27.0  | 95.6       | 1.7        | 278,963   |
| 16期(2018年2月15日) | 33,302 | 10.0  | 1,070,930.74                          | 10.2  | 95.7       | 2.2        | 284,448   |
| 17期(2019年2月15日) | 34,418 | 3.4   | 1,111,144.35                          | 3.8   | 95.3       | 2.0        | 349,689   |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

(注3) MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

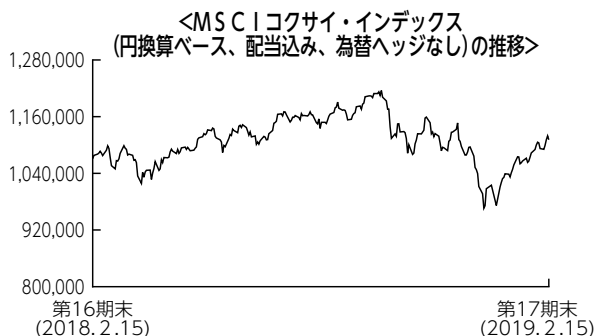
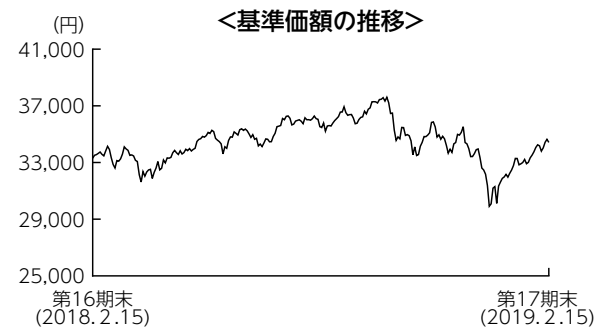
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                 | 基 準 価 額 |        | MSCIコクサイ・インデックス<br>(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |        | 株式組入<br>比 率 | 株式先物<br>比 率 |
|-----------------------|---------|--------|--|--------|-------------|-------------|
|                       | 円       | 騰 落 率  | ポ イ ン ト  | 騰 落 率  |             |             |
| (期 首)<br>2018年 2月 15日 | 33,302  | %<br>- | 1,070,930.74   | %<br>- | %<br>95.7   | %<br>2.2    |
| 2 月 末                 | 33,921  | 1.9    | 1,092,375.78   | 2.0    | 97.4        | 3.1         |
| 3 月 末                 | 32,479  | △2.5   | 1,046,334.72   | △2.3   | 93.9        | 1.1         |
| 4 月 末                 | 33,937  | 1.9    | 1,093,785.41   | 2.1    | 95.2        | 2.5         |
| 5 月 末                 | 34,109  | 2.4    | 1,098,796.93   | 2.6    | 95.2        | 2.3         |
| 6 月 末                 | 34,381  | 3.2    | 1,108,957.47   | 3.6    | 94.7        | 2.9         |
| 7 月 末                 | 35,743  | 7.3    | 1,153,118.50   | 7.7    | 95.4        | 2.3         |
| 8 月 末                 | 36,518  | 9.7    | 1,177,937.59   | 10.0   | 96.1        | 1.4         |
| 9 月 末                 | 37,443  | 12.4   | 1,208,801.25   | 12.9   | 95.5        | 2.1         |
| 10 月 末                | 34,147  | 2.5    | 1,102,226.36   | 2.9    | 93.1        | 4.5         |
| 11 月 末                | 34,935  | 4.9    | 1,127,410.37   | 5.3    | 95.8        | 1.0         |
| 12 月 末                | 31,298  | △6.0   | 1,009,333.65   | △5.8   | 94.2        | 3.1         |
| 2019年 1 月 末           | 33,329  | 0.1    | 1,074,489.99   | 0.3    | 93.8        | 3.5         |
| (期 末)<br>2019年 2月 15日 | 34,418  | 3.4    | 1,111,144.35   | 3.8    | 95.3        | 2.0         |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年2月16日から2019年2月15日まで）



### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は34,418円となり、前期末比で3.4%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

為替市場で米ドルを除いた多くの通貨に対して円高となったほか、ドイツやイタリアなど欧州の一部株式市場が下落したことはマイナスに寄与しました。一方で、米国株式市場が2018年10月から12月にかけて下落したものの、その後は回復軌道を迎ったことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

外国株式市場は、米国では米中貿易摩擦が警戒されながらも、良好な企業決算などを背景に堅調な展開となりましたが、2018年10月には米国長期金利の上昇が嫌気され急落しました。12月に実施された利上げも更なる下落を招きましたが、2019年1月には利上げ休止が示唆されたことに加え、米中通商協議の進展期待などから反転しました。欧州では米国市場の値上がりに支えられたものの、英国のEU（欧州連合）離脱問題やイタリアの財政懸念などがマイナス要因となり、まちまちの結果となりました。

為替市場では、米中貿易摩擦への懸念がくすぶる中、米ドルは米国企業の好決算や堅調な景気指標を受けて2018年12月中旬まで対円で上昇しましたが、12月下旬には世界的な株安や景気減速を巡る懸念、政府機関の一部閉鎖など米国の政治動向への不安が広がり、下落しました。2019年1月にも急落したものの、その後はリスク回避姿勢が緩和したことなどから、米ドル高の動きに回帰しました。ユーロは英国のEU離脱やイタリアの財政運営を巡る警戒感などから下落し、ユーロ安円高となりました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

## 【運用状況】

### ○組入株式上位10業種

#### 期首（前期末）

| No. | 業種                     | 比率    |
|-----|------------------------|-------|
| 1   | ソフトウェア・サービス            | 10.5% |
| 2   | 銀行                     | 9.9   |
| 3   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.8   |
| 4   | 資本財                    | 7.4   |
| 5   | エネルギー                  | 6.3   |
| 6   | 素材                     | 5.0   |
| 7   | 食品・飲料・タバコ              | 5.0   |
| 8   | 各種金融                   | 4.7   |
| 9   | 小売                     | 4.3   |
| 10  | ヘルスケア機器・サービス           | 4.1   |

#### 期末

| No. | 業種                     | 比率   |
|-----|------------------------|------|
| 1   | ソフトウェア・サービス            | 8.5% |
| 2   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.3  |
| 3   | 銀行                     | 8.1  |
| 4   | 資本財                    | 7.0  |
| 5   | エネルギー                  | 6.4  |
| 6   | メディア・娯楽                | 5.8  |
| 7   | ヘルスケア機器・サービス           | 4.8  |
| 8   | 食品・飲料・タバコ              | 4.7  |
| 9   | 小売                     | 4.6  |
| 10  | 素材                     | 4.4  |



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は各決算日時点のGICS（世界産業分類基準）によるものです。

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で3.8%上昇しました。当ファンドはベンチマーク比で△0.4%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

### 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

### ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目         | 当 期  |         |
|-------------|------|---------|
|             | 金 額  | 比 率     |
| (a) 売買委託手数料 | 1円   | 0.003%  |
| (株 式)       | ( 1) | (0.002) |
| (先物・オプション)  | ( 1) | (0.002) |
| (投資信託受益証券)  | ( 0) | (0.000) |
| (投 資 証 券)   | ( 0) | (0.000) |
| (b) 有価証券取引税 | 4    | 0.012   |
| (株 式)       | ( 4) | (0.012) |
| (投資信託受益証券)  | ( 0) | (0.000) |
| (投 資 証 券)   | ( 0) | (0.000) |
| (c) その他費用   | 6    | 0.017   |
| (そ の 他)     | ( 6) | (0.017) |
| 合 計         | 11   | 0.033   |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（34,450円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については13ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2018年2月16日から2019年2月15日まで)

(1) 株 式

|   |   | 買 |   | 付                          |                                 | 売                               |                               | 付                              |                          |                              |                      |                     |           |
|---|---|---|---|----------------------------|---------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------|------------------------------|----------------------|---------------------|-----------|
|   |   | 株 | 数 | 金                          | 額                               | 株                               | 数                             | 金                              | 額                        |                              |                      |                     |           |
| 外 | ア | メ | リ | カ                          | 百株<br>59,977.7<br>(2,252.4)     | 千アメリカ・ドル<br>450,883<br>(△9,827) | 百株<br>18,298.09               | 千アメリカ・ドル<br>97,560             |                          |                              |                      |                     |           |
|   | カ | ナ | ダ | 百株<br>9,633.05<br>(154.79) | 千カナダ・ドル<br>38,670<br>(△110)     | 百株<br>2,126.29                  | 千カナダ・ドル<br>7,336              |                                |                          |                              |                      |                     |           |
|   | オ | ー | ス | ト                          | ラ                               | リア                              | 百株<br>13,403.4<br>(1,344.65)  | 千オーストラリア・ドル<br>22,232<br>(△33) | 百株<br>2,684.2            | 千オーストラリア・ドル<br>3,011         |                      |                     |           |
|   | 香 |   |   | 港                          | 百株<br>17,225<br>(693.88)        | 千香港・ドル<br>69,657<br>(-)         | 百株<br>9,386                   | 千香港・ドル<br>10,638               |                          |                              |                      |                     |           |
|   | シ | ン | ガ | ポ                          | ー                               | ル                               | 百株<br>4,330<br>(-)            | 千シンガポール・ドル<br>3,675<br>(-)     | 百株<br>-                  | 千シンガポール・ドル<br>-              |                      |                     |           |
|   | ニ | ュ | ー | ジ                          | ー                               | ラ                               | ン                             | ド                              | 百株<br>2,582.28<br>(-)    | 千ニュージーランド・ドル<br>1,909<br>(-) | 百株<br>722.6          | 千ニュージーランド・ドル<br>592 |           |
|   | イ | ギ | リ | ス                          | 百株<br>64,232.84<br>(136,602.42) | 千イギリス・ポンド<br>36,610<br>(△257)   | 百株<br>155,342.95              | 千イギリス・ポンド<br>13,526            |                          |                              |                      |                     |           |
|   | イ | ス | ラ | エ                          | ル                               | 百株<br>314.46<br>(△19.53)        | 千イスラエル・シケル<br>2,148<br>(△672) | 百株<br>6.47                     | 千イスラエル・シケル<br>324        |                              |                      |                     |           |
|   | ス |   | イ | ス                          | 百株<br>3,560.74<br>(148.99)      | 千スイス・フラン<br>22,016<br>(△420)    | 百株<br>541.43                  | 千スイス・フラン<br>3,329              |                          |                              |                      |                     |           |
|   | デ | ン | マ | ー                          | ク                               | 百株<br>840.12<br>(-)             | 千デンマーク・クローネ<br>29,478<br>(-)  | 百株<br>889.53                   | 千デンマーク・クローネ<br>9,483     |                              |                      |                     |           |
|   | ノ | ル | ウ | ェ                          | ー                               | 百株<br>1,433.72<br>(-)           | 千ノルウェー・クローネ<br>18,626<br>(-)  | 百株<br>105.33                   | 千ノルウェー・クローネ<br>2,111     |                              |                      |                     |           |
|   | ス | ウ | ェ | ー                          | デ                               | ン                               | 百株<br>4,933.48<br>(1,849.69)  | 千スウェーデン・クローナ<br>58,882<br>(△8) | 百株<br>1,881.5            | 千スウェーデン・クローナ<br>8,823        |                      |                     |           |
| 国 | ユ | イ | イ | ギ                          | リ                               | ス                               | 百株<br>-                       | 千ユーロ<br>-                      | 百株<br>708.26             | 千ユーロ<br>1,281                |                      |                     |           |
|   |   |   | ア | イ                          | ル                               | ラ                               | ン                             | ド                              | 百株<br>799.56<br>(213.35) | 千ユーロ<br>1,860<br>(-)         | 百株<br>213.35         | 千ユーロ<br>2,894       |           |
|   |   |   | オ | ラ                          | ン                               | ダ                               | 百株<br>3,662.33<br>(△731.75)   | 千ユーロ<br>8,986<br>(△164)        | 百株<br>1,068.56           | 千ユーロ<br>1,853                |                      |                     |           |
|   |   |   | ベ | ル                          | ギ                               | ー                               | 百株<br>382.56<br>(-)           | 千ユーロ<br>2,296<br>(-)           | 百株<br>23.88              | 千ユーロ<br>228                  |                      |                     |           |
|   |   |   | ル | ク                          | セ                               | ン                               | ブ                             | ル                              | グ                        | 百株<br>989.97<br>(-)          | 千ユーロ<br>1,033<br>(-) | 百株<br>-             | 千ユーロ<br>- |
|   |   |   | フ | ラ                          | ン                               | ス                               | 百株<br>4,670.85<br>(2.25)      | 千ユーロ<br>22,778<br>(△92)        | 百株<br>456.26             | 千ユーロ<br>2,765                |                      |                     |           |
|   |   |   | ド |                            | イ                               | ツ                               | 百株<br>4,533.9<br>(481.28)     | 千ユーロ<br>21,827<br>(△370)       | 百株<br>1,585.13           | 千ユーロ<br>4,337                |                      |                     |           |

|     |             | 買 付         |                                | 売 付                  |                 |               |
|-----|-------------|-------------|--------------------------------|----------------------|-----------------|---------------|
|     |             | 株 数         | 金 額                            | 株 数                  | 金 額             |               |
| 外 国 | ユ ー ロ ョ ッ プ | ポ ル ト ガ ル   | 1,040.31<br>百株<br>(-)          | 千ユーロ<br>480<br>(-)   | 百株<br>-         | 千ユーロ<br>-     |
|     |             | ス ペ イ ン     | 10,840.28<br>百株<br>(24,625.24) | 千ユーロ<br>7,240<br>(-) | 25,985.66<br>百株 | 千ユーロ<br>1,833 |
|     |             | イ タ リ ア     | 13,019.42<br>百株<br>(169.72)    | 千ユーロ<br>5,212<br>(-) | 3,232.23<br>百株  | 千ユーロ<br>1,512 |
|     |             | フ ィ ン ラ ン ド | 1,301.96<br>百株<br>(232.9)      | 千ユーロ<br>2,216<br>(-) | 87.29<br>百株     | 千ユーロ<br>375   |
|     |             | オ ー ス ト リ ア | 141.92<br>百株<br>(-)            | 千ユーロ<br>564<br>(△24) | -<br>百株         | 千ユーロ<br>-     |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、株式分割、増資割当および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。

## (2) 投資信託受益証券、投資証券

|                                 | 買 付           |               | 売 付           |            |
|---------------------------------|---------------|---------------|---------------|------------|
|                                 | □ 数           | 金 額           | □ 数           | 金 額        |
| <b>アメリカ</b>                     | 千□            | 千アメリカ・ドル      | 千□            | 千アメリカ・ドル   |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT    | 4.807<br>(-)  | 588<br>(-)    | 2.467<br>(-)  | 307<br>(-) |
| BOSTON PROPERTIES INC           | 5.023<br>(-)  | 596<br>(-)    | 2.882<br>(-)  | 378<br>(-) |
| SL GREEN                        | 4.015<br>(-)  | 385<br>(-)    | 2.3<br>(-)    | 224<br>(-) |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT       | 48.026<br>(-) | 485<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| PROLOGIS INC                    | 16.198<br>(-) | 1,056<br>(-)  | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC       | 2.711<br>(-)  | 471<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| CAMDEN PROPERTY TRUST           | 1.777<br>(-)  | 164<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| EQUINIX INC                     | 1.516<br>(-)  | 571<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC  | 3.105<br>(-)  | 152<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| DUKE REALTY TRUST               | 18.889<br>(-) | 525<br>(-)    | 10.405<br>(-) | 296<br>(-) |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 7.368<br>(-)  | 775<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC        | 1.129<br>(-)  | 281<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| EQUITY RESIDENTIAL              | 5.906<br>(-)  | 394<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST       | 3.856<br>(-)  | 437<br>(-)    | 2<br>(-)      | 237<br>(-) |
| GGP INC                         | 7.4<br>(-)    | 150<br>(△281) | 50.863<br>(-) | 15<br>(-)  |
| HCP INC                         | 5.147<br>(-)  | 148<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP         | 2.108<br>(-)  | 372<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |
| WELLTOWER INC                   | 6.793<br>(-)  | 474<br>(-)    | -<br>(-)      | -<br>(-)   |

|                              | 買 付 額   |             | 売 付 額   |             |
|------------------------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                              | □ 数     | 金 額         | □ 数     | 金 額         |
| <b>アメリカ</b>                  | 千□      | 千アメリカ・ドル    | 千□      | 千アメリカ・ドル    |
| IRON MOUNTAIN INC            | 4.712   | 159         | —       | —           |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 12.854  | 240         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| MID AMERICA                  | 2.135   | 214         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| REALTY INCOME CORP           | 7.631   | 436         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| REGENCY CENTERS CORP         | 4.216   | 235         | 2.487   | 146         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| UDR INC                      | 4.2     | 153         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 4.675   | 794         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| PUBLIC STORAGE               | 2.57    | 541         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| VENTAS INC                   | 5.203   | 296         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| VORNADO REALTY TRUST         | 3.135   | 207         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| WEYERHAEUSER CO              | 11.76   | 354         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 3.744   | 343         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 3.27    | 363         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 19      | 340         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| VEREIT INC                   | 21      | 172         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| AMERICAN TOWER CORP          | 7.804   | 1,190       | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| WP CAREY INC                 | 15.148  | 989         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| INVITATION HOMES INC         | 7.86    | 158         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | —       | —           | 21.975  | 348         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 19.124  | 372         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| COLONY CAPITAL INC           | —       | —           | 39.311  | 231         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| <b>カナダ</b>                   | 千□      | 千カナダ・ドル     | 千□      | 千カナダ・ドル     |
| SMARTCENTRES REIT            | 6.706   | 224         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | —       | —           | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (△0.00003)  | (—)     | (—)         |
| <b>オーストラリア</b>               | 千□      | 千オーストラリア・ドル | 千□      | 千オーストラリア・ドル |
| LENDLEASE GROUP              | 23.508  | 335         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| STOCKLAND                    | 122.547 | 503         | 54.988  | 228         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| WESTFIELD CORP               | —       | —           | 140.035 | 1,236       |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| DEXUS                        | 16.777  | 165         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |
| GOODMAN GROUP                | 25.953  | 282         | (—)     | (—)         |
|                              | (—)     | (—)         | (—)     | (—)         |

|                              | 買 付       |             | 売 付    |             |
|------------------------------|-----------|-------------|--------|-------------|
|                              | □ 数       | 金 額         | □ 数    | 金 額         |
| <b>オーストラリア</b>               | 千□        | 千オーストラリア・ドル | 千□     | 千オーストラリア・ドル |
| SCENTRE GROUP                | 93.268    | 360         | —      | —           |
|                              | (—)       | (—)         | (—)    | (—)         |
| <b>香港</b>                    | 千□        | 千香港・ドル      | 千□     | 千香港・ドル      |
| LINK REIT                    | 22        | 1,735       | —      | —           |
|                              | (—)       | (—)         | (—)    | (—)         |
| <b>シンガポール</b>                | 千□        | 千シンガポール・ドル  | 千□     | 千シンガポール・ドル  |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV T   | —         | —           | —      | —           |
|                              | (—)       | (△2)        | (—)    | (—)         |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 384.8     | 673         | 178.5  | 305         |
|                              | (—)       | (—)         | (—)    | (—)         |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | —         | —           | —      | —           |
|                              | (—)       | (△2)        | (—)    | (—)         |
| <b>イギリス</b>                  | 千□        | 千イギリス・ポンド   | 千□     | 千イギリス・ポンド   |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 33.384    | 311         | 12.296 | 114         |
|                              | (—)       | (—)         | (—)    | (—)         |
| SEGRO PLC                    | 42.887    | 247         | 21.086 | 138         |
|                              | (—)       | (—)         | (—)    | (—)         |
| <b>ユーロ (オランダ)</b>            | 千□        | 千ユーロ        | 千□     | 千ユーロ        |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD    | 3.332     | 493         | 1.609  | 244         |
|                              | (10.338)  | (—)         | (—)    | (—)         |
| <b>ユーロ (フランス)</b>            | 千□        | 千ユーロ        | 千□     | 千ユーロ        |
| COVIVIO                      | 2.332     | 196         | —      | —           |
|                              | (—)       | (—)         | (—)    | (—)         |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 3.117     | 602         | —      | —           |
|                              | (△10.338) | (—)         | (—)    | (—)         |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

### (3) 先物取引の種類別取引状況

| 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     | 百万円     | 百万円   | 百万円   |
|                 | 109,193 | 108,526 | —     | —     |

(注) 金額は受渡代金です。

### ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目                           | 当 期           |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額         | 92,002,372千円  |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 299,138,263千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)       | 0.30          |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

### ■利害関係人との取引状況等 (2018年2月16日から2019年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。



## ■組入資産の明細

### (1) 外国株式

| 銘柄                                 | 期首(前期末)  |          | 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 |                    |
|                                    |          |          | 株数       | 株数        |       |        |                    |
| (アメリカ)                             | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |       |        |                    |
| AMAZON.COM INC                     | 288.29   | 361.08   | 58,590   | 6,470,750 |       |        | インターネット販売・通信販売     |
| ABBOTT LABORATORIES                | 1,226.02 | 1,515.76 | 11,212   | 1,238,261 |       |        | ヘルスケア機器・用品         |
| AES CORP                           | 455.79   | 556.31   | 949      | 104,814   |       |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ABIOMED INC                        | —        | 35.6     | 1,273    | 140,682   |       |        | ヘルスケア機器・用品         |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP        | 623.73   | 798.15   | 10,893   | 1,203,039 |       |        | 情報技術サービス           |
| ADVANCED MICRO DEVICES             | 595.29   | 763.85   | 1,766    | 195,123   |       |        | 半導体・半導体製造装置        |
| ADOBE INC                          | 351.38   | 422.94   | 11,002   | 1,215,100 |       |        | ソフトウェア             |
| CHUBB LTD                          | 327.73   | 393.78   | 5,147    | 568,489   |       |        | 保険                 |
| AGCO CORP                          | 56.1     | —        | —        | —         |       |        | 機械                 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC       | 150.19   | 194.65   | 3,340    | 368,934   |       |        | 化学                 |
| ALLEGHANY CORP                     | 10.54    | 13.25    | 855      | 94,450    |       |        | 保険                 |
| RALPH LAUREN CORP                  | 34.97    | 48.93    | 600      | 66,353    |       |        | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| ALLSTATE CORP                      | 257.54   | 306.51   | 2,857    | 315,592   |       |        | 保険                 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC        | 514.41   | 641.2    | 9,651    | 1,065,894 |       |        | コングロマリット           |
| AMGEN INC                          | 515.12   | 565.43   | 10,555   | 1,165,743 |       |        | バイオテクノロジー          |
| HESS CORP                          | 204.21   | 237.34   | 1,354    | 149,590   |       |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| AMERICAN EXPRESS CO                | 535.81   | 643.65   | 6,862    | 757,905   |       |        | 消費者金融              |
| AMERICAN ELECTRIC POWER            | 348.59   | 426.28   | 3,382    | 373,566   |       |        | 電力                 |
| AFLAC INC                          | 282.18   | 633.17   | 3,077    | 339,846   |       |        | 保険                 |
| AMERICAN INTL GROUP                | 634.48   | 779.1    | 3,131    | 345,810   |       |        | 保険                 |
| AMERCO                             | 5.51     | 5.51     | 208      | 23,028    |       |        | 陸運・鉄道              |
| ANALOG DEVICES                     | 258.69   | 329.62   | 3,444    | 380,377   |       |        | 半導体・半導体製造装置        |
| ANADARKO PETROLEUM CORP            | 387.91   | 428.77   | 1,878    | 207,407   |       |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC        | 160.15   | 194.82   | 2,453    | 270,949   |       |        | バイオテクノロジー          |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 645.78   | 810.35   | 2,807    | 310,100   |       |        | 建設関連製品             |
| TIME WARNER                        | 545.67   | —        | —        | —         |       |        | メディア               |
| JONES LANG LASALLE INC             | 28.18    | 40.87    | 672      | 74,259    |       |        | 不動産管理・開発           |
| VALERO ENERGY CORP                 | 321.05   | 372.19   | 3,111    | 343,676   |       |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| APACHE CORP                        | 250.25   | 360.95   | 1,179    | 130,233   |       |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ANSYS INC                          | 56.19    | 76.33    | 1,322    | 146,005   |       |        | ソフトウェア             |
| APPLE INC                          | 3,645.93 | 4,204.91 | 71,819   | 7,931,785 |       |        | コンピュータ・周辺機器        |
| APPLIED MATERIALS INC              | 753.04   | 831.06   | 3,383    | 373,645   |       |        | 半導体・半導体製造装置        |
| ALBEMARLE CORP                     | 79.04    | 98.26    | 790      | 87,270    |       |        | 化学                 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO          | 383.03   | 496.79   | 2,098    | 231,751   |       |        | 食品                 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP         | 78.31    | 96       | 859      | 94,932    |       |        | 電力                 |
| AMEREN CORP                        | 173.12   | 220.7    | 1,523    | 168,254   |       |        | 総合公益事業             |
| ARROW ELECTRONICS INC              | 57.56    | 83.46    | 674      | 74,512    |       |        | 電子装置・機器・部品         |
| AUTOLIV INC                        | 61.97    | 61.97    | 471      | 52,123    |       |        | 自動車部品              |
| AUTODESK INC                       | 142.59   | 192.95   | 3,086    | 340,822   |       |        | ソフトウェア             |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING          | 312.05   | 373.36   | 5,531    | 610,879   |       |        | 情報技術サービス           |
| AUTOZONE INC                       | 20.15    | 22.31    | 2,018    | 222,974   |       |        | 専門小売り              |
| AVERY DENNISON CORP                | 62.62    | 80.42    | 835      | 92,324    |       |        | 容器・包装              |
| AVNET INC                          | 102.88   | —        | —        | —         |       |        | 電子装置・機器・部品         |
| BALL CORP                          | 243.24   | 278.03   | 1,527    | 168,727   |       |        | 容器・包装              |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B        | 897.17   | 1,131.63 | 22,947   | 2,534,288 |       |        | 各種金融サービス           |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP       | 737.49   | 863.63   | 4,471    | 493,778   |       |        | 資本市場               |
| BAXTER INTERNATIONAL INC           | 348.76   | 449.71   | 3,257    | 359,780   |       |        | ヘルスケア機器・用品         |
| BECTON DICKINSON & CO              | 185.86   | 228.65   | 5,590    | 617,439   |       |        | ヘルスケア機器・用品         |
| AMETEK INC                         | 167.75   | 199.25   | 1,552    | 171,442   |       |        | 電気設備               |
| VERIZON COMM INC                   | 2,874.66 | 3,601.1  | 19,456   | 2,148,802 |       |        | 各種電気通信サービス         |
| WR BERKLEY CORP                    | 81.34    | 81.34    | 657      | 72,620    |       |        | 保険                 |
| BEST BUY CO INC                    | 192.1    | 232.06   | 1,382    | 152,670   |       |        | 専門小売り              |
| YUM! BRANDS INC                    | 237.38   | 278.59   | 2,614    | 288,752   |       |        | ホテル・レストラン・レジャー     |
| FIRSTENERGY CORP                   | 307.96   | 415.03   | 1,637    | 180,822   |       |        | 電力                 |

| 銘柄                                | 期首(前期末)  | 当期       |          | 期末        |     | 業種等                     |
|-----------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-----|-------------------------|
|                                   | 株数       | 株数       | 評価額      | 評価額       | 評価額 |                         |
|                                   |          |          | 千ドル      | 千円        |     |                         |
| (アメリカ)                            | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |     |                         |
| H&R BLOCK INC                     | 161.14   | 161.14   | 389      | 43,067    |     | 各種消費者サービス               |
| BOEING CO                         | 395.46   | 476.45   | 19,525   | 2,156,437 |     | 航空宇宙・防衛                 |
| ROBERT HALF INTL INC              | 81.58    | 108.27   | 717      | 79,253    |     | 専門サービス                  |
| BORGWARNER INC                    | 146.48   | 215.54   | 878      | 96,978    |     | 自動車部品                   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP            | 975.41   | 1,198.2  | 4,783    | 528,258   |     | ヘルスケア機器・用品              |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC       | 98.94    | 117.55   | 1,066    | 117,748   |     | 航空貨物・物流サービス             |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE     | 72.33    | 101.53   | 947      | 104,594   |     | 娯楽                      |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC  | 18.38    | 21.42    | 1,419    | 156,819   |     | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO           | 1,166.34 | 1,426.27 | 7,249    | 800,660   |     | 医薬品                     |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP INC     | 37.88    | 52.15    | 549      | 60,721    |     | 資本市場                    |
| INGREDION INC                     | 53.05    | 53.05    | 494      | 54,569    |     | 食品                      |
| ONEOK INC                         | 261.77   | 374.02   | 2,493    | 275,433   |     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC      | 44.18    | 59       | 570      | 62,983    |     | 保険                      |
| UNITED RENTALS INC                | 63.32    | 76.93    | 1,013    | 111,894   |     | 商社・流通業                  |
| SEMPRA ENERGY                     | 169.12   | 230.49   | 2,628    | 290,317   |     | 総合公益事業                  |
| FEDEX CORP                        | 181.03   | 215.25   | 3,958    | 437,218   |     | 航空貨物・物流サービス             |
| VERISIGN INC                      | 63.21    | 96.48    | 1,689    | 186,584   |     | 情報技術サービス                |
| AMPHENOL CORP                     | 214.9    | 252.01   | 2,297    | 253,688   |     | 電子装置・機器・部品              |
| BROWN-FORMAN CORP                 | 136.12   | 235.58   | 1,133    | 125,195   |     | 飲料                      |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC            | 1,270.92 | 1,532.41 | 907      | 100,189   |     | メディア                    |
| CSX CORP                          | 639.92   | 710.27   | 5,087    | 561,881   |     | 陸運・鉄道                   |
| CABOT OIL & GAS CORP              | 322.61   | 382.55   | 945      | 104,439   |     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CAMPBELL SOUP CO                  | 140.5    | 140.5    | 484      | 53,455    |     | 食品                      |
| SEAGATE TECHNOLOGY                | 206.13   | 243.37   | 1,113    | 123,019   |     | コンピュータ・周辺機器             |
| CONSTELLATION BRANDS INC          | 122.4    | 145.53   | 2,531    | 279,594   |     | 飲料                      |
| CARDINAL HEALTH INC               | 221.25   | 269.19   | 1,494    | 164,997   |     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED       | 249.16   | 354.48   | 2,024    | 223,539   |     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CATERPILLAR INC                   | 422.78   | 521.82   | 6,920    | 764,286   |     | 機械                      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 98.32    | 112.32   | 1,340    | 148,011   |     | ソフトウェア                  |
| CELGENE CORP                      | 547.31   | 608.71   | 5,519    | 609,604   |     | バイオテクノロジー               |
| CITRIX SYSTEMS INC                | 108.96   | 125.26   | 1,330    | 146,914   |     | ソフトウェア                  |
| CENTURYLINK INC                   | 636.8    | 804.24   | 1,027    | 113,512   |     | 各種電気通信サービス              |
| CERNER CORP                       | 208.09   | 264.14   | 1,500    | 165,694   |     | ヘルスケア・テクノロジー            |
| JPMORGAN CHASE & CO               | 2,489.45 | 2,927.32 | 29,981   | 3,311,169 |     | 銀行                      |
| CHURCH & DWIGHT CO INC            | 188.22   | 222.43   | 1,431    | 158,076   |     | 家庭用品                    |
| CIGNA CORP                        | 175.95   | —        | —        | —         |     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP         | 109.82   | 142.86   | 1,199    | 132,514   |     | 保険                      |
| CINTAS CORP                       | 62.82    | 79.44    | 1,600    | 176,704   |     | 商業サービス・用品               |
| CISCO SYSTEMS INC                 | 3,545.12 | 4,106.72 | 19,876   | 2,195,163 |     | 通信機器                    |
| CLOROX COMPANY                    | 93.31    | 108.85   | 1,701    | 187,954   |     | 家庭用品                    |
| COCA-COLA CO/THE                  | 2,862.56 | 3,520.46 | 16,049   | 1,772,537 |     | 飲料                      |
| COPART INC                        | —        | 189.44   | 1,021    | 112,831   |     | 商業サービス・用品               |
| COGNEX CORP                       | 115.08   | 152.91   | 747      | 82,528    |     | 電子装置・機器・部品              |
| COLGATE-PALMOLIVE CO              | 598.19   | 710      | 4,646    | 513,209   |     | 家庭用品                    |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A       | 224.36   | 263.13   | 3,121    | 344,710   |     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| COMERICA INC                      | 120.68   | 149.31   | 1,249    | 137,953   |     | 銀行                      |
| NRG ENERGY, INC.                  | —        | 256.31   | 1,092    | 120,615   |     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| COMCAST CORP-CL A                 | 3,332.55 | 3,943.84 | 14,694   | 1,622,887 |     | メディア                    |
| CA INC                            | 227.32   | —        | —        | —         |     | ソフトウェア                  |
| CONAGRA BRANDS INC                | 283.23   | 405.73   | 962      | 106,286   |     | 食品                      |
| CONSOLIDATED EDISON INC           | 217.5    | 267.33   | 2,086    | 230,404   |     | 総合公益事業                  |
| CMS ENERGY CORP                   | 192.91   | 236.16   | 1,239    | 136,927   |     | 総合公益事業                  |
| COOPER COS INC                    | 37.94    | 44.84    | 1,237    | 136,683   |     | ヘルスケア機器・用品              |
| MOLSON COORS BREWING CO           | 138.55   | 162      | 969      | 107,061   |     | 飲料                      |
| CORNING INC                       | 656.41   | 686.91   | 2,316    | 255,883   |     | 電子装置・機器・部品              |
| WR GRACE & CO                     | 33.14    | —        | —        | —         |     | 化学                      |
| SEALED AIR CORP                   | 138.7    | 138.7    | 583      | 64,488    |     | 容器・包装                   |

| 銘柄                             | 期首(前期末)  |          | 当期       |           | 業種等                     |
|--------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
|                                | 株数       | 株数       | 評価額      |           |                         |
|                                |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                         |
| (アメリカ)                         | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |                         |
| CUMMINS INC                    | 112.39   | 131.93   | 1,997    | 220,580   | 機械                      |
| DR HORTON INC                  | 244.98   | 321.52   | 1,279    | 141,324   | 家庭用耐久財                  |
| DANAHER CORP                   | 445.24   | 552.86   | 6,101    | 673,834   | ヘルスケア機器・用品              |
| MOODY'S CORP                   | 118.22   | 154.93   | 2,536    | 280,149   | 資本市場                    |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 415.89   | 503.31   | 3,680    | 406,441   | 情報技術サービス                |
| TARGET CORP                    | 374.86   | 436.5    | 3,150    | 347,958   | 複合小売り                   |
| DEERE & CO                     | 193.64   | 262.37   | 4,261    | 470,630   | 機械                      |
| MORGAN STANLEY                 | 962.61   | 1,132.17 | 4,610    | 509,150   | 資本市場                    |
| REPUBLIC SERVICES INC          | 173.75   | 198.91   | 1,522    | 168,162   | 商業サービス・用品               |
| COSTAR GROUP INC               | 22.78    | 29.94    | 1,220    | 134,835   | 専門サービス                  |
| THE WALT DISNEY CO             | 1,087.74 | 1,280.37 | 14,168   | 1,564,777 | 娯楽                      |
| DOLLAR TREE INC                | 174.93   | 200.78   | 1,978    | 218,481   | 複合小売り                   |
| DOVER CORP                     | 107.36   | 126.35   | 1,138    | 125,684   | 機械                      |
| OMNICOM GROUP                  | 169.93   | 193.25   | 1,435    | 158,532   | メディア                    |
| DTE ENERGY CO                  | 131.22   | 160.34   | 1,911    | 211,096   | 総合公益事業                  |
| DUKE ENERGY CORP               | 492.92   | 611.77   | 5,372    | 593,345   | 電力                      |
| FLOWERVE CORP                  | 84.06    | 131.39   | 608      | 67,242    | 機械                      |
| DARDEN RESTAURANTS INC         | 94.36    | 109.9    | 1,229    | 135,817   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| EBAY INC                       | 707.31   | 832.27   | 3,022    | 333,838   | インターネット販売・通信販売          |
| BANK OF AMERICA CORP           | 7,087.28 | 8,277.12 | 23,498   | 2,595,201 | 銀行                      |
| CITIGROUP INC                  | 1,934.5  | 2,166.9  | 13,525   | 1,493,788 | 銀行                      |
| EASTMAN CHEMICAL CO            | 101.93   | 130.09   | 1,063    | 117,465   | 化学                      |
| E*TRADE FINANCIAL CORP         | 187.4    | 216.24   | 1,006    | 111,192   | 資本市場                    |
| EATON CORP PLC                 | 322.34   | 384.09   | 2,965    | 327,473   | 電気設備                    |
| EATON VANCE CORP               | 91.84    | 91.84    | 368      | 40,662    | 資本市場                    |
| CADENCE DESIGN SYS INC         | 208.77   | 249.22   | 1,287    | 142,188   | ソフトウェア                  |
| DISH NETWORK CORP              | 161.5    | 217.62   | 646      | 71,380    | メディア                    |
| ECOLAB INC                     | 190.09   | 221.92   | 3,586    | 396,087   | 化学                      |
| ELECTRONIC ARTS INC            | 217.66   | 272.14   | 2,864    | 316,330   | 娯楽                      |
| SALESFORCE.COM INC             | 482.4    | 624.35   | 9,956    | 1,099,596 | ソフトウェア                  |
| EMERSON ELECTRIC CO            | 456.25   | 543.24   | 3,611    | 398,849   | 電気設備                    |
| ATMOS ENERGY CORP              | 82.21    | 102.2    | 980      | 108,309   | ガス                      |
| ENTERGY CORP                   | 121.99   | 162.59   | 1,458    | 161,051   | 電力                      |
| EOG RESOURCES INC              | 399.63   | 507.26   | 4,918    | 543,187   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| EQUIFAX INC                    | 84.95    | 102.31   | 1,114    | 123,081   | 専門サービス                  |
| EQT CORP                       | 171.49   | —        | —        | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE       | 161.34   | 194.24   | 2,979    | 329,028   | パーソナル用品                 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL       | 125.5    | 147.92   | 1,094    | 120,823   | 航空貨物・物流サービス             |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO     | 389.11   | —        | —        | —         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EXXON MOBIL CORP               | 2,987.36 | 3,696.52 | 28,193   | 3,113,674 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FMC CORP                       | 89.7     | 126.34   | 1,060    | 117,163   | 化学                      |
| NEXTERA ENERGY INC             | 335.13   | 412.34   | 7,529    | 831,584   | 電力                      |
| ASSURANT INC                   | 40.89    | 40.89    | 397      | 43,862    | 保険                      |
| FASTENAL CO                    | 216.54   | 254.18   | 1,585    | 175,082   | 商社・流通業                  |
| FIFTH THIRD BANCORP            | 521.73   | 600.5    | 1,592    | 175,878   | 銀行                      |
| M&T BANK CORP                  | 97.99    | 124.94   | 2,113    | 233,385   | 銀行                      |
| FISERV INC                     | 140.95   | 357.37   | 3,014    | 332,912   | 情報技術サービス                |
| FLIR SYSTEMS INC               | 116.23   | 116.23   | 598      | 66,081    | 電子装置・機器・部品              |
| MACY'S INC                     | 192.66   | 247.41   | 621      | 68,692    | 複合小売り                   |
| FORD MOTOR CO                  | 2,618.95 | 3,243.91 | 2,731    | 301,652   | 自動車                     |
| FRANKLIN RESOURCES INC         | 223.14   | 285.48   | 904      | 99,850    | 資本市場                    |
| FREEMPORT-MCMORAN INC          | 968.12   | 1,172.69 | 1,425    | 157,486   | 金属・鉱業                   |
| FLEX LTD                       | 359.13   | 676.69   | 692      | 76,452    | 電子装置・機器・部品              |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO        | 121.76   | 164.78   | 1,299    | 143,548   | 保険                      |
| GAP INC/THE                    | 182.95   | 182.95   | 455      | 50,350    | 専門小売り                   |
| DENTSPLY SIRONA INC            | 174.77   | 174.77   | 763      | 84,309    | ヘルスケア機器・用品              |
| GENERAL DYNAMICS CORP          | 179.42   | 221.43   | 3,810    | 420,865   | 航空宇宙・防衛                 |

| 銘柄                             | 期首(前期末)  |          | 当期       |           |                         | 業種等 |
|--------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|-----|
|                                | 株数       | 株数       | 評価額      |           | 業種等                     |     |
|                                |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                         |     |
| (アメリカ)                         | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |                         |     |
| GENERAL MILLS INC              | 387.27   | 527.09   | 2,347    | 259,217   | 食品                      |     |
| GENUINE PARTS CO               | 97.85    | 134.32   | 1,419    | 156,783   | 販売                      |     |
| GILEAD SCIENCES INC            | 919.6    | 1,133.77 | 7,524    | 831,042   | バイオテクノロジー               |     |
| GARTNER INC                    | 71.53    | 84.12    | 1,199    | 132,441   | 情報技術サービス                |     |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO      | 180.97   | 180.97   | 334      | 36,894    | 自動車部品                   |     |
| MCKESSON CORP                  | 150.54   | 168.48   | 2,264    | 250,058   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| NVIDIA CORP                    | 426.45   | 504.9    | 7,802    | 861,677   | 半導体・半導体製造装置             |     |
| GENERAL ELECTRIC CO            | 6,080.18 | 7,610.66 | 7,641    | 843,883   | コンプロマリット                |     |
| WW GRAINGER INC                | 38.32    | 43.31    | 1,350    | 149,143   | 商社・流通業                  |     |
| HALLIBURTON CO                 | 615.28   | 737.63   | 2,330    | 257,425   | エネルギー設備・サービス            |     |
| MONSTER BEVERAGE CORP          | 295.22   | 363.73   | 2,132    | 235,518   | 飲料                      |     |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC        | 253.81   | 307.11   | 5,912    | 653,008   | 資本市場                    |     |
| HARLEY-DAVIDSON INC            | 129.01   | 129.01   | 473      | 52,261    | 自動車                     |     |
| HARRIS CORP                    | 89.54    | 100.33   | 1,627    | 179,769   | 航空宇宙・防衛                 |     |
| HASBRO INC                     | 77.36    | 109.27   | 980      | 108,308   | レジャー用品                  |     |
| HENRY SCHEIN INC               | 114.26   | 138      | 860      | 95,056    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| HELMERICH & PAYNE INC          | 72.13    | 100.55   | 572      | 63,274    | エネルギー設備・サービス            |     |
| HERSHEY FOODS CORP             | 101.32   | 121.35   | 1,313    | 145,008   | 食品                      |     |
| HP INC                         | 1,227.25 | 1,376.54 | 3,197    | 353,154   | コンピュータ・周辺機器             |     |
| F5 NETWORKS INC                | 48.74    | 48.74    | 822      | 90,830    | 通信機器                    |     |
| CROWN HOLDINGS INC NPR         | 77.81    | 104.72   | 556      | 61,469    | 容器・包装                   |     |
| UNITED THERAPEUTICS CORP       | 34.47    | 34.47    | 408      | 45,126    | バイオテクノロジー               |     |
| JUNIPER NETWORKS INC           | 277.4    | 277.4    | 747      | 82,594    | 通信機器                    |     |
| HOLLYFRONTIER CORP             | 110.51   | 153.39   | 875      | 96,644    | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| HOLOGIC INC                    | 191.33   | 233.77   | 1,057    | 116,772   | ヘルスケア機器・用品              |     |
| UNUM GROUP                     | 160      | 207.2    | 733      | 80,983    | 保険                      |     |
| HOME DEPOT INC                 | 834.42   | 998.38   | 18,740   | 2,069,710 | 専門小売り                   |     |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC    | 128.87   | 150.79   | 1,409    | 155,657   | バイオテクノロジー               |     |
| HORMEL FOODS CORP              | 193.45   | 241.61   | 1,040    | 114,872   | 食品                      |     |
| CENTERPOINT ENERGY INC         | 319.52   | 430.2    | 1,326    | 146,477   | 総合公益事業                  |     |
| LENNOX INTERNATIONAL INC       | 23.37    | 35.69    | 871      | 96,261    | 建設関連製品                  |     |
| HUMANA INC                     | 104.68   | 119.62   | 3,607    | 398,385   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 59.27    | 73.59    | 825      | 91,114    | 陸運・鉄道                   |     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC      | 751.61   | 936.48   | 1,282    | 141,588   | 銀行                      |     |
| RED HAT INC                    | 120.98   | 158.43   | 2,852    | 314,981   | ソフトウェア                  |     |
| NEKTAR THERAPEUTICS            | -        | 156.89   | 668      | 73,847    | 医薬品                     |     |
| BIOGEN INC                     | 148.61   | 173.88   | 5,646    | 623,550   | バイオテクノロジー               |     |
| IDEX CORP                      | 46.99    | 71.74    | 1,012    | 111,777   | 機械                      |     |
| ILLINOIS TOOL WORKS            | 220.32   | 264.25   | 3,666    | 404,924   | 機械                      |     |
| INTUIT INC                     | 169.34   | 208.8    | 4,818    | 532,175   | ソフトウェア                  |     |
| IDEXX LABORATORIES INC         | 62.55    | 74.02    | 1,531    | 169,168   | ヘルスケア機器・用品              |     |
| INGERSOLL-RAND PLC             | 167.3    | 219.89   | 2,275    | 251,346   | 機械                      |     |
| INTEL CORP                     | 3,312.36 | 4,016.49 | 20,407   | 2,253,835 | 半導体・半導体製造装置             |     |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES      | 55.78    | 74.46    | 987      | 109,091   | 化学                      |     |
| INTERNATIONAL PAPER CO         | 283.75   | 329.83   | 1,533    | 169,382   | 容器・包装                   |     |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC   | 291.57   | 291.57   | 671      | 74,158    | メディア                    |     |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC   | 79.31    | 96.31    | 653      | 72,211    | 建設・土木                   |     |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC    | 41.73    | 72.47    | 959      | 105,943   | 情報技術サービス                |     |
| INCYTE CORP                    | 123.6    | 156.01   | 1,301    | 143,730   | バイオテクノロジー               |     |
| JOHNSON & JOHNSON              | 1,895.11 | 2,336.1  | 31,376   | 3,465,183 | 医薬品                     |     |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP    | 255.3    | 294.41   | 1,420    | 156,850   | 保険                      |     |
| KLA-TENCOR CORP                | 117.24   | 136.39   | 1,461    | 161,384   | 半導体・半導体製造装置             |     |
| DEVON ENERGY CORP              | 341.84   | 448.78   | 1,226    | 135,456   | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| WESTAR ENERGY INC              | 99.11    | -        | -        | -         | 電力                      |     |
| KELLOGG CO                     | 189.22   | 215.64   | 1,220    | 134,746   | 食品                      |     |
| EAST WEST BANCORP INC          | 85.09    | 146      | 775      | 85,603    | 銀行                      |     |
| KEYCORP                        | 715.5    | 885.11   | 1,506    | 166,373   | 銀行                      |     |

| 銘柄                            | 期首(前期末)  |          | 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       |       |        |                         |
| (アメリカ)                        | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |       |        |                         |
| KIMBERLY-CLARK CORP           | 242.02   | 301.75   | 3,525    | 389,405   |       |        | 家庭用品                    |
| BLACKROCK INC/NEW YORK        | 86.16    | 103.26   | 4,371    | 482,824   |       |        | 資本市場                    |
| KOHL'S CORP                   | 113.57   | 149.1    | 984      | 108,728   |       |        | 複合小売り                   |
| KROGER CO                     | 620.93   | 666.1    | 1,929    | 213,041   |       |        | 食品・生活必需品小売り             |
| LAM RESEARCH CORP             | 115.22   | 137.25   | 2,488    | 274,858   |       |        | 半導体・半導体製造装置             |
| PACKAGING CORP OF AMERICA     | 61.57    | 89.82    | 874      | 96,578    |       |        | 容器・包装                   |
| AKAMAI TECHNOLOGIES           | 126.22   | 154.52   | 1,093    | 120,787   |       |        | 情報技術サービス                |
| LEGGETT & PLATT INC           | 95.88    | 95.88    | 425      | 46,993    |       |        | 家庭用耐久財                  |
| LENNAR CORP                   | 162      | 260.65   | 1,257    | 138,864   |       |        | 家庭用耐久財                  |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC | 214.62   | 298.62   | 607      | 67,113    |       |        | 各種金融サービス                |
| ELI LILLY & CO                | 702.83   | 845.73   | 10,212   | 1,127,834 |       |        | 医薬品                     |
| L BRANDS INC                  | 162.62   | 216.98   | 591      | 65,347    |       |        | 専門小売り                   |
| LINCOLN NATIONAL CORP         | 141.63   | 188.9    | 1,131    | 125,005   |       |        | 保険                      |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B    | 479.82   | 605.55   | 6,770    | 747,684   |       |        | 航空貨物・物流サービス             |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 223.57   | 281.67   | 2,169    | 239,591   |       |        | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| LOCKHEED MARTIN CORP          | 182.4    | 225.6    | 6,790    | 749,949   |       |        | 航空宇宙・防衛                 |
| LOEWS CORP                    | 213.46   | 213.46   | 979      | 108,159   |       |        | 保険                      |
| RANGE RESOURCES CORP          | 136.97   | -        | -        | -         |       |        | 石油・ガス・消耗燃料              |
| LOWE'S COS INC                | 581.78   | 710.7    | 7,214    | 796,749   |       |        | 専門小売り                   |
| DOMINION ENERGY INC           | 451.31   | 654.73   | 4,772    | 527,128   |       |        | 総合公益事業                  |
| SCANA CORP                    | 109.02   | -        | -        | -         |       |        | 総合公益事業                  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL     | 321.98   | 464.14   | 1,270    | 140,297   |       |        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MCCORMICK & CO INC            | 74.76    | 109.52   | 1,395    | 154,095   |       |        | 食品                      |
| MCDONALD'S CORPORATION        | 575.15   | 675.89   | 11,886   | 1,312,786 |       |        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| S&P GLOBAL INC                | 184.09   | 215.99   | 4,230    | 467,227   |       |        | 資本市場                    |
| EVEREST RE GROUP LTD          | 28.55    | 37.51    | 802      | 88,668    |       |        | 保険                      |
| MANPOWERGROUP INC             | 42.57    | 62.65    | 523      | 57,857    |       |        | 専門サービス                  |
| MARKEL CORPORATION            | 9.89     | 12.22    | 1,234    | 136,358   |       |        | 保険                      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 147.74   | 185.26   | 3,262    | 360,343   |       |        | ヘルスケア機器・用品              |
| MARSH & MCLENNAN COS          | 358.21   | 435.93   | 3,929    | 434,019   |       |        | 保険                      |
| MASCO CORP                    | 230.43   | 286.38   | 1,066    | 117,813   |       |        | 建設関連製品                  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 43.87    | 53.82    | 1,009    | 111,441   |       |        | 建設資材                    |
| MATTEL INC                    | 240.03   | 240.03   | 405      | 44,826    |       |        | レジャー用品                  |
| METLIFE INC                   | 649.37   | 702.51   | 3,076    | 339,823   |       |        | 保険                      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS     | 203.42   | 243.23   | 1,356    | 149,864   |       |        | 半導体・半導体製造装置             |
| MEDTRONIC PLC                 | 951.77   | 1,179.47 | 10,760   | 1,188,368 |       |        | ヘルスケア機器・用品              |
| ACTIVISION BLIZZARD INC       | 500.52   | 629.53   | 2,859    | 315,853   |       |        | 娯楽                      |
| CVS HEALTH CORP               | 719.13   | 1,131.5  | 7,659    | 845,873   |       |        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MERCK & CO.INC.               | 1,931.11 | 2,319.3  | 18,308   | 2,021,996 |       |        | 医薬品                     |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION  | -        | 398.97   | 914      | 100,946   |       |        | 半導体・半導体製造装置             |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS  | 71.76    | 89.94    | 1,319    | 145,776   |       |        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MICROSOFT CORP                | 5,166.74 | 6,344.42 | 67,821   | 7,490,245 |       |        | ソフトウェア                  |
| MICRON TECH INC               | 761.46   | 1,016.04 | 4,290    | 473,868   |       |        | 半導体・半導体製造装置             |
| MIDDLEBY CORP                 | 41       | 41       | 508      | 56,174    |       |        | 機械                      |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC      | 153.31   | 202.69   | 1,836    | 202,808   |       |        | 半導体・半導体製造装置             |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD  | 264.63   | 552.42   | 1,060    | 117,076   |       |        | 半導体・半導体製造装置             |
| 3M CO                         | 424.07   | 505.59   | 10,361   | 1,144,275 |       |        | コングロマリット                |
| MOHAWK INDUSTRIES INC         | 40.42    | 60.93    | 845      | 93,400    |       |        | 家庭用耐久財                  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC        | 105.82   | 146.8    | 2,013    | 222,420   |       |        | 通信機器                    |
| KANSAS CITY SOUTHERN          | 72.47    | 88.56    | 928      | 102,598   |       |        | 陸運・鉄道                   |
| MYLAN NV                      | 313.44   | 435.74   | 1,373    | 151,684   |       |        | 医薬品                     |
| ILLUMINA INC                  | 104.53   | 126.9    | 3,711    | 409,891   |       |        | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| XCEL ENERGY INC               | 375.54   | 447.02   | 2,381    | 262,988   |       |        | 電力                      |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC    | 269.38   | 334.68   | 971      | 107,300   |       |        | エネルギー設備・サービス            |
| NETAPP INC                    | 183.87   | 231.04   | 1,470    | 162,435   |       |        | コンピュータ・周辺機器             |
| NEWFIELD EXPLORATION CO       | 137.4    | -        | -        | -         |       |        | 石油・ガス・消耗燃料              |
| NEWELL BRANDS INC             | 362.06   | 433.8    | 940      | 103,914   |       |        | 家庭用耐久財                  |

| 銘柄                             | 期首(前期末)  |          | 当期       |           | 業種等                     |
|--------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
|                                | 株数       | 株数       | 評価額      |           |                         |
|                                |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                         |
| (アメリカ)                         | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |                         |
| NEWMONT MINING CORP            | 380.93   | 455.65   | 1,508    | 166,616   | 金属・鉱業                   |
| NVR INC                        | 2.36     | 3.07     | 815      | 90,071    | 家庭用耐久財                  |
| NIKE INC-CL B                  | 925.05   | 1,120.86 | 9,491    | 1,048,234 | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NOBLE ENERGY INC               | 310.05   | 394.36   | 867      | 95,860    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| NORDSTROM INC                  | 94.87    | 94.87    | 416      | 45,995    | 複合小売り                   |
| NORFOLK SOUTHERN CORP          | 199.73   | 245.31   | 4,458    | 492,343   | 陸運・鉄道                   |
| EVERSOURCE ENERGY              | 230.85   | 270.88   | 1,898    | 209,711   | 電力                      |
| NISOURCE INC                   | 221.98   | 315.48   | 844      | 93,305    | 総合公益事業                  |
| TAPESTRY INC                   | 191.75   | 268.18   | 942      | 104,106   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NORTHERN TRUST CORP            | 160.9    | 178.67   | 1,630    | 180,116   | 資本市場                    |
| NORTHROP GRUMMAN CORP          | 115.69   | 139.67   | 3,919    | 432,829   | 航空宇宙・防衛                 |
| WELLS FARGO & CO               | 3,326.95 | 3,986.35 | 19,341   | 2,136,105 | 銀行                      |
| NUCOR CORP                     | 237.8    | 282.41   | 1,686    | 186,294   | 金属・鉱業                   |
| MONSANTO CO                    | 308.56   | -        | -        | -         | 化学                      |
| CHENIERE ENERGY INC            | 159.27   | 191.75   | 1,265    | 139,767   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP     | 330.07   | 417.83   | 3,326    | 367,361   | 消費者金融                   |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP      | 541.21   | 659.07   | 4,387    | 484,547   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE      | 38.14    | 49.17    | 712      | 78,669    | 陸運・鉄道                   |
| OGE ENERGY CORP                | 160.28   | 160.28   | 667      | 73,708    | 電力                      |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC        | 63.75    | 70.14    | 2,686    | 296,720   | 専門小売り                   |
| ORACLE CORP                    | 2,189.56 | 2,607.88 | 13,425   | 1,482,697 | ソフトウェア                  |
| PACCAR INC                     | 244.57   | 296.61   | 1,983    | 219,050   | 機械                      |
| PTC INC                        | -        | 100.28   | 912      | 100,770   | ソフトウェア                  |
| EXELON CORP                    | 699.1    | 821.76   | 3,932    | 434,354   | 電力                      |
| PARKER HANNIFIN CORP           | 88.08    | 110.23   | 1,863    | 205,822   | 機械                      |
| PAYCHEX INC                    | 231.41   | 287.92   | 2,164    | 239,024   | 情報技術サービス                |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD      | 65.26    | -        | -        | -         | 保険                      |
| ALIGN TECHNOLOGY INC           | 52.55    | 68.75    | 1,723    | 190,388   | ヘルスケア機器・用品              |
| PPL CORPORATION                | 456.66   | 632.29   | 1,931    | 213,330   | 電力                      |
| PEPSICO INC                    | 1,003.05 | 1,214.84 | 13,677   | 1,510,585 | 飲料                      |
| PENTAIR PLC                    | 117.75   | 168.69   | 705      | 77,929    | 機械                      |
| PFIZER INC                     | 4,197.44 | 5,112.13 | 21,455   | 2,369,557 | 医薬品                     |
| CONOCOPHILLIPS                 | 861.15   | 999.13   | 6,903    | 762,476   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PVH CORP                       | 53.87    | 68.62    | 771      | 85,173    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| PG&E CORP                      | 343.61   | -        | -        | -         | 電力                      |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO   | 121.58   | 143.08   | 2,047    | 226,091   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ALTRIA GROUP INC               | 1,359.28 | 1,645.68 | 8,086    | 893,114   | タバコ                     |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP   | 345.38   | 397.3    | 4,791    | 529,210   | 銀行                      |
| POLARIS INDUSTRIES INC         | 38.45    | 57.26    | 489      | 54,017    | レジャー用品                  |
| GARMIN LTD                     | 77.95    | 107.74   | 769      | 84,945    | 家庭用耐久財                  |
| AETNA INC                      | 237.44   | -        | -        | -         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| FLUOR CORP (NEW)               | 98.21    | 98.21    | 350      | 38,710    | 建設・土木                   |
| PPG INDUSTRIES INC             | 176.74   | 203.71   | 2,184    | 241,310   | 化学                      |
| IPG PHOTONICS CORP             | 24.41    | 36.52    | 546      | 60,321    | 電子装置・機器・部品              |
| PRAXAIR INC                    | 205.19   | -        | -        | -         | 化学                      |
| COSTCO WHOLESALE CORP          | 308.69   | 384.78   | 8,228    | 908,715   | 食品・生活必需品小売り             |
| T ROWE PRICE GROUP INC         | 163.03   | 218.16   | 2,123    | 234,527   | 資本市場                    |
| QUEST DIAGNOSTICS              | 103.78   | 128.75   | 1,100    | 121,573   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO            | 1,799.72 | 2,168.05 | 21,346   | 2,357,520 | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CORP               | 413.36   | 505.98   | 3,577    | 395,130   | 保険                      |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP   | 371.15   | 439.56   | 2,458    | 271,512   | 総合公益事業                  |
| PULTE GROUP INC                | 212.09   | 212.09   | 570      | 63,031    | 家庭用耐久財                  |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC | 303.88   | -        | -        | -         | 貯蓄・抵当・不動産金融             |
| GLOBAL PAYMENTS INC            | 107.69   | 134.06   | 1,629    | 179,961   | 情報技術サービス                |
| QUALCOMM INC                   | 1,042.28 | 1,227.58 | 6,330    | 699,154   | 半導体・半導体製造装置             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC    | 101.87   | 123.37   | 1,001    | 110,593   | 資本市場                    |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD     | 25.5     | 39.48    | 562      | 62,158    | 保険                      |

| 銘柄                                       | 期首(前期末)  |          | 当 期 末     |             | 業 種 等                   |
|--|----------|----------|-----------|-------------|-------------------------|
|  | 株 数      | 株 数      | 評 価 額     |             |                         |
|  |          |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |                         |
| (アメリカ)                                   | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル  | 千円          |                         |
| REGENERON PHARMACEUTICALS                | 56.59    | 70.45    | 2,923     | 322,867     | バイオテクノロジー               |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC         | 46.42    | 60.79    | 859       | 94,897      | 保険                      |
| AUTONATION INC                           | 57.72    | —        | —         | —           | 専門小売り                   |
| RESMED INC                               | 93.94    | 122.71   | 1,220     | 134,762     | ヘルスケア機器・用品              |
| US BANCORP                               | 1,186.41 | 1,351.09 | 6,817     | 752,935     | 銀行                      |
| SEATTLE GENETICS INC /WA                 | 73.17    | 102.69   | 704       | 77,765      | バイオテクノロジー               |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                   | 86.74    | 371.25   | 1,155     | 127,594     | 保険                      |
| ROSS STORES INC                          | 281.89   | 328.58   | 3,065     | 338,534     | 専門小売り                   |
| ROLLINS INC                              | 53.57    | 123.78   | 491       | 54,243      | 商業サービス・用品               |
| ROPER TECHNOLOGIES INC                   | 69.83    | 92.48    | 2,830     | 312,655     | コンプロマリット                |
| ROCKWELL AUTOMATION INC                  | 88.67    | 104.39   | 1,841     | 203,380     | 電気設備                    |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD              | 122.93   | 141.21   | 1,655     | 182,807     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| RAYTHEON COMPANY                         | 204.63   | 246.16   | 4,458     | 492,418     | 航空宇宙・防衛                 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP               | 38.48    | 38.48    | 642       | 70,957      | 情報技術サービス                |
| ACCENTURE PLC-CL A                       | 437.4    | 558.07   | 8,809     | 972,880     | 情報技術サービス                |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC               | 1,064.78 | 1,256.93 | 5,947     | 656,874     | 食品                      |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC                 | 88.49    | 110.16   | 1,856     | 204,998     | 保険                      |
| ROCKWELL COLLINS INC                     | 120.86   | —        | —         | —           | 航空宇宙・防衛                 |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC              | 197.55   | 231.27   | 2,935     | 324,197     | 保険                      |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION            | 227.18   | 293.13   | 3,115     | 344,127     | 情報技術サービス                |
| BOOKING HOLDINGS INC                     | 34.6     | 41.54    | 7,902     | 872,727     | インターネット販売・通信販売          |
| SCHLUMBERGER LTD                         | 984.76   | 1,211.22 | 5,346     | 590,448     | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB (CHARLES) CORP                    | 839.88   | 1,052.64 | 4,767     | 526,512     | 資本市場                    |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC               | 141.75   | 181.38   | 2,221     | 245,367     | ヘルスケア機器・用品              |
| BUNGE LTD                                | 103.34   | 103.34   | 546       | 60,385      | 食品                      |
| SEI INVESTMENTS CO                       | 93.15    | 122.94   | 628       | 69,394      | 資本市場                    |
| ANTHEM INC                               | 184.48   | 227.8    | 7,020     | 775,301     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERISOURCEBERGEN CORP                   | 122.57   | 147.24   | 1,272     | 140,577     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP                | 214.42   | 260.93   | 1,274     | 140,771     | 保険                      |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE                  | 59.58    | 73.97    | 3,193     | 352,731     | 化学                      |
| CENTENE CORP                             | 127.13   | 342.56   | 2,191     | 241,975     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SVB FINANCIAL GROUP                      | 34.68    | 48.52    | 1,166     | 128,814     | 銀行                      |
| IAC INTERACTIVE CORP                     | 50.5     | 69.38    | 1,529     | 168,870     | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SMITH (A.O.) CORP                        | 95.65    | 146.99   | 750       | 82,937      | 建設関連製品                  |
| ACUITY BRANDS INC                        | 30.87    | 30.87    | 400       | 44,283      | 電気設備                    |
| SNAP-ON INC                              | 39.32    | 49.35    | 769       | 84,979      | 機械                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC                 | 302.03   | 350.83   | 3,216     | 355,220     | 保険                      |
| ADVANCE AUTO PARTS                       | 52.73    | 63.3     | 1,068     | 117,963     | 専門小売り                   |
| EDISON INTERNATIONAL                     | 219.63   | 295.04   | 1,785     | 197,199     | 電力                      |
| SOUTHERN CO                              | 703.53   | 865.24   | 4,256     | 470,140     | 電力                      |
| BB&T CORP                                | 558.28   | 677.81   | 3,371     | 372,340     | 銀行                      |
| SOUTHWEST AIRLINES                       | 113.52   | 113.52   | 658       | 72,715      | 旅客航空輸送業                 |
| AT&T INC                                 | 4,324.05 | 6,330.05 | 18,857    | 2,082,591   | 各種電気通信サービス              |
| CHEVRON CORP                             | 1,334.69 | 1,647.12 | 19,462    | 2,149,424   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| STANLEY BLACK & DECKER INC               | 105.28   | 130.77   | 1,740     | 192,197     | 機械                      |
| STATE STREET CORP                        | 270.99   | 336.8    | 2,312     | 255,389     | 資本市場                    |
| STARBUCKS CORP                           | 1,014.69 | 1,179.2  | 8,353     | 922,555     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STEEL DYNAMICS INC                       | 153.09   | 190.3    | 699       | 77,257      | 金属・鉱業                   |
| STRYKER CORP                             | 241.4    | 296.38   | 5,499     | 607,313     | ヘルスケア機器・用品              |
| NETFLIX INC                              | 305.87   | 380.42   | 13,659    | 1,508,581   | 娯楽                      |
| STERICYCLE INC                           | 68.53    | —        | —         | —           | 商業サービス・用品               |
| SUNTRUST BANKS INC                       | 347.56   | 408.38   | 2,614     | 288,784     | 銀行                      |
| SYMANTEC CORP                            | 416.94   | 553.68   | 1,276     | 141,008     | ソフトウェア                  |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 97.93    | 97.93    | 333       | 36,783      | 陸運・鉄道                   |
| SYNOPSYS INC                             | 106.56   | 132.39   | 1,331     | 147,103     | ソフトウェア                  |
| SYSCO CORP                               | 359.26   | 430.43   | 2,864     | 316,404     | 食品・生活必需品小売り             |
| INTUITIVE SURGICAL INC                   | 77.88    | 99.01    | 5,307     | 586,185     | ヘルスケア機器・用品              |

| 銘柄                              | 期首(前期末)  | 当期       |          | 期末        |     | 業種等                     |
|---------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-----|-------------------------|
|                                 | 株数       | 株数       | 評価額      | 評価額       | 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        |     |                         |
| TELEFLEX INC                    | 32.03    | 39.05    | 1,099    | 121,410   |     | ヘルスケア機器・用品              |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES  | 638.53   | 805.53   | 1,391    | 153,727   |     | 医薬品                     |
| ANDEAVOR                        | 115      | —        | —        | —         |     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TEXAS INSTRUMENTS INC           | 696.26   | 846.28   | 9,052    | 999,775   |     | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXTRON INC                     | 190.76   | 221.99   | 1,198    | 132,389   |     | 航空宇宙・防衛                 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC    | 280.65   | 353.36   | 8,697    | 960,563   |     | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| TIFFANY & CO                    | 87.33    | 87.33    | 788      | 87,120    |     | 専門小売り                   |
| TOLL BROTHERS INC               | 95.26    | —        | —        | —         |     | 家庭用耐久財                  |
| TORCHMARK CORP                  | 76.99    | 106.61   | 872      | 96,346    |     | 保険                      |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC       | 112.79   | 143.84   | 1,324    | 146,307   |     | 情報技術サービス                |
| DAVITA INC                      | 108.78   | 108.78   | 631      | 69,787    |     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| TRACTOR SUPPLY CO               | 92.76    | 110.88   | 1,062    | 117,288   |     | 専門小売り                   |
| TRIMBLE INC                     | 200.73   | 200.73   | 779      | 86,036    |     | 電子装置・機器・部品              |
| TYSON FOODS INC                 | 216.21   | 246.07   | 1,505    | 166,262   |     | 食品                      |
| UGI CORP                        | 120.68   | 147.25   | 780      | 86,238    |     | ガス                      |
| MARATHON OIL CORP               | 587.47   | 718.46   | 1,214    | 134,175   |     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| UNION PACIFIC CORP              | 566.17   | 638.7    | 10,834   | 1,196,536 |     | 陸運・鉄道                   |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP        | 536.9    | 709.43   | 8,806    | 972,551   |     | 航空宇宙・防衛                 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC          | 683.78   | 839.99   | 22,287   | 2,461,426 |     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC   | 63.51    | 77.43    | 1,035    | 114,357   |     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC      | 68.48    | 84.38    | 1,111    | 122,795   |     | ヘルスケア機器・用品              |
| VF CORP                         | 243.09   | 300.57   | 2,584    | 285,376   |     | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| CBS CORP                        | 237.81   | 307.11   | 1,507    | 166,533   |     | メディア                    |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC      | 177.42   | 223.69   | 4,154    | 458,808   |     | バイオテクノロジー               |
| VULCAN MATERIALS CO             | 89.64    | 121.42   | 1,368    | 151,113   |     | 建設資材                    |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC    | 632.86   | 719.45   | 5,187    | 572,957   |     | 食品・生活必需品小売り             |
| WALMART INC                     | 1,061.26 | 1,270.54 | 12,517   | 1,382,417 |     | 食品・生活必需品小売り             |
| WASTE MANAGEMENT INC            | 322.16   | 369.86   | 3,655    | 403,735   |     | 商業サービス・用品               |
| WATERS CORP                     | 59.63    | 69.53    | 1,609    | 177,766   |     | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| ALLERGAN PLC                    | 233.13   | 296.2    | 4,107    | 453,621   |     | 医薬品                     |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW           | 76.71    | 104.59   | 1,062    | 117,288   |     | 食品                      |
| VAIL RESORTS INC                | 25.98    | 37.73    | 781      | 86,325    |     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESTERN DIGITAL CORP            | 205.16   | 260.76   | 1,251    | 138,174   |     | コンピュータ・周辺機器             |
| WABTEC CORP                     | 54.97    | 75.3     | 542      | 59,917    |     | 機械                      |
| WHIRLPOOL CORP                  | 55.53    | 55.53    | 763      | 84,368    |     | 家庭用耐久財                  |
| SKYWORX SOLUTIONS INC           | 135.29   | 162.96   | 1,362    | 150,529   |     | 半導体・半導体製造装置             |
| WYNN RESORTS LTD                | 62.79    | 92.4     | 1,140    | 125,956   |     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| NASDAQ INC                      | 91.32    | 91.32    | 795      | 87,904    |     | 資本市場                    |
| CME GROUP INC                   | 242.03   | 304.37   | 5,399    | 596,323   |     | 資本市場                    |
| WILLIAMS COS INC                | 610.81   | 1,061.74 | 2,851    | 314,956   |     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| LKQ CORP                        | 229.48   | 266.9    | 706      | 77,994    |     | 販売                      |
| ALLIANT ENERGY CORP             | 163.83   | 199.1    | 893      | 98,684    |     | 電力                      |
| WEC ENERGY GROUP INC            | 231.17   | 280.63   | 2,084    | 230,183   |     | 総合公益事業                  |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP      | 186.31   | 256.64   | 1,424    | 157,305   |     | 資本市場                    |
| CARMAX INC                      | 135.13   | 159.79   | 977      | 107,930   |     | 専門小売り                   |
| XEROX CORP                      | 174.55   | 174.55   | 520      | 57,504    |     | コンピュータ・周辺機器             |
| XILINX INC                      | 168.37   | 210.93   | 2,478    | 273,764   |     | 半導体・半導体製造装置             |
| CIMAREX ENERGY CO               | 70.03    | 92.53    | 692      | 76,509    |     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TJX COMPANIES INC               | 439.99   | 1,073.99 | 5,316    | 587,126   |     | 専門小売り                   |
| ZIONS BANCORP NA                | 165.84   | 165.84   | 811      | 89,617    |     | 銀行                      |
| DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS | —        | 274      | 243      | 26,931    |     | 食品・生活必需品小売り             |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD      | 764      | 764      | 545      | 60,244    |     | 不動産管理・開発                |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD   | 157      | 157      | 1,109    | 122,587   |     | コングロマリット                |
| JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD  | 171      | 171      | 667      | 73,746    |     | コングロマリット                |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC     | 60.51    | 81.92    | 680      | 75,119    |     | バイオテクノロジー               |
| SIGNATURE BANK                  | 41.71    | 41.71    | 554      | 61,251    |     | 銀行                      |
| CBRE GROUP INC                  | 209.76   | 294.99   | 1,459    | 161,199   |     | 不動産管理・開発                |



| 銘柄                                 | 期首(前期末)  |          | 当期末      |           | 業種等                     |
|------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
|                                    | 株数       | 株数       | 評価額      | 金額        |                         |
|                                    | 株        | 株        | 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        |                         |
| LIBERTY GLOBAL PLC                 | 124.35   | 198.35   | 494      | 54,589    | メディア                    |
| WELLCARE HEALTH PLANS INC          | -        | 43.5     | 1,190    | 131,484   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| REGIONS FINANCIAL CORP             | 844.86   | 929.92   | 1,442    | 159,288   | 銀行                      |
| DOMINO'S PIZZA INC                 | 32.56    | 32.56    | 935      | 103,267   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP             | -        | 30       | 233      | 25,776    | 化学                      |
| T-MOBILE US INC                    | 211.88   | 302.13   | 2,130    | 235,239   | 無線通信サービス                |
| LAS VEGAS SANDS CORP               | 283.87   | 333.32   | 1,978    | 218,552   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MOSAIC CO/THE                      | 265.25   | 314.33   | 1,003    | 110,878   | 化学                      |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS      | 273.32   | 390.26   | 1,936    | 213,906   | 娯楽                      |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC       | 753.4    | 917.84   | 4,589    | 506,831   | 娯楽                      |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP      | 54.73    | -        | -        | -         | 運送インフラ                  |
| CELANESE CORP                      | 94.91    | 118.8    | 1,182    | 130,599   | 化学                      |
| DEXCOM INC                         | -        | 76.65    | 1,133    | 125,141   | ヘルスケア機器・用品              |
| DISCOVERY INC-A                    | 104.23   | 104.23   | 299      | 33,117    | メディア                    |
| EXPEDIA GROUP INC                  | 87.09    | 103.73   | 1,314    | 145,215   | インターネット販売・通信販売          |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC         | 184.75   | 184.75   | 785      | 86,797    | 化学                      |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC           | 105.78   | 124.93   | 1,588    | 175,446   | 資本市場                    |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C        | 418.18   | 418.18   | 1,006    | 111,210   | メディア                    |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC      | 420.85   | 494.25   | 3,753    | 414,572   | 資本市場                    |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A           | 146.96   | 146.96   | 320      | 35,430    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VIACOM INC-CLASS B                 | 246.12   | 302.82   | 864      | 95,481    | 娯楽                      |
| LIVE NATION                        | 88.64    | 136.82   | 757      | 83,666    | 娯楽                      |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC         | 18.07    | 22.24    | 1,344    | 148,459   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC    | 61.91    | 61.91    | 545      | 60,271    | 旅客航空輸送業                 |
| TRANSDIGM GROUP INC                | 38.12    | 43.12    | 1,853    | 204,663   | 航空宇宙・防衛                 |
| MASTERCARD INC                     | 670.15   | 806.15   | 17,719   | 1,956,994 | 情報技術サービス                |
| QURATE RETAIL INC                  | 295.31   | 357.33   | 783      | 86,504    | インターネット販売・通信販売          |
| WYNDHAM DESTINATIONS INC           | 74.36    | -        | -        | -         | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HANESBRANDS INC                    | 276.19   | 276.19   | 516      | 57,070    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| WESTERN UNION CO                   | 352.22   | 352.22   | 625      | 69,046    | 情報技術サービス                |
| OWENS CORNING                      | 73.33    | 105.91   | 567      | 62,717    | 建設関連製品                  |
| LEIDOS HOLDINGS INC                | 93.22    | 131.82   | 821      | 90,741    | 情報技術サービス                |
| AERCAP HOLDINGS NV                 | 115.86   | 115.86   | 552      | 61,009    | 商社・流通業                  |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC    | 75.76    | 91.75    | 859      | 94,894    | 航空宇宙・防衛                 |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR  | 180.99   | 180.99   | 387      | 42,775    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS     | 83.3     | 105.19   | 1,046    | 115,544   | 情報技術サービス                |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC      | 227.46   | 296.53   | 502      | 55,509    | 銀行                      |
| DELTA AIR LINES INC                | 94.73    | 138.98   | 701      | 77,481    | 旅客航空輸送業                 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK       | 63.54    | 63.54    | 286      | 31,690    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DISCOVER FINANCIAL                 | 271.77   | 290.57   | 2,024    | 223,639   | 消費者金融                   |
| TE CONNECTIVITY LTD                | 243.11   | 296.1    | 2,394    | 264,422   | 電子装置・機器・部品              |
| CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX    | 105.52   | 178.07   | 2,125    | 234,753   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WABCO HOLDING INC                  | 31.76    | 40.76    | 474      | 52,433    | 機械                      |
| LULULEMON ATHLETICA INC            | 66.83    | 90.8     | 1,406    | 155,282   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VMWARE INC                         | 54.91    | 66.48    | 1,116    | 123,331   | ソフトウェア                  |
| MERCADOLIBRE INC                   | 28.61    | 37.5     | 1,349    | 149,027   | インターネット販売・通信販売          |
| ULTA BEAUTY INC                    | 43.32    | 50.2     | 1,531    | 169,094   | 専門小売り                   |
| INVESCO LTD                        | 298.24   | 421.25   | 769      | 84,997    | 資本市場                    |
| MSCI INC                           | 64.62    | 75.37    | 1,312    | 144,943   | 資本市場                    |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL        | 1,089.48 | 1,360.77 | 11,137   | 1,230,069 | タバコ                     |
| VISA INC                           | 1,300.02 | 1,551.28 | 22,208   | 2,452,665 | 情報技術サービス                |
| KEURIG DR PEPPER INC               | 125.72   | -        | -        | -         | 飲料                      |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC        | 119.92   | 159.33   | 1,549    | 171,125   | 水道                      |
| SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE       | 65.85    | -        | -        | -         | メディア                    |
| DISCOVERY INC-C                    | 160.85   | 294.84   | 801      | 88,536    | メディア                    |
| MARATHON PETROLEUM CORP            | 366.73   | 599.29   | 3,837    | 423,852   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 116.24   | 116.24   | 546      | 60,387    | 建設関連製品                  |

| 銘柄                                   | 期首(前期末)  | 当期       |          | 期末        |           | 業種等                     |
|--------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-----------|-------------------------|
|                                      | 株数       | 株数       | 評価額      | 評価額       | 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        |           |                         |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC         | 18.26    | —        | —        | —         | —         | 家庭用品                    |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE           | 1,339.61 | 1,769.14 | 3,340    | 368,884   | 368,884   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| XYLEM INC                            | 128.73   | 151.11   | 1,095    | 120,958   | 120,958   | 機械                      |
| ALKERMES PLC                         | 120.53   | 120.53   | 391      | 43,261    | 43,261    | バイオテクノロジー               |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV         | 230.62   | 289.87   | 2,502    | 276,338   | 276,338   | 化学                      |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC    | 34.79    | 34.79    | 746      | 82,407    | 82,407    | 航空宇宙・防衛                 |
| SPLUNK INC                           | 106.74   | 122.4    | 1,646    | 181,855   | 181,855   | ソフトウェア                  |
| HCA HEALTHCARE INC                   | 201.73   | 241.78   | 3,438    | 379,758   | 379,758   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VERISK ANALYTICS INC                 | 100.53   | 134.05   | 1,660    | 183,338   | 183,338   | 専門サービス                  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC             | 39.87    | 54.74    | 686      | 75,762    | 75,762    | 医薬品                     |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC            | 65.44    | 74.43    | 1,641    | 181,252   | 181,252   | 情報技術サービス                |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 106.68   | 136.76   | 1,361    | 150,342   | 150,342   | 銀行                      |
| CIT GROUP INC                        | 92.87    | 92.87    | 465      | 51,395    | 51,395    | 銀行                      |
| NXP SEMICONDUCTOR NV                 | 226.52   | 306      | 2,807    | 310,065   | 310,065   | 半導体・半導体製造装置             |
| TARGA RESOURCES CORP                 | 164.45   | 178.11   | 803      | 88,713    | 88,713    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST        | 4.056    | —        | —        | —         | —         | 運送インフラ                  |
| LEAR CORP                            | 51.32    | 61.72    | 960      | 106,076   | 106,076   | 自動車部品                   |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC              | 70.4     | 100.84   | 934      | 103,171   | 103,171   | 資本市場                    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC       | 106.33   | 170      | 957      | 105,777   | 105,777   | ソフトウェア                  |
| DOLLAR GENERAL CORP                  | 193.55   | 222.91   | 2,641    | 291,774   | 291,774   | 複合小売り                   |
| FORTINET INC                         | 113.99   | 113.99   | 948      | 104,728   | 104,728   | ソフトウェア                  |
| AON PLC                              | 184.87   | 209.42   | 3,552    | 392,302   | 392,302   | 保険                      |
| TESLA INC                            | 93.57    | 109.91   | 3,338    | 368,730   | 368,730   | 自動車                     |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV      | 113.92   | —        | —        | —         | —         | 電気設備                    |
| GENERAL MOTORS CO                    | 911.38   | 1,100.5  | 4,279    | 472,666   | 472,666   | 自動車                     |
| WORLDPAY INC                         | 104.48   | 265.92   | 2,319    | 256,120   | 256,120   | 情報技術サービス                |
| XPO LOGISTICS INC                    | —        | 128.25   | 763      | 84,346    | 84,346    | 航空貨物・物流サービス             |
| TRIPADVISOR INC                      | 92.63    | 92.63    | 535      | 59,088    | 59,088    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALLY FINANCIAL INC                   | 314.09   | 398.19   | 1,058    | 116,932   | 116,932   | 消費者金融                   |
| CAPRI HOLDINGS LTD                   | 99.58    | 121.38   | 544      | 60,175    | 60,175    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VOYA FINANCIAL INC                   | 135.25   | 135.25   | 656      | 72,549    | 72,549    | 各種金融サービス                |
| APTIV PLC                            | 190.69   | 225.71   | 1,797    | 198,546   | 198,546   | 自動車部品                   |
| PHILLIPS 66                          | 309.76   | 381.15   | 3,645    | 402,631   | 402,631   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FACEBOOK INC                         | 1,675.84 | 2,102.8  | 34,475   | 3,807,463 | 3,807,463 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| IQVIA HOLDINGS INC                   | 100.51   | 134.26   | 1,894    | 209,262   | 209,262   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| DIAMONDBACK ENERGY INC               | 70.54    | 131.09   | 1,361    | 150,320   | 150,320   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SERVICENOW INC                       | 122.06   | 150.71   | 3,527    | 389,529   | 389,529   | ソフトウェア                  |
| PALO ALTO NETWORKS INC               | 62.15    | 79.35    | 1,786    | 197,317   | 197,317   | ソフトウェア                  |
| TESARO INC                           | 26.46    | —        | —        | —         | —         | バイオテクノロジー               |
| WORKDAY INC                          | 91.87    | 123.76   | 2,333    | 257,697   | 257,697   | ソフトウェア                  |
| ABBVIE INC                           | 1,122.99 | 1,319.76 | 10,626   | 1,173,613 | 1,173,613 | バイオテクノロジー               |
| ZOETIS INC                           | 344.25   | 422.09   | 3,936    | 434,737   | 434,737   | 医薬品                     |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD   | 122.24   | 198.21   | 1,034    | 114,245   | 114,245   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| COTY INC                             | 314.4    | 385.41   | 427      | 47,161    | 47,161    | パーソナル用品                 |
| NEWS CORP/NEW-CL A                   | 302.63   | 302.63   | 378      | 41,778    | 41,778    | メディア                    |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC               | 128.91   | 128.91   | 560      | 61,887    | 61,887    | 商社・流通業                  |
| CDW CORP                             | 108.24   | 130.4    | 1,223    | 135,156   | 135,156   | 電子装置・機器・部品              |
| SPRINT CORP                          | 638.82   | 638.82   | 394      | 43,600    | 43,600    | 無線通信サービス                |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC          | 101.99   | 101.99   | 368      | 40,673    | 40,673    | 旅客航空輸送業                 |
| ARCONIC INC                          | 275.13   | 367.61   | 642      | 71,007    | 71,007    | 航空宇宙・防衛                 |
| ENVISION HEALTHCARE CORP             | 86.92    | —        | —        | —         | —         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C         | 131.75   | 178.52   | 555      | 61,335    | 61,335    | 娯楽                      |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A             | 50.06    | 50.06    | 201      | 22,308    | 22,308    | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C             | 133.68   | 179.31   | 723      | 79,924    | 79,924    | メディア                    |
| XL GROUP LTD                         | 171.66   | —        | —        | —         | —         | 保険                      |
| BROADCOM LTD                         | 287.37   | —        | —        | —         | —         | 半導体・半導体製造装置             |
| DELL TECHNOLOGIES INC                | 150.74   | —        | —        | —         | —         | ソフトウェア                  |

| 銘柄                               | 期首(前期末)  |          | 当期       |           | 業種等                     |
|----------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
|                                  | 株数       | 株数       | 評価額      |           |                         |
|                                  |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                         |
| (アメリカ)                           | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |                         |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C         | 154.1    | 154.1    | 304      | 33,663    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| BAKER HUGHES A GE CO             | 284.04   | 434.04   | 1,112    | 122,906   | エネルギー設備・サービス            |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC         | -        | 126.11   | 869      | 96,058    | 食品                      |
| TECHNIPFMC LTD                   | 325.56   | 387.24   | 884      | 97,722    | エネルギー設備・サービス            |
| BROADCOM INC                     | -        | 376.55   | 10,599   | 1,170,651 | 半導体・半導体製造装置             |
| BURLINGTON STORES INC            | -        | 60.07    | 974      | 107,652   | 専門小売り                   |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC        | 62.91    | 99.85    | 408      | 45,146    | 保険                      |
| ANTERO RESOURCES CORP            | 131.63   | 131.63   | 119      | 13,185    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| VEEVA SYSTEMS INC                | 69.8     | 108.52   | 1,308    | 144,538   | ヘルスケア・テクノロジ             |
| TWITTER INC                      | 436.92   | 562.56   | 1,741    | 192,351   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | -        | 171.81   | 826      | 91,306    | 電気設備                    |
| EVERGY INC                       | -        | 244.27   | 1,427    | 157,600   | 電力                      |
| PLAINS GP HOLDINGS LP            | 78.37    | 149.35   | 357      | 39,437    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC         | 129.2    | 129.2    | 286      | 31,662    | 通信機器                    |
| ALLEGION PLC                     | 54.02    | 73.25    | 671      | 74,166    | 建設関連製品                  |
| WIX.COM LTD                      | -        | 40       | 478      | 52,861    | 情報技術サービス                |
| PERRIGO CO PLC                   | 85.53    | 105.53   | 512      | 56,642    | 医薬品                     |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC    | 147.96   | 239.27   | 1,917    | 211,822   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARAMARK                          | 173.07   | 217.72   | 679      | 75,020    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CIGNA CORP                       | -        | 328.31   | 6,310    | 696,961   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DELL TECHNOLOGIES INC            | -        | 129.6    | 704      | 77,834    | コンピュータ・周辺機器             |
| GRUBHUB INC                      | -        | 81.58    | 672      | 74,302    | インターネット販売・通信販売          |
| SABRE CORP                       | 176.24   | 258.26   | 567      | 62,634    | 情報技術サービス                |
| PARSLEY ENERGY INC               | 174.54   | 174.54   | 322      | 35,564    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ARISTA NETWORKS INC              | 31.58    | 44.41    | 1,069    | 118,093   | 通信機器                    |
| IHS MARKIT LTD                   | 275.11   | 349.91   | 1,854    | 204,774   | 専門サービス                  |
| FNF GROUP                        | 177.6    | 253.11   | 899      | 99,290    | 保険                      |
| SYNCHRONY FINANCIAL              | 574.85   | 605.68   | 1,867    | 206,225   | 消費者金融                   |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC     | 348.45   | 403.2    | 1,447    | 159,860   | 銀行                      |
| CDK GLOBAL INC                   | 83.09    | 127.15   | 728      | 80,435    | ソフトウェア                  |
| WAYFAIR INC                      | -        | 50.91    | 611      | 67,514    | インターネット販売・通信販売          |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC        | -        | 155.15   | 1,225    | 135,398   | 電子装置・機器・部品              |
| QORVO INC                        | 87.84    | 108.87   | 704      | 77,756    | 半導体・半導体製造装置             |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC          | 113.89   | 160.89   | 409      | 45,239    | 各種電気通信サービス              |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I     | 78.18    | 100.18   | 878      | 97,052    | メディア                    |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD       | 147.1    | 231.55   | 612      | 67,690    | 化学                      |
| GODADDY INC                      | -        | 146.41   | 1,043    | 115,207   | 情報技術サービス                |
| NIELSEN HOLDINGS PLC             | 268.4    | 328.27   | 856      | 94,550    | 専門サービス                  |
| TRANSUNION                       | 103.41   | 172.08   | 1,095    | 120,944   | 専門サービス                  |
| SQUARE INC                       | 173.76   | 268.2    | 2,029    | 224,134   | 情報技術サービス                |
| DOWDUPONT INC                    | 1,652.19 | 1,993.38 | 10,497   | 1,159,304 | 化学                      |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC  | 140      | 171      | 800      | 88,364    | 飲料                      |
| WESTROCK CO                      | 177.44   | 223.94   | 859      | 94,921    | 容器・包装                   |
| KRAFT HEINZ CO                   | 438.18   | 546.03   | 2,584    | 285,477   | 食品                      |
| FORTIVE CORP                     | 216.82   | 267.79   | 2,154    | 237,928   | 機械                      |
| WASTE CONNECTIONS INC            | 188.79   | 234.91   | 1,902    | 210,142   | 商業サービス・用品               |
| ALPHABET INC-CL A                | 208.92   | 260.79   | 29,448   | 3,252,282 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO    | 1,132.42 | 1,256.08 | 2,008    | 221,815   | コンピュータ・周辺機器             |
| PAYPAL HOLDINGS INC              | 810.79   | 986.55   | 9,315    | 1,028,749 | 情報技術サービス                |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC       | -        | 232.2    | 435      | 48,057    | 各種金融サービス                |
| FIRST DATA CORP                  | 220.35   | 444.87   | 1,113    | 122,976   | 情報技術サービス                |
| DXC TECHNOLOGY CO                | 196.49   | 237.34   | 1,549    | 171,137   | 情報技術サービス                |
| ZILLOW GROUP INC-C               | 81.34    | 81.34    | 292      | 32,312    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALPHABET INC-CL C                | 222.97   | 273.82   | 30,713   | 3,392,006 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| BEIGENE LTD ADR                  | -        | 31.59    | 425      | 46,987    | バイオテクノロジー               |
| L3 TECHNOLOGIES INC              | 58.92    | 67.52    | 1,411    | 155,879   | 航空宇宙・防衛                 |
| CHEMOURS CO                      | 127.23   | 127.23   | 492      | 54,364    | 化学                      |

| 銘柄   | 期首(前期末)          |                     | 当期                  |                | 業種等                    |
|--|------------------|---------------------|---------------------|----------------|------------------------|
|  | 株数               | 株数                  | 評価額                 |                |                        |
|  |                  |                     | 外貨建金額               | 邦貨換算金額         |                        |
| (アメリカ)   | 百株               | 百株                  | 千アメリカ・ドル            | 千円             |                        |
| LINDE PLC  | —                | 481.71              | 8,020               | 885,780        | 化学                     |
| ATHENE HOLDING LTD                                       | 89.84            | 117.84              | 511                 | 56,442         | 保険                     |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC                               | 135.83           | 142.27              | 4,859               | 536,732        | メディア                   |
| VISTRA ENERGY CORP                                       | 158.25           | 300                 | 789                 | 87,170         | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者     |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 219,768.86<br>602銘柄 | 263,700.87<br>593銘柄 | 2,054,086<br>— | 226,853,320<br><64.9%> |
| (カナダ)  | 百株               | 百株                  | 千カナダ・ドル             | 千円             |                        |
| AGNICO EAGLE MINES LTD                                   | 161.41           | 202.81              | 1,129               | 93,732         | 金属・鉱業                  |
| ALIMENTATION COUCHE TARD INC                             | 307.28           | 397.22              | 2,921               | 242,459        | 食品・生活必需品小売り            |
| BARRICK GOLD CORP  | 836.48           | 1,507.26            | 2,584               | 214,525        | 金属・鉱業                  |
| ATCO LTD   | 71.93            | 71.93               | 299                 | 24,862         | 総合公益事業                 |
| BANK OF MONTREAL   | 454.51           | 550.83              | 5,362               | 445,019        | 銀行                     |
| BANK OF NOVA SCOTIA                                      | 844.84           | 1,049.73            | 7,801               | 647,454        | 銀行                     |
| NATIONAL BANK OF CANADA                                  | 237.56           | 285.53              | 1,764               | 146,418        | 銀行                     |
| BCE INC  | 115.68           | 115.68              | 661                 | 54,894         | 各種電気通信サービス             |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT                              | 575              | 740.72              | 4,224               | 350,576        | 資本市場                   |
| BAUSCH HEALTH COS INC                                    | 258.19           | 258.19              | 874                 | 72,573         | 医薬品                    |
| BOMBARDIER INC 'B'                                       | 1,516.15         | 1,516.15            | 380                 | 31,582         | 航空宇宙・防衛                |
| SAPUTO INC   | 141.01           | 186.01              | 768                 | 63,754         | 食品                     |
| BLACKBERRY LTD   | 396.52           | 396.52              | 448                 | 37,185         | ソフトウェア                 |
| CGI INC  | 152.28           | 227.36              | 1,997               | 165,760        | 情報技術サービス               |
| CCL INDUSTRIES INC                                       | 113.4            | 113.4               | 673                 | 55,854         | 容器・包装                  |
| CAE INC  | 230              | 230                 | 644                 | 53,521         | 航空宇宙・防衛                |
| CAMECO CORP  | 326.27           | 326.27              | 527                 | 43,756         | 石油・ガス・消耗燃料             |
| ROGERS COMM-CL B   | 259.67           | 308.22              | 2,240               | 185,960        | 無線通信サービス               |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE                              | 294.71           | 385.86              | 4,315               | 358,107        | 銀行                     |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES                               | 794.2            | 1,080.4             | 3,825               | 317,494        | 石油・ガス・消耗燃料             |
| CANADIAN TIRE CORP-CL A                                  | 48.62            | 48.62               | 680                 | 56,497         | 複合小売り                  |
| CANADIAN UTILITIES LTD                                   | 91.19            | 91.19               | 301                 | 25,004         | 総合公益事業                 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO                                 | 526.87           | 637.81              | 7,012               | 581,932        | 陸運・鉄道                  |
| FIRST CAPITAL REALTY INC                                 | 114.17           | 114.17              | 247                 | 20,579         | 不動産管理・開発               |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                                    | 139.3            | 201.76              | 925                 | 76,838         | 繊維・アパレル・贅沢品            |
| OPEN TEXT CORP   | 197.56           | 257.88              | 1,282               | 106,429        | ソフトウェア                 |
| EMPIRE CO LTD  | 150.93           | 150.93              | 469                 | 38,929         | 食品・生活必需品小売り            |
| KINROSS GOLD CORP  | 997.41           | 997.41              | 430                 | 35,758         | 金属・鉱業                  |
| FINNING INTERNATIONAL INC                                | 98.92            | 98.92               | 254                 | 21,147         | 商社・流通業                 |
| FORTIS INC   | 290.02           | 360                 | 1,692               | 140,419        | 電力                     |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD                               | 552.96           | 552.96              | 770                 | 63,924         | 金属・鉱業                  |
| TELUS CORP   | 159.45           | 159.45              | 746                 | 61,955         | 各種電気通信サービス             |
| GREAT WEST LIFECO INC                                    | 192.48           | 277.66              | 810                 | 67,285         | 保険                     |
| IMPERIAL OIL LTD   | 215.42           | 215.42              | 763                 | 63,358         | 石油・ガス・消耗燃料             |
| ENBRIDGE INC   | 1,126.14         | 1,771.76            | 8,389               | 696,226        | 石油・ガス・消耗燃料             |
| IGM FINANCIAL INC  | 84.26            | 84.26               | 286                 | 23,796         | 資本市場                   |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD                             | 879.95           | 879.95              | 190                 | 15,846         | 金属・鉱業                  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP                                  | 1,365.17         | 1,736.4             | 3,715               | 308,382        | 保険                     |
| LINAMAR CORP   | 38.27            | —                   | —                   | —              | 自動車部品                  |
| LOBLAW CO LTD  | 153.54           | 153.54              | 1,026               | 85,182         | 食品・生活必需品小売り            |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC | 65.24            | —                   | —                   | —              | 保険                     |
| MAGNA INTERNATIONAL INC                                  | 253.39           | 285.9               | 1,953               | 162,125        | 自動車部品                  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                                   | 408.42           | 524.57              | 2,458               | 204,044        | 保険                     |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD                              | 19.85            | 24.19               | 1,507               | 125,145        | 保険                     |
| METRO INC  | 123.89           | 192.26              | 935                 | 77,656         | 食品・生活必需品小売り            |
| HUSKY ENERGY INC   | 287.49           | 287.49              | 442                 | 36,742         | 石油・ガス・消耗燃料             |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP                               | 399.92           | —                   | —                   | —              | 石油・ガス・消耗燃料             |
| EMERA INC  | —                | 65.09               | 299                 | 24,891         | 電力                     |
| METHANEX CORP  | 73.81            | 52.81               | 396                 | 32,918         | 化学                     |
| ONEX CORP  | 66.46            | 66.46               | 514                 | 42,656         | 各種金融サービス               |

| 銘柄                                  | 期首(前期末)          |                   | 当 期 末             |              | 業 種 等                   |
|-------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------|-------------------------|
|                                     | 株 数              | 株 数               | 評 価 額             |              |                         |
|                                     |                  |                   | 外 貨 建 金 額         | 邦 貨 換 算 金 額  |                         |
| (カナダ)                               | 百株               | 百株                | 千カナダ・ドル           | 千円           |                         |
| GOLDCORP INC                        | 510.66           | 819.02            | 1,174             | 97,469       | 金属・鉱業                   |
| POWER CORP OF CANADA                | 250.52           | 379.42            | 1,015             | 84,293       | 保険                      |
| POWER FINANCIAL CORP                | 174.84           | 277.73            | 776               | 64,444       | 保険                      |
| ROYAL BANK OF CANADA                | 1,039.45         | 1,255.49          | 12,639            | 1,048,912    | 銀行                      |
| SNC-LAVALIN GROUP INC               | 131.34           | 131.34            | 441               | 36,612       | 建設・土木                   |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD        | 106.07           | 128.84            | 3,454             | 286,728      | 陸運・鉄道                   |
| SHAW COMM INC-B                     | 275.48           | 357.48            | 960               | 79,686       | メディア                    |
| SUNCOR ENERGY INC                   | 1,168.95         | 1,424.03          | 6,157             | 511,011      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| LUNDIN MINING CORP                  | 352.68           | 718.05            | 435               | 36,171       | 金属・鉱業                   |
| ENCANA CORP                         | 692.57           | 1,275.17          | 1,108             | 91,963       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TECK RESOURCES LTD-CL B             | 410.16           | 410.16            | 1,173             | 97,352       | 金属・鉱業                   |
| THOMSON REUTERS CORP                | 204.69           | 192.18            | 1,345             | 111,643      | 専門サービス                  |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$     | 1,311.89         | 1,574.19          | 11,745            | 974,720      | 銀行                      |
| TRANSCANADA CORP                    | 628.95           | 805.43            | 4,539             | 376,725      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD           | 56.96            | 56.96             | 410               | 34,087       | 紙製品・林産品                 |
| WESTON (GEORGE) LTD                 | 31.05            | 82.39             | 796               | 66,084       | 食品・生活必需品小売り             |
| INTACT FINANCIAL CORP               | 107.85           | 127.16            | 1,386             | 115,027      | 保険                      |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP        | 339.43           | 424.47            | 1,195             | 99,198       | 金属・鉱業                   |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC          | 14.94            | 17.29             | 1,958             | 162,526      | ソフトウェア                  |
| FRANCO-NEVADA CORP NPR              | 127.87           | 168.87            | 1,674             | 138,982      | 金属・鉱業                   |
| CI FINANCIAL CORP                   | 206.95           | 206.95            | 387               | 32,151       | 資本市場                    |
| TOURMALINE OIL CORP                 | 157.79           | 274.1             | 547               | 45,404       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| KEYERA CORP                         | 137.28           | 232.06            | 653               | 54,251       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ALTAGAS LTD                         | 125.38           | 239.44            | 366               | 30,382       | ガス                      |
| PEMBINA PIPELINE CORP               | 308.5            | 437.84            | 2,109             | 175,104      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DOLLARAMA INC                       | 75.04            | 282.95            | 997               | 82,750       | 複合小売り                   |
| STARS GROUP INC                     | -                | 185.29            | 394               | 32,753       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CENOVUS ENERGY INC W/I              | 805.45           | 805.45            | 894               | 74,264       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| VERMILION ENERGY INC                | 82.91            | 129.23            | 416               | 34,587       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ARC RESOURCES LTD                   | 229.97           | 229.97            | 228               | 18,951       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP       | 306.31           | -                 | -                 | -            | 各種金融サービス                |
| INTER PIPELINE LTD                  | 240.83           | 386.09            | 832               | 69,049       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| NUTRIEN LTD                         | 453.51           | 542.24            | 3,877             | 321,753      | 化学                      |
| WSP GLOBAL INC                      | -                | 84                | 578               | 48,031       | 建設・土木                   |
| IA FINANCIAL CORP INC               | -                | 129.97            | 633               | 52,550       | 保険                      |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD              | 149.61           | 149.61            | 277               | 23,044       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD        | 172.31           | 172.31            | 178               | 14,786       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 153.53           | 206.64            | 1,752             | 145,475      | ホテル・レストラン・レジャー          |
| AURORA CANNABIS INC                 | -                | 500               | 471               | 39,129       | 医薬品                     |
| SHOPIFY INC                         | 50.21            | 76.71             | 1,798             | 149,216      | 情報技術サービス                |
| CANOPY GROWTH CORP                  | -                | 186.34            | 1,141             | 94,765       | 医薬品                     |
| HYDRO ONE LTD                       | 133.54           | 273.4             | 569               | 47,262       | 電力                      |
| 小 計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 28,933.66<br>86銘柄 | 36,595.21<br>88銘柄 | 155,446<br>- | 12,900,481<br><3.7%>    |
| (オーストラリア)                           | 百株               | 百株                | 千オーストラリア・ドル       | 千円           |                         |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD              | 111.15           | 111.15            | 641               | 50,283       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LT        | 2,038.83         | 2,516.48          | 6,678             | 523,279      | 銀行                      |
| AMCOR LTD                           | 807.41           | 1,101.42          | 1,614             | 126,510      | 容器・包装                   |
| WESTPAC BANKING CORPORATION         | 2,399.94         | 2,932.6           | 7,680             | 601,765      | 銀行                      |
| BANK OF QUEENSLAND LTD              | 305.69           | 305.69            | 303               | 23,759       | 銀行                      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD          | 1,141.25         | 1,141.25          | 721               | 56,511       | 金属・鉱業                   |
| TELSTRA CORP LTD                    | 2,729.19         | 3,606.54          | 1,132             | 88,727       | 各種電気通信サービス              |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD       | 390.14           | 390.14            | 384               | 30,139       | 銀行                      |
| AMP LTD                             | 2,004.98         | 3,024.14          | 680               | 53,311       | 各種金融サービス                |
| ASX LTD                             | 102.9            | 155.73            | 1,075             | 84,263       | 資本市場                    |
| BHP GROUP LTD                       | 2,320.53         | 2,596.25          | 9,520             | 745,927      | 金属・鉱業                   |
| CALTEX AUSTRALIA LTD                | 209.46           | 209.46            | 582               | 45,606       | 石油・ガス・消耗燃料              |

| 銘柄                                   | 期首(前期末)   |           | 当期末         |           | 業種等                     |
|--------------------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------------------|
|                                      | 株数        | 株数        | 評価額         | 金額        |                         |
|                                      | 株数        | 株数        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                         |
| (オーストラリア)                            | 百株        | 百株        | 千オーストラリア・ドル | 千円        |                         |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD           | 221.82    | 221.82    | 78          | 6,117     | 複合小売り                   |
| COMPUTERSHARE LT                     | 380.4     | 380.4     | 710         | 55,644    | 情報技術サービス                |
| CSL LIMITED                          | 322.12    | 396.08    | 7,418       | 581,214   | バイオテクノロジー               |
| REA GROUP LTD                        | 41.19     | 41.19     | 313         | 24,526    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TRANSURBAN GROUP                     | 1,495.91  | 2,233.54  | 2,722       | 213,322   | 運送インフラ                  |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 | 486.01    | 486.01    | 418         | 32,823    | 飲料                      |
| COCHLEAR LTD                         | 39.92     | 53.74     | 1,058       | 82,947    | ヘルスケア機器・用品              |
| ORIGIN ENERGY LTD                    | 1,217.21  | 1,630.57  | 1,213       | 95,049    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA       | 1,212.08  | 1,535.19  | 10,836      | 849,071   | 銀行                      |
| BORAL LIMITED                        | 861.01    | 861.01    | 419         | 32,853    | 建設資材                    |
| RIO TINTO LIMITED                    | 268.22    | 325.62    | 2,992       | 234,458   | 金属・鉱業                   |
| APA GROUP                            | 732.53    | 1,161.93  | 1,074       | 84,209    | ガス                      |
| ARISTOCRAT LEISU                     | 373.93    | 531.68    | 1,329       | 104,184   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT         | 1,714.71  | 2,067.89  | 1,548       | 121,352   | 保険                      |
| TPG TELECOM LTD                      | 287.19    | 287.19    | 198         | 15,525    | 各種電気通信サービス              |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD       | 32.75     | 32.75     | 139         | 10,933    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC          | 284.89    | 460.91    | 795         | 62,293    | 建設資材                    |
| ORICA LTD                            | 253.08    | 253.08    | 457         | 35,830    | 化学                      |
| CIMIC GROUP LTD                      | 87.09     | 87.09     | 424         | 33,278    | 建設・土木                   |
| BLUESCOPE STEEL LTD                  | 369.41    | 369.41    | 449         | 35,195    | 金属・鉱業                   |
| SYDNEY AIRPORT                       | 851.3     | 851.3     | 590         | 46,289    | 運送インフラ                  |
| MACQUARIE GROUP LTD                  | 216.27    | 282.5     | 3,543       | 277,669   | 資本市場                    |
| WORLEYPARSONS LTD                    | -         | 358.28    | 549         | 43,061    | エネルギー設備・サービス            |
| SUNCORP GROUP LTD                    | 931.81    | 1,079.13  | 1,400       | 109,745   | 保険                      |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD          | 1,928.82  | 2,341.96  | 5,674       | 444,602   | 銀行                      |
| NEWCREST MINING LTD                  | 515.33    | 696.38    | 1,739       | 136,294   | 金属・鉱業                   |
| OIL SEARCH LTD                       | 937.15    | 1,388.06  | 1,113       | 87,221    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INCITEC PIVOT LTD                    | 1,364.26  | 1,364.26  | 454         | 35,594    | 化学                      |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED          | 953.9     | 1,294.36  | 1,453       | 113,886   | 保険                      |
| CHALLENGER FINANCIAL SERVICES        | 457.07    | 457.07    | 338         | 26,536    | 各種金融サービス                |
| SANTOS LTD                           | 1,338.62  | 1,338.62  | 891         | 69,850    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SONIC HEALTHCARE                     | 261.92    | 430.41    | 1,019       | 79,888    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD | -         | 50        | 145         | 11,380    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TABCORP HOLDINGS LTD                 | 1,263.48  | 1,942.74  | 880         | 68,952    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESFARMERS LTD                       | 810.21    | 968.21    | 3,222       | 252,459   | 複合小売り                   |
| ALUMINA LIMITED                      | 1,846.13  | 1,846.13  | 483         | 37,896    | 金属・鉱業                   |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD               | 602.49    | 791.15    | 2,810       | 220,238   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WOOLWORTHS GROUP LTD                 | 912.94    | 1,175.57  | 3,503       | 274,475   | 食品・生活必需品小売り             |
| SEEK LTD                             | 258.99    | 258.99    | 433         | 33,948    | 専門サービス                  |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD       | 45.81     | 45.81     | 212         | 16,643    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| AUSNET SERVICES                      | 1,650.66  | 1,650.66  | 287         | 22,503    | 電力                      |
| AGL ENERGY LTD                       | 463.15    | 606.49    | 1,322       | 103,637   | 総合公益事業                  |
| BRAMBLES LTD                         | 1,152.55  | 1,440.62  | 1,623       | 127,207   | 商業サービス・用品               |
| CROWN RESORTS LTD                    | 328.61    | 328.61    | 398         | 31,230    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| AURIZON HOLDINGS LTD                 | 1,391.84  | 1,909.69  | 866         | 67,929    | 陸運・鉄道                   |
| TREASURY WINE ESTATES LTD            | 507.89    | 691.79    | 1,169       | 91,600    | 飲料                      |
| HEALTHSCOPE LTD                      | 1,490.47  | -         | -           | -         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MEDIBANK PVT LTD                     | 1,771.76  | 2,734.24  | 754         | 59,126    | 保険                      |
| SOUTH32 LTD(AUD)                     | 3,670.57  | 4,431.6   | 1,684       | 131,942   | 金属・鉱業                   |
| COLES GROUP LTD                      | -         | 968.21    | 1,210       | 94,824    | 食品・生活必需品小売り             |
| 小計                                   | 株数        | 株数        | 金額          | 金額        |                         |
|                                      | 53,166.94 | 65,230.79 | 105,393     | 8,257,557 |                         |
|                                      | 銘柄数<比率>   | 銘柄数       | -           | <2.4%>    |                         |
| (香港)                                 | 百株        | 百株        | 千香港・ドル      | 千円        |                         |
| ASM PACIFIC TECH                     | 166       | 327       | 2,951       | 41,523    | 半導体・半導体製造装置             |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD             | 1,640     | 1,640     | 2,981       | 41,949    | 不動産管理・開発                |
| BANK OF EAST ASIA                    | 762.6     | 1,536.6   | 4,256       | 59,887    | 銀行                      |
| CLP HOLDINGS LTD                     | 1,195     | 1,495     | 14,082      | 198,146   | 電力                      |

| 銘柄  | 期首(前期末)   |           | 当期         |           | 業種等            |
|---|-----------|-----------|------------|-----------|----------------|
|   | 株数        | 株数        | 評価額        | 金額        |                |
|   |           |           | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |                |
| (香港)  | 百株        | 百株        | 千香港・ドル     | 千円        |                |
| PCCW LTD  | 3,310     | 3,310     | 1,565      | 22,028    | 各種電気通信サービス     |
| LI & FUNG LTD   | 5,324     | —         | —          | —         | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD                        | 490       | 490       | 3,126      | 43,985    | 電力             |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR                           | 790.4     | 1,024.4   | 26,409     | 371,575   | 資本市場           |
| MTR CORP  | 1,185     | 1,500     | 6,562      | 92,334    | 陸運・鉄道          |
| HANG LUNG GROUP LTD                                   | 630       | 630       | 1,505      | 21,185    | 不動産管理・開発       |
| HANG SENG BANK LTD                                    | 560       | 654       | 12,131     | 170,693   | 銀行             |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT                            | 838.44    | 1,322.28  | 5,996      | 84,371    | 不動産管理・開発       |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD                             | 965       | 1,230     | 6,562      | 92,328    | 電力             |
| (THE) WHARF HOLDINGS LTD                              | 957.5     | 957.5     | 2,379      | 33,477    | 不動産管理・開発       |
| HONG KONG & CHINA GAS                                 | 6,100.46  | 8,370.5   | 14,866     | 209,164   | ガス             |
| HYSAN DEVELOPMENT CO                                  | 500       | 500       | 2,127      | 29,933    | 不動産管理・開発       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD                        | 1,640     | 2,030     | 11,012     | 154,949   | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY PROPERTIES LTD                                  | 330       | 735       | 2,443      | 34,385    | 不動産管理・開発       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD                            | 2,620     | 3,240     | 10,076     | 141,774   | 銀行             |
| NWS HOLDINGS LTD                                      | —         | 1,350     | 2,632      | 37,039    | コングロマリット       |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS                          | 505       | 505       | 1,323      | 18,616    | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NEW WORLD DEVELOPMENT                                 | 4,412.66  | 6,052.66  | 7,626      | 107,302   | 不動産管理・開発       |
| SHANGRI-LA ASIA LTD                                   | —         | 1,040     | 1,102      | 15,510    | ホテル・レストラン・レジャー |
| SINO LAND CO  | 2,554     | 2,554     | 3,749      | 52,752    | 不動産管理・開発       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES                               | 1,030     | 1,350     | 18,076     | 254,336   | 不動産管理・開発       |
| SWIRE PACIFIC LTD A                                   | 300       | 475       | 4,400      | 61,920    | 不動産管理・開発       |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO                              | 1,135     | 1,135     | 5,504      | 77,451    | 家庭用耐久財         |
| WHELOCK & CO LTD                                      | 560       | 860       | 4,545      | 63,949    | 不動産管理・開発       |
| KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD                          | 2,580     | —         | —          | —         | 資本市場           |
| MINTH GROUP LTD                                       | 440       | 440       | 1,342      | 18,881    | 自動車部品          |
| SJM HOLDINGS LTD                                      | 1,560     | 1,560     | 1,304      | 18,349    | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN MACAU LTD  | 1,244     | 1,244     | 2,395      | 33,710    | ホテル・レストラン・レジャー |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD                                | 648       | 648       | 1,005      | 14,150    | ホテル・レストラン・レジャー |
| AIA GROUP LTD   | 8,496.27  | 10,630.27 | 79,514     | 1,118,767 | 保険             |
| HKT TRUST / HKT LTD                                   | 2,820     | 2,820     | 3,305      | 46,501    | 各種電気通信サービス     |
| SANDS CHINA LTD                                       | 1,692     | 2,328     | 8,706      | 122,503   | ホテル・レストラン・レジャー |
| SWIRE PROPERTIES LTD                                  | 1,042     | 1,042     | 3,282      | 46,181    | 不動産管理・開発       |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD                   | 957.5     | 957.5     | 5,318      | 74,837    | 不動産管理・開発       |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD | 2,300     | 2,300     | 1,851      | 26,050    | 電力             |
| WH GROUP LTD  | 5,305     | 7,015     | 5,113      | 71,953    | 食品             |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD                             | 1,993.32  | 2,428.32  | 19,669     | 276,748   | コングロマリット       |
| CK ASSET HOLDINGS LTD                                 | 1,843.32  | 2,228.32  | 14,584     | 205,201   | 不動産管理・開発       |
| 小計  | 株数        | 株数        | 金額         | 金額        |                |
|   | 73,422.47 | 81,955.35 | 327,392    | 4,606,412 |                |
|   | 40銘柄      | 40銘柄      | —          | <1.3%>    |                |
| (シンガポール)  | 百株        | 百株        | 千シンガポール・ドル | 千円        |                |
| SINGAPORE TECH ENG                                    | 1,250     | 1,250     | 472        | 38,433    | 航空宇宙・防衛        |
| SEMBCORP INDUSTRIES                                   | 814       | 814       | 212        | 17,281    | コングロマリット       |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD                          | 1,237     | 1,237     | 308        | 25,053    | メディア           |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD                             | 6,921.4   | 6,921.4   | 176        | 14,356    | 食品             |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD                                | 1,242     | 1,581     | 3,947      | 321,110   | 銀行             |
| CITY DEVELOPMENTS LTD                                 | 290       | 290       | 275        | 22,409    | 不動産管理・開発       |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD                          | 59.44     | 59.44     | 215        | 17,560    | 販売             |
| SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD               | 423       | 901       | 457        | 37,229    | 運送インフラ         |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD                                | 689       | 689       | 531        | 43,265    | 資本市場           |
| CAPITALAND LTD  | 1,924.15  | 1,924.15  | 654        | 53,213    | 不動産管理・開発       |
| GENTING SINGAPORE LTD                                 | 4,164     | 4,164     | 458        | 37,256    | ホテル・レストラン・レジャー |
| KEPPEL CORP LTD                                       | 984       | 1,684     | 1,028      | 83,692    | コングロマリット       |
| COMFORTDELGRO CORP LTD                                | 1,779     | 1,779     | 432        | 35,163    | 陸運・鉄道          |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP                          | 2,254.53  | 2,670.53  | 3,119      | 253,714   | 銀行             |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS                          | 5,919.22  | 7,343.22  | 2,224      | 180,981   | 各種電気通信サービス     |
| SINGAPORE AIRLINES LTD                                | 475       | 475       | 468        | 38,134    | 旅客航空輸送業        |

| 銘柄                                    | 期首(前期末)          |                   | 当期                |             | 業種等                     |
|---------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------|-------------------------|
|                                       | 株数               | 株数                | 評価額               |             |                         |
|                                       |                  |                   | 外貨建金額             | 邦貨換算金額      |                         |
| (シンガポール)                              | 百株               | 百株                | 千シンガポール・ドル        | 千円          |                         |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD              | 945              | 1,205             | 3,114             | 253,367     | 銀行                      |
| UOL GROUP LIMITED                     | 405              | 405               | 269               | 21,906      | 不動産管理・開発                |
| VENTURE CORP LTD                      | —                | 210               | 342               | 27,842      | 電子装置・機器・部品              |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD              | 920              | 1,423             | 469               | 38,196      | 食品                      |
| YANGZUJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 1,888            | 1,888             | 268               | 21,806      | 機械                      |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 34,583.74<br>20銘柄 | 38,913.74<br>21銘柄 | 19,448<br>— | 1,581,975<br><0.5%>     |
| (ニュージーランド)                            | 百株               | 百株                | 千ニュージーランド・ドル      | 千円          |                         |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD             | 979.92           | 1,145.5           | 859               | 64,726      | 運送インフラ                  |
| RYMAN HEALTHCARE LTD                  | —                | 298.94            | 330               | 24,915      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| A2 MILK CO LTD                        | —                | 550.91            | 727               | 54,750      | 食品                      |
| FISHER & PAYKEL                       | 372.49           | 426.78            | 584               | 44,021      | ヘルスケア機器・用品              |
| FLETCHER BUILDING LTD                 | 752.81           | 641.04            | 335               | 25,242      | 建設資材                    |
| SPARK NEW ZEALAND LTD                 | 1,596.23         | 1,596.23          | 651               | 49,033      | 各種電気通信サービス              |
| MERIDIAN ENERGY LTD                   | —                | 901.73            | 338               | 25,459      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,701.45<br>4銘柄   | 5,561.13<br>7銘柄   | 3,827<br>—  | 288,149<br><0.1%>       |
| (イギリス)                                | 百株               | 百株                | 千イギリス・ポンド         | 千円          |                         |
| ANTOFAGASTA PLC                       | 259.05           | 463.24            | 401               | 56,763      | 金属・鉱業                   |
| ASHTAD GROUP                          | 352.33           | 421.54            | 845               | 119,484     | 商社・流通業                  |
| SEVERN TRENT PLC                      | 148.97           | 255.3             | 501               | 70,831      | 水道                      |
| BHP GROUP PLC                         | 1,533.23         | 1,823.43          | 3,231             | 456,556     | 金属・鉱業                   |
| BARCLAYS PLC                          | 11,642.6         | 15,069.06         | 2,364             | 334,080     | 銀行                      |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC              | 646.82           | 1,037.64          | 585               | 82,722      | 家庭用耐久財                  |
| BT GROUP PLC                          | 5,766.86         | 7,604.43          | 1,741             | 246,061     | 各種電気通信サービス              |
| SKY PLC                               | 722.1            | —                 | —                 | —           | メディア                    |
| BUNZL PLC                             | 222.41           | 278.38            | 690               | 97,551      | 商社・流通業                  |
| EASYJET PLC                           | 136.28           | 136.28            | 172               | 24,397      | 旅客航空輸送業                 |
| CAPITA PLC                            | 548.94           | —                 | —                 | —           | 専門サービス                  |
| AVIVA PLC                             | 2,778.61         | 3,504.51          | 1,478             | 208,919     | 保険                      |
| CRODA INTERNATIONAL                   | 84.07            | 106.45            | 549               | 77,613      | 化学                      |
| DIAGEO PLC                            | 1,797.03         | 2,129.15          | 6,466             | 913,678     | 飲料                      |
| SCHRODERS PLC                         | 66.97            | 109.32            | 294               | 41,613      | 資本市場                    |
| DCC PLC                               | 59.36            | 97.53             | 657               | 92,883      | コンプロマリット                |
| NATIONAL GRID PLC                     | 2,298.84         | 2,937.75          | 2,495             | 352,672     | 総合公益事業                  |
| GKN PLC                               | 1,341.8          | —                 | —                 | —           | 自動車部品                   |
| KINGFISHER PLC                        | 1,656.8          | 1,656.8           | 385               | 54,453      | 専門小売り                   |
| BAE SYSTEMS PLC                       | 2,251.76         | 2,689.2           | 1,414             | 199,871     | 航空宇宙・防衛                 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC          | 1,629.3          | 2,009.84          | 5,674             | 801,846     | タバコ                     |
| COBHAM PLC                            | 1,427.39         | —                 | —                 | —           | 航空宇宙・防衛                 |
| NEXT PLC                              | 97.31            | 120.64            | 582               | 82,266      | 複合小売り                   |
| IMPERIAL BRANDS PLC                   | 657.39           | 843.12            | 2,220             | 313,736     | タバコ                     |
| IMI PLC                               | 212.18           | —                 | —                 | —           | 機械                      |
| JOHNSON MATTHEY PLC                   | 125.27           | 150.17            | 454               | 64,208      | 化学                      |
| ANGLO AMERICAN PLC                    | 935.73           | 967.27            | 1,861             | 262,963     | 金属・鉱業                   |
| COMPASS GROUP PLC                     | 1,151.11         | 1,394.09          | 2,448             | 345,905     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HSBC HOLDINGS PLC                     | 14,150.41        | 17,450.53         | 11,533            | 1,629,620   | 銀行                      |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC             | 4,236.49         | 5,084.63          | 1,343             | 189,888     | 保険                      |
| CENTRICA PLC                          | 3,927.66         | 4,713.4           | 657               | 92,840      | 総合公益事業                  |
| UNILEVER PLC                          | 893.05           | 1,003.06          | 4,263             | 602,433     | パーソナル用品                 |
| MEGGITT PLC                           | 621.81           | 621.81            | 343               | 48,587      | 航空宇宙・防衛                 |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS           | 1,556.82         | 2,305.51          | 546               | 77,174      | 食品・生活必需品小売り             |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC            | 347.14           | 544.87            | 446               | 63,101      | 水道                      |
| RSA INSURANCE GROUP PLC GRP           | 808.64           | 808.64            | 431               | 61,038      | 保険                      |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC          | 253.08           | 302.4             | 683               | 96,567      | 食品                      |
| PEARSON PLC                           | 650.09           | 650.09            | 604               | 85,372      | メディア                    |
| PERSIMMON PLC                         | 231.5            | 260.85            | 626               | 88,570      | 家庭用耐久財                  |



| 銘柄                              | 期首(前期末)   |           | 当期        |           | 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        |                         |
| PRUDENTIAL PLC                  | 1,829.73  | 2,219.79  | 3,367     | 475,816   | 保険                      |
| RIO TINTO PLC                   | 859.76    | 996.24    | 4,331     | 611,991   | 金属・鉱業                   |
| VODAFONE GROUP PLC              | 19,065.94 | 23,320.41 | 3,255     | 460,006   | 無線通信サービス                |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC     | 472.31    | 582.78    | 3,495     | 493,916   | 家庭用品                    |
| RELX PLC                        | 723.05    | 1,736.66  | 3,025     | 427,469   | 専門サービス                  |
| OLD MUTUAL PLC                  | 3,392.96  | —         | —         | —         | 保険                      |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC        | 1,169.66  | 1,389.93  | 1,318     | 186,341   | 航空宇宙・防衛                 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP    | 2,461.07  | 4,494.43  | 1,085     | 153,431   | 銀行                      |
| ST JAMES'S PLACE PLC            | 408.84    | 611.91    | 576       | 81,465    | 資本市場                    |
| TRAVIS PERKINS PLC              | 203.57    | —         | —         | —         | 商社・流通業                  |
| SSE PLC                         | 730.43    | 844.79    | 1,011     | 142,944   | 電力                      |
| BP PLC                          | 13,848.28 | 17,559.46 | 9,497     | 1,342,054 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SHIRE PLC                       | 654.57    | —         | —         | —         | バイオテクノロジー               |
| SAGE GROUP PLC(THE)             | 852.71    | 852.71    | 565       | 79,859    | ソフトウェア                  |
| SMITHS GROUP PLC                | 317.2     | 317.2     | 469       | 66,334    | コンゴロマリット                |
| STANDARD CHARTERED PLC          | 2,375.33  | 2,583.66  | 1,627     | 229,958   | 銀行                      |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 50,551.36 | 61,338.35 | 3,520     | 497,492   | 銀行                      |
| TAYLOR WIMPLEY PLC              | 2,530.22  | 2,530.22  | 415       | 58,669    | 家庭用耐久財                  |
| TESCO PLC                       | 5,629.88  | 8,771.57  | 1,911     | 270,070   | 食品・生活必需品小売り             |
| 3I GROUP PLC                    | 667.84    | 886.62    | 829       | 117,161   | 資本市場                    |
| SMITH & NEPHEW PLC              | 661.55    | 749.03    | 1,093     | 154,576   | ヘルスケア機器・用品              |
| GLAXOSMITHKLINE PLC             | 3,455.37  | 4,360.21  | 6,828     | 964,808   | 医薬品                     |
| WEIR GROUP                      | 183.36    | 183.36    | 280       | 39,666    | 機械                      |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC       | 218.88    | 262.66    | 1,216     | 171,874   | 資本市場                    |
| BABCOCK INT'L GROUP             | 213.02    | 213.02    | 117       | 16,645    | 商業サービス・用品               |
| WPP PLC                         | 906.28    | 1,074.94  | 902       | 127,465   | メディア                    |
| FERGUSON PLC                    | 182.38    | 210.79    | 1,140     | 161,134   | 商社・流通業                  |
| ASTRAZENECA PLC                 | 887.62    | 1,112.61  | 6,841     | 966,695   | 医薬品                     |
| WHITBREAD PLC                   | 121.59    | 156.39    | 769       | 108,677   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CARNIVAL PLC                    | 131.53    | 164.92    | 715       | 101,112   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC       | 1,202.9   | 1,202.9   | 347       | 49,036    | 複合小売り                   |
| JOHN WOOD GROUP PLC             | 489.88    | 489.88    | 250       | 35,440    | エネルギー設備・サービス            |
| INTERTEK GROUP PLC              | 112.73    | 143.35    | 751       | 106,138   | 専門サービス                  |
| BURBERRY GROUP PLC              | 298.93    | 387.27    | 757       | 107,034   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| INVESTEC PLC                    | 506.55    | 506.55    | 245       | 34,749    | 資本市場                    |
| INTERCONTINENTAL HOTELS         | 123.62    | 151.25    | 700       | 98,918    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ITV PLC                         | 2,472.1   | 3,709.08  | 499       | 70,595    | メディア                    |
| SAINSBURY (J) PLC               | 1,094.1   | 1,372.15  | 389       | 55,024    | 食品・生活必需品小売り             |
| RANDGOLD RESOURCES LTD NPR      | 69.98     | —         | —         | —         | 金属・鉱業                   |
| G4S PLC                         | 1,222.5   | 1,222.5   | 250       | 35,325    | 商業サービス・用品               |
| ADMIRAL GROUP PLC               | 158.93    | 158.93    | 341       | 48,214    | 保険                      |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS     | 107.26    | 107.26    | 406       | 57,455    | 家庭用耐久財                  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 3,194.45  | 4,047.66  | 9,823     | 1,388,084 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS     | 2,619.72  | 3,247.53  | 7,988     | 1,128,834 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TUI AG-DI                       | 301.53    | 450.43    | 364       | 51,502    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC      | 1,841.83  | 2,147.15  | 533       | 75,392    | 各種金融サービス                |
| EXPERIAN PLC                    | 622.14    | 803.95    | 1,641     | 231,967   | 専門サービス                  |
| MONDI PLC                       | 240.61    | 283.18    | 537       | 75,925    | 紙製品・林産品                 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 212.9     | 212.9     | 353       | 49,892    | 資本市場                    |
| FRESNILLO PLC NPR               | 156.39    | 156.39    | 152       | 21,541    | 金属・鉱業                   |
| INFORMA PLC                     | —         | 1,024.75  | 728       | 102,892   | メディア                    |
| GLENCORE PLC                    | 8,654.23  | 9,828.06  | 2,919     | 412,584   | 金属・鉱業                   |
| GVC HOLDINGS PLC                | —         | 496.18    | 318       | 44,975    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| NMC HEALTH PLC                  | —         | 81.49     | 224       | 31,711    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | 1,126.94  | 1,126.94  | 392       | 55,446    | 保険                      |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC    | 306.16    | —         | —         | —         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| COCA-COLA HBC AG                | 134.06    | 194.47    | 478       | 67,679    | 飲料                      |

| 銘柄                                       | 期首(前期末)          |                    | 当期                 |              | 業種等                  |
|--|------------------|--------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|  | 株数               | 株数                 | 評価額                |              |                      |
|  |                  |                    | 外貨建金額              | 邦貨換算金額       |                      |
| <b>(イギリス)</b>                            | 百株               | 百株                 | 千イギリス・ポンド          | 千円           |                      |
| CONVATEC GROUP PLC                       | 1,184            | 1,184              | 142                | 20,109       | ヘルスケア機器・用品           |
| ROYAL MAIL PLC                           | 550.6            | 550.6              | 151                | 21,387       | 航空貨物・物流サービス          |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC                | 500.37           | 500.37             | 177                | 25,134       | ホテル・レストラン・レジャー       |
| WORLDPAY INC                             | 107.75           | —                  | —                  | —            | 情報技術サービス             |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC            | 323.42           | 323.42             | 550                | 77,848       | ソフトウェア               |
| AUTO TRADER GROUP PLC                    | 763.48           | 763.48             | 349                | 49,408       | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| MELROSE INDUSTRIES PLC                   | —                | 4,176.2            | 672                | 95,005       | 電気設備                 |
| 小計                                       | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 214,633.55<br>99銘柄 | 260,125.86<br>92銘柄 | 152,648<br>— | 21,569,175<br><6.2%> |
| <b>(イスラエル)</b>                           | 百株               | 百株                 | 千イスラエル・シケル         | 千円           |                      |
| BANK HAPOALIM BM                         | 784.28           | 784.28             | 1,923              | 58,383       | 銀行                   |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL BM                  | 1,030.61         | 1,280.49           | 3,056              | 92,796       | 銀行                   |
| BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 1,882.3          | 1,882.3            | 597                | 18,126       | 各種電気通信サービス           |
| ELBIT SYSTEMS LTD                        | 17.6             | 17.6               | 828                | 25,151       | 航空宇宙・防衛              |
| FRUTAROM INDUSTRIES LTD                  | 26               | —                  | —                  | —            | 化学                   |
| ISRAEL CHEMICALS LTD                     | 494.11           | 494.11             | 997                | 30,272       | 化学                   |
| NICE LTD                                 | 40.35            | 60.65              | 2,580              | 78,348       | ソフトウェア               |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD                 | 104.44           | 104.44             | 702                | 21,339       | 銀行                   |
| AZRIELI GROUP                            | —                | 44.28              | 869                | 26,389       | 不動産管理・開発             |
| 小計                                       | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,379.69<br>8銘柄    | 4,668.15<br>8銘柄    | 11,554<br>—  | 350,808<br><0.1%>    |
| <b>(スイス)</b>                             | 百株               | 百株                 | 千スイス・フラン           | 千円           |                      |
| CREDIT SUISSE GROUP AG                   | 1,673.95         | 2,180.4            | 2,529              | 277,713      | 資本市場                 |
| NESTLE SA-REGISTERED                     | 2,197.06         | 2,679.67           | 23,597             | 2,590,969    | 食品                   |
| CIE FINANCIER RICHEMONT                  | 374.38           | 465.47             | 3,329              | 365,630      | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN             | 496.63           | 613.98             | 16,620             | 1,824,924    | 医薬品                  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT              | 28.35            | 36.07              | 801                | 88,001       | 機械                   |
| SIKA INHABER                             | 1.51             | 112.91             | 1,476              | 162,159      | 化学                   |
| SGS SA-REG                               | 4.05             | 4.84               | 1,194              | 131,157      | 専門サービス               |
| NOVARTIS AG-REG SHS                      | 1,575.58         | 1,875.05           | 16,706             | 1,834,395    | 医薬品                  |
| BALOISE HOLDING AG -R                    | 41.27            | 41.27              | 643                | 70,645       | 保険                   |
| BARRY CALLEBAUT AG                       | 1.44             | 1.44               | 246                | 27,084       | 食品                   |
| CLARIANT AG-REG                          | 128.88           | 194.96             | 396                | 43,583       | 化学                   |
| SWISSCOM AG-REG                          | 17.95            | 22.8               | 1,020              | 112,003      | 各種電気通信サービス           |
| ABB LTD                                  | 1,262.78         | 1,623.58           | 3,157              | 346,644      | 電気設備                 |
| ADECCO GROUP AG-REG                      | 123.41           | 123.41             | 641                | 70,462       | 専門サービス               |
| GEBERIT AG                               | 28.01            | 32.43              | 1,270              | 139,512      | 建設関連製品               |
| LONZA GROUP AG-REG                       | 53.89            | 62.28              | 1,779              | 195,439      | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| LINDT & SPRUENGLI PART                   | 0.75             | 1.05               | 663                | 72,805       | 食品                   |
| LINDT & SPRUENGLI NAMEN                  | 0.09             | 0.09               | 651                | 71,545       | 食品                   |
| GIVAUDAN-REG                             | 6.92             | 7.71               | 1,896              | 208,253      | 化学                   |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG                | 108.43           | 130.46             | 4,146              | 455,232      | 保険                   |
| LAFARGEHOLCIM LTD                        | 326.76           | 406.15             | 1,925              | 211,470      | 建設資材                 |
| TEMENOS GROUP                            | —                | 45.21              | 646                | 71,035       | ソフトウェア               |
| SONOVA HOLDING AG                        | 31.68            | 53.19              | 1,005              | 110,439      | ヘルスケア機器・用品           |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG                   | 36.87            | 51.05              | 702                | 77,128       | 海運業                  |
| STRAUMANN HOLDING AG                     | 6                | 7.82               | 578                | 63,539       | ヘルスケア機器・用品           |
| THE SWATCH GROUP AG-B                    | 19.55            | 26.91              | 765                | 84,061       | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| THE SWATCH GROUP AG-REG                  | 45.92            | 45.92              | 252                | 27,756       | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| SCHINDLER NAMEN                          | 16.63            | 16.63              | 362                | 39,806       | 機械                   |
| SWISS LIFE HOLDING AG                    | 22.25            | 31.19              | 1,280              | 140,582      | 保険                   |
| VIFOR PHARMA AG                          | 30.5             | 45.83              | 587                | 64,511       | 医薬品                  |
| EMS-CHEMIE HOLDING                       | 5.53             | 9.04               | 495                | 54,394       | 化学                   |
| SWISS PRIME SITE AG                      | 59.9             | 59.9               | 503                | 55,279       | 不動産管理・開発             |
| PARGESA HOLDING PORTEUR                  | —                | 30                 | 235                | 25,907       | 各種金融サービス             |
| DUFREY GROUP                             | 23.9             | 23.9               | 235                | 25,822       | 専門小売り                |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG                | 12.72            | 15.05              | 1,043              | 114,600      | 資本市場                 |

| 銘柄                           | 期首(前期末)          |           | 当期           |         | 業種等         |  |
|------------------------------|------------------|-----------|--------------|---------|-------------|--|
|                              | 株数               | 株数        | 評価額          | 期末      |             |  |
|                              |                  |           | 外貨建金額        | 邦貨換算金額  |             |  |
| (スイス)                        | 百株               | 百株        | 千スイス・フラン     | 千円      |             |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 152.27           | 178.49    | 706          | 77,530  | 資本市場        |  |
| SWISS RE LTD                 | 206.38           | 276.09    | 2,651        | 291,142 | 保険          |  |
| UBS GROUP AG                 | 2,606.39         | 3,364.64  | 4,288        | 470,848 | 資本市場        |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 11,728.58 | 14,896.88    | 101,038 | 11,094,022  |  |
|                              |                  | 36銘柄      | 38銘柄         | -       | <3.2%>      |  |
| (デンマーク)                      | 百株               | 百株        | 千デンマーク・クローネ  | 千円      |             |  |
| CARLSBERG AS-B               | 73.3             | 96.44     | 7,665        | 128,083 | 飲料          |  |
| A P MOLLER A/S               | 4.81             | 6.04      | 5,407        | 90,351  | 海運業         |  |
| AP MOLLER MAERSK A           | 2.73             | 2.73      | 2,293        | 38,319  | 海運業         |  |
| DANSKE BANK A/S              | 501.88           | 611.14    | 7,486        | 125,098 | 銀行          |  |
| GENMAB A/S                   | 38.99            | 56.22     | 5,655        | 94,507  | バイオテクノロジー   |  |
| NOVOZYMES-B SHS              | 159.04           | 191.11    | 5,620        | 93,919  | 化学          |  |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 1,317.28         | 1,596.6   | 52,448       | 876,411 | 医薬品         |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 158.08           | 158.08    | 8,820        | 147,396 | 電気設備        |  |
| TDC A/S                      | 689.39           | -         | -            | -       | 各種電気通信サービス  |  |
| COLOPLAST-B                  | 82.86            | 112.12    | 7,043        | 117,694 | ヘルスケア機器・用品  |  |
| DSV A/S                      | 130.4            | 171.23    | 8,965        | 149,815 | 陸運・鉄道       |  |
| WILLIAM DEMANT               | 65.37            | 65.37     | 1,447        | 24,184  | ヘルスケア機器・用品  |  |
| H LUNDBECK A/S               | 48.4             | 48.4      | 1,369        | 22,888  | 医薬品         |  |
| TRYG A/S                     | 111.07           | 111.07    | 1,913        | 31,978  | 保険          |  |
| PANDORA A/S                  | 82.51            | 82.51     | 2,777        | 46,408  | 繊維・アパレル・贅沢品 |  |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 77.08            | 77.08     | 5,042        | 84,261  | 化学          |  |
| ISS A/S                      | 111.25           | 162.4     | 3,087        | 51,587  | 商業サービス・用品   |  |
| ORSTED A/S                   | 116              | 172.49    | 8,253        | 137,918 | 電力          |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,770.44  | 3,721.03     | 135,297 | 2,260,823   |  |
|                              |                  | 18銘柄      | 17銘柄         | -       | <0.6%>      |  |
| (ノルウェー)                      | 百株               | 百株        | 千ノルウェー・クローネ  | 千円      |             |  |
| MOWI ASA                     | 248.16           | 330       | 6,482        | 82,721  | 食品          |  |
| DNB ASA                      | 704.26           | 797.83    | 12,833       | 163,750 | 銀行          |  |
| NORSK HYDRO ASA              | 918.79           | 1,371.9   | 4,683        | 59,763  | 金属・鉱業       |  |
| TELENOR ASA                  | 531.78           | 620.76    | 10,040       | 128,120 | 各種電気通信サービス  |  |
| ORKLA ASA                    | 614.21           | 848.09    | 5,665        | 72,288  | 食品          |  |
| EQUINOR ASA                  | 814.14           | 983.97    | 19,261       | 245,773 | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 112.79           | 160       | 5,432        | 69,312  | 化学          |  |
| AKER BP ASA                  | -                | 85.52     | 2,473        | 31,558  | 石油・ガス・消耗燃料  |  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 166.83           | 166.83    | 2,507        | 31,995  | 保険          |  |
| SCHIBSTED ASA                | -                | 74.45     | 2,162        | 27,596  | メディア        |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,110.96  | 5,439.35     | 71,542  | 912,880     |  |
|                              |                  | 8銘柄       | 10銘柄         | -       | <0.3%>      |  |
| (スウェーデン)                     | 百株               | 百株        | 千スウェーデン・クローナ | 千円      |             |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 483.77           | 571.91    | 13,960       | 165,848 | 機械          |  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 257.93           | 383.14    | 8,752        | 103,983 | 機械          |  |
| ERICSSON LM-B SHS            | 2,217.48         | 2,717.83  | 23,465       | 278,773 | 通信機器        |  |
| GETINGE AB-B SHS             | 131.53           | -         | -            | -       | ヘルスケア機器・用品  |  |
| LUNDBERGS B                  | 36.91            | 73.82     | 2,087        | 24,801  | 各種金融サービス    |  |
| SKF AB-B SHS                 | 248.66           | 371.98    | 5,706        | 67,789  | 機械          |  |
| SANDVIK AB                   | 767.81           | 967.46    | 14,221       | 168,953 | 機械          |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 959.18           | 1,475.88  | 14,071       | 167,163 | 銀行          |  |
| SKANSKA AB-B SHS             | 211.79           | 325.47    | 5,301        | 62,986  | 建設・土木       |  |
| SWEDBANK AB                  | 665.07           | 824.1     | 16,918       | 200,995 | 銀行          |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 1,083.88         | 1,265.39  | 12,812       | 152,207 | 銀行          |  |
| VOLVO AB-B SHS               | 1,136.72         | 1,416.08  | 18,819       | 223,578 | 機械          |  |
| SWEDISH MATCH AB             | 114.81           | 164.88    | 7,444        | 88,438  | タバコ         |  |
| TELE2 AB-B SHS               | 269.76           | 448.76    | 5,387        | 64,001  | 無線通信サービス    |  |
| NORDEA AB                    | 2,186.2          | -         | -            | -       | 銀行          |  |
| INDUSTRIVARDEN C             | 114.03           | 114.03    | 2,100        | 24,953  | 各種金融サービス    |  |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 191.91           | 191.91    | 4,504        | 53,509  | 家庭用耐久財      |  |

| 銘柄                                 | 期首(前期末)         |                 | 当期      |           | 業種等               |
|------------------------------------|-----------------|-----------------|---------|-----------|-------------------|
|                                    | 株数              | 株数              | 評価額     | 期末        |                   |
|                                    |                 |                 | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                   |
| (スウェーデン)                           | 百株              | 百株              | 千ユーロ    | 千円        |                   |
| SECURITAS AB-B SHS                 | 240.98          | 240.98          | 3,432   | 40,781    | 商業サービス・用品         |
| INVESTOR AB-B SHS                  | 334.12          | 376.57          | 15,364  | 182,524   | 各種金融サービス          |
| HENNES&MAURITZ AB-B SHS            | 664.48          | 777.79          | 10,766  | 127,902   | 専門小売り             |
| ASSA ABLOY AB-B                    | 686.13          | 883.27          | 16,442  | 195,331   | 建設関連製品            |
| TELIA CO AB                        | 1,849.27        | 2,318.55        | 9,144   | 108,635   | 各種電気通信サービス        |
| LLUNDIR PETROLEUM AB               | 167.9           | 167.9           | 4,993   | 59,320    | 石油・ガス・消耗燃料        |
| BOLIDEN AB                         | 218.55          | 218.55          | 5,093   | 60,508    | 金属・鉱業             |
| ALFA LAVAL AB                      | 174.11          | 233.43          | 4,649   | 55,241    | 機械                |
| KINNEVIK AB-B                      | 183.1           | 183.1           | 3,918   | 46,549    | 各種金融サービス          |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA | 53.32           | 53.32           | 2,975   | 35,346    | 無線通信サービス          |
| ICA GRUPPEN AB                     | 59.2            | 59.2            | 2,074   | 24,650    | 食品・生活必需品小売り       |
| HUSQVARNA AB-B SHS                 | 336.92          | 336.92          | 2,495   | 29,643    | 家庭用耐久財            |
| HEXAGON AB                         | 183.6           | 220.37          | 10,181  | 120,951   | 電子装置・機器・部品        |
| EPIROC AB-A                        | -               | 633.58          | 5,726   | 68,028    | 機械                |
| EPIROC AB-B                        | -               | 308.99          | 2,620   | 31,132    | 機械                |
| ESSITY AB-B                        | 397.97          | 525.22          | 13,435  | 159,609   | 家庭用品              |
| NORDEA BANK ABP                    | -               | 2,678.38        | 22,404  | 266,167   | 銀行                |
| 小計                                 | 株数・金<br>銘柄数<比率> | 株数・金<br>銘柄数<比率> | 291,271 | 3,460,306 |                   |
|                                    | 31銘柄            | 32銘柄            | -       | <1.0%>    |                   |
| (ユーロ…アイルランド)                       | 百株              | 百株              | 千ユーロ    | 千円        |                   |
| CRH PLC                            | 589.56          | 713.94          | 1,909   | 238,112   | 建設資材              |
| PADDY POWER BETFAIR PLC            | 62.46           | 62.46           | 441     | 55,057    | ホテル・レストラン・レジャー    |
| KERRY GROUP PLC-A                  | 115.76          | 138.65          | 1,270   | 158,434   | 食品                |
| KINGSPAN GROUP PLC                 | -               | 147.56          | 561     | 69,985    | 建設関連製品            |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC            | -               | 173.97          | 469     | 58,564    | 容器・包装             |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC          | 732.87          | 1,063.63        | 566     | 70,616    | 銀行                |
| AIB GROUP PLC                      | 523.22          | 523.22          | 202     | 25,245    | 銀行                |
| 小計                                 | 株数・金<br>銘柄数<比率> | 株数・金<br>銘柄数<比率> | 5,422   | 676,016   |                   |
|                                    | 5銘柄             | 7銘柄             | -       | <0.2%>    |                   |
| (ユーロ…オランダ)                         | 百株              | 百株              | 千ユーロ    | 千円        |                   |
| AIRBUS SE                          | 412.7           | 515.53          | 5,525   | 688,913   | 航空宇宙・防衛           |
| BOSKALIS WESTMINSTER CT            | 75.63           | -               | -       | -         | 建設・土木             |
| RELX NV                            | 708.26          | -               | -       | -         | 専門サービス            |
| KONINKLIJKE DSM NV                 | 132.16          | 151.11          | 1,390   | 173,331   | 化学                |
| ING GROEP NV-CVA                   | 2,728.8         | 3,412.95        | 3,659   | 456,249   | 銀行                |
| RANDSTAD NV                        | 77.94           | 120.61          | 550     | 68,692    | 専門サービス            |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV      | 914.26          | 1,096.41        | 2,505   | 312,360   | 食品・生活必需品小売り       |
| HEINEKEN NV                        | 173.73          | 230.51          | 2,010   | 250,670   | 飲料                |
| AKZO NOBEL                         | 182.09          | 187.86          | 1,473   | 183,748   | 化学                |
| ASML HOLDING NV                    | 274.21          | 360.62          | 5,860   | 730,724   | 半導体・半導体製造装置       |
| AEGON NV                           | 1,204.04        | 1,503.49        | 659     | 82,180    | 保険                |
| UNILEVER NV-CVA                    | 1,155.3         | 1,348.83        | 6,572   | 819,502   | パーソナル用品           |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV             | 675.29          | 832.6           | 2,889   | 360,215   | ヘルスケア機器・用品        |
| WOLTERS KLUWER-CVA                 | 205.58          | 250.51          | 1,394   | 173,908   | 専門サービス            |
| STMICROELECTRONICS NV              | 458.66          | 556.11          | 811     | 101,160   | 半導体・半導体製造装置       |
| QIAGEN N.V.                        | 136.42          | 173.87          | 589     | 73,532    | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| VOPAK (KON.)                       | 53.64           | 53.64           | 234     | 29,185    | 石油・ガス・消耗燃料        |
| KONINKLIJKE KPN NV                 | 2,289.67        | 2,910.29        | 791     | 98,696    | 各種電気通信サービス        |
| HEINEKEN HOLDING NV-A              | 80.14           | 97.91           | 819     | 102,115   | 飲料                |
| FERRARI NV                         | 83.38           | 108.95          | 1,202   | 149,898   | 自動車               |
| CNH INDUSTRIAL NV                  | 786.45          | 943.17          | 879     | 109,645   | 機械                |
| NN GROUP NV                        | 219.65          | 285.28          | 1,062   | 132,493   | 保険                |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV       | 767.19          | 899.77          | 1,162   | 144,940   | 自動車               |
| ABN AMRO GROUP NV                  | 291.29          | 342.51          | 685     | 85,408    | 銀行                |
| EXOR NV                            | 77.26           | 77.26           | 425     | 53,038    | 各種金融サービス          |
| ALTICE EUROPE NV                   | 434.03          | -               | -       | -         | メディア              |
| 小計                                 | 株数・金<br>銘柄数<比率> | 株数・金<br>銘柄数<比率> | 43,155  | 5,380,611 |                   |
|                                    | 26銘柄            | 23銘柄            | -       | <1.5%>    |                   |

| 銘柄                                  | 期首(前期末)          |                  | 当期               |             | 業種等                 |  |
|-------------------------------------|------------------|------------------|------------------|-------------|---------------------|--|
|                                     | 株数               | 株数               | 評価額              |             |                     |  |
|                                     |                  |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額      |                     |  |
| (ユーロ…ベルギー)                          | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円          |                     |  |
| UMICORE                             | 153.2            | 191.09           | 671              | 83,745      | 化学                  |  |
| KBC GROUPE                          | 183.78           | 208.03           | 1,239            | 154,481     | 銀行                  |  |
| SOLVAY SA                           | 50.36            | 70.86            | 683              | 85,273      | 化学                  |  |
| AGEAS                               | 129.93           | 179.04           | 733              | 91,500      | 保険                  |  |
| UCB SA                              | 87.47            | 112.67           | 893              | 111,454     | 医薬品                 |  |
| COLRUYT NV                          | 46.73            | 46.73            | 291              | 36,332      | 食品・生活必需品小売り         |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA         | 58.14            | 84.48            | 693              | 86,412      | 各種金融サービス            |  |
| PROXIMUS                            | 89.22            | 142.83           | 318              | 39,711      | 各種電気通信サービス          |  |
| TELENET GROUP HOLDING NV            | 36.34            | 36.34            | 136              | 17,008      | メディア                |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV          | 536.8            | 658.58           | 4,405            | 549,245     | 飲料                  |  |
| 小計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,371.97<br>10銘柄 | 1,730.65<br>10銘柄 | 10,067<br>- | 1,255,167<br><0.4%> |  |
| (ユーロ…ルクセンブルグ)                       | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円          |                     |  |
| ARCELOR MITTAL (NL)                 | 472.45           | 581.89           | 1,134            | 141,400     | 金属・鉱業               |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC                 | 7.94             | 7.94             | 268              | 33,520      | ライフサイエンス・ツール/サービス   |  |
| TENARIS SA                          | 303.72           | 369.59           | 426              | 53,130      | エネルギー設備・サービス        |  |
| SES FDR                             | 245.85           | 342.68           | 622              | 77,589      | メディア                |  |
| RTL GROUP SA                        | 34.46            | 34.46            | 160              | 19,978      | メディア                |  |
| AROUNDTOWN SA                       | -                | 717.83           | 545              | 68,064      | 不動産管理・開発            |  |
| 小計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,064.42<br>5銘柄  | 2,054.39<br>6銘柄  | 3,157<br>-  | 393,682<br><0.1%>   |  |
| (ユーロ…フランス)                          | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円          |                     |  |
| AIR LIQUIDE                         | 298.45           | 370.92           | 3,931            | 490,210     | 化学                  |  |
| AXA                                 | 1,395.5          | 1,652.52         | 3,366            | 419,695     | 保険                  |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 346.22           | 496.32           | 935              | 116,646     | 総合公益事業              |  |
| DASSAULT AVIATION SA                | 1.57             | 2.74             | 361              | 45,094      | 航空宇宙・防衛             |  |
| DANONE                              | 436.86           | 540.23           | 3,525            | 439,564     | 食品                  |  |
| SAFRAN SA                           | 220.5            | 292.68           | 3,342            | 416,731     | 航空宇宙・防衛             |  |
| ACCOR SA                            | 105.52           | 160              | 628              | 78,338      | ホテル・レストラン・レジャー      |  |
| BOUYGUES                            | 139.96           | 222.76           | 670              | 83,571      | 建設・土木               |  |
| BNP PARIBAS                         | 788.14           | 969.88           | 3,919            | 488,716     | 銀行                  |  |
| THALES SA                           | 81.28            | 98.83            | 1,029            | 128,396     | 航空宇宙・防衛             |  |
| CAPGEMINI SA                        | 114.81           | 137.59           | 1,408            | 175,578     | 情報技術サービス            |  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON           | 42.64            | 42.64            | 185              | 23,088      | 食品・生活必需品小売り         |  |
| INGENICO GROUP                      | 43.34            | 43.34            | 231              | 28,909      | 電子装置・機器・部品          |  |
| NATIXIS                             | 701.66           | 701.66           | 299              | 37,363      | 資本市場                |  |
| EIFFAGE                             | 47.77            | 59.49            | 487              | 60,821      | 建設・土木               |  |
| PUBLICIS GROUPE                     | 150.68           | 182.22           | 871              | 108,620     | メディア                |  |
| FAURECIA                            | 38.31            | 61.17            | 230              | 28,729      | 自動車部品               |  |
| IMERYS SA                           | 22.56            | 22.56            | 108              | 13,495      | 建設資材                |  |
| L'OREAL                             | 180.67           | 215.81           | 4,758            | 593,303     | パーソナル用品             |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 197.42           | 244.37           | 7,107            | 886,163     | 繊維・アパレル・贅沢品         |  |
| LAGARDERE S.C.A.                    | 96               | -                | -                | -           | メディア                |  |
| BOLLORE                             | 713.47           | 713.47           | 247              | 30,885      | 航空貨物・物流サービス         |  |
| MICHELIN(CGDE)-B                    | 121.18           | 150.18           | 1,515            | 188,929     | 自動車部品               |  |
| PERNOD-RICARD                       | 154.01           | 184.79           | 2,753            | 343,290     | 飲料                  |  |
| PEUGEOT SA                          | 422.32           | 500.87           | 1,048            | 130,704     | 自動車                 |  |
| RENAULT SA                          | 124.42           | 177.86           | 1,023            | 127,664     | 自動車                 |  |
| REMY COINTREAU                      | 18.6             | 18.6             | 208              | 25,950      | 飲料                  |  |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN           | 357.06           | 443.31           | 1,400            | 174,631     | 建設関連製品              |  |
| SEB SA                              | 14.05            | 14.05            | 191              | 23,823      | 家庭用耐久財              |  |
| SOCIETE GENERALE-A                  | 542.09           | 697.92           | 1,660            | 206,969     | 銀行                  |  |
| VINCI S.A.                          | 353.62           | 438.89           | 3,471            | 432,841     | 建設・土木               |  |
| SODEXO                              | 62.86            | 86.39            | 812              | 101,313     | ホテル・レストラン・レジャー      |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 388.99           | 480.32           | 3,176            | 396,087     | 電気設備                |  |
| VIVENDI SA                          | 726.3            | 935.6            | 2,126            | 265,146     | 娯楽                  |  |
| TOTAL SA                            | 1,686.22         | 2,125.19         | 10,410           | 1,297,949   | 石油・ガス・消耗燃料          |  |

| 銘柄                          | 期首(前期末)          |                   | 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…フランス)                  | 百株               | 百株                | 千ユーロ              | 千円           |                         |  |
| VALEO                       | 177.31           | 247.98            | 621               | 77,511       | 自動車部品                   |  |
| ORANGE                      | 1,418.19         | 1,726.54          | 2,278             | 284,042      | 各種電気通信サービス              |  |
| HERMES INTL                 | 22.85            | 27.03             | 1,463             | 182,457      | 繊維・アパレル・贅沢品             |  |
| SOCIETE BIC SA              | 24.78            | 24.78             | 206               | 25,720       | 商業サービス・用品               |  |
| DASSAULT SYSTEMES SA        | 89.61            | 109.13            | 1,383             | 172,528      | ソフトウェア                  |  |
| KERING                      | 54.79            | 66.09             | 3,094             | 385,801      | 繊維・アパレル・贅沢品             |  |
| CNP ASSURANCES              | 139.87           | 139.87            | 279               | 34,877       | 保険                      |  |
| CARREFOUR SA                | 391.44           | 510.94            | 907               | 113,106      | 食品・生活必需品小売り             |  |
| ATOS SE                     | 70.5             | 88.16             | 724               | 90,352       | 情報技術サービス                |  |
| SANOFI                      | 798.78           | 977.88            | 7,176             | 894,786      | 医薬品                     |  |
| UBISOFT ENTERTAINMENT       | 39.3             | 59.11             | 407               | 50,807       | 娯楽                      |  |
| TELEPERFORMANCE             | 36.07            | 53.63             | 823               | 102,705      | 専門サービス                  |  |
| EURAZEO                     | 24.27            | 47.25             | 300               | 37,408       | 各種金融サービス                |  |
| JC DECAUX SA                | 60.58            | 60.58             | 162               | 20,272       | メディア                    |  |
| ESSILORLUXOTTICA            | 146.32           | 241.21            | 2,559             | 319,085      | 繊維・アパレル・贅沢品             |  |
| CREDIT AGRICOLE SA          | 855.85           | 999.73            | 979               | 122,153      | 銀行                      |  |
| WENDEL                      | 22.2             | 22.2              | 233               | 29,062       | 各種金融サービス                |  |
| ILIAD SA                    | 21.02            | 21.02             | 183               | 22,916       | 各種電気通信サービス              |  |
| BIOMERIEUX                  | -                | 32.48             | 226               | 28,266       | ヘルスケア機器・用品              |  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH    | -                | 28.81             | 293               | 36,602       | ライフサイエンス・ツール/サービス       |  |
| ENGIE                       | 1,295.39         | 1,597.35          | 2,242             | 279,617      | 総合公益事業                  |  |
| ALSTOM                      | 120.46           | 120.46            | 444               | 55,359       | 機械                      |  |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS     | 125.42           | 125.42            | 235               | 29,398       | メディア                    |  |
| ELECTRICITE DE FRANCE       | 347.56           | 538               | 798               | 99,577       | 電力                      |  |
| IPSEN SA                    | 24.87            | 36.46             | 430               | 53,640       | 医薬品                     |  |
| ARKEMA SA                   | 37.96            | 52.3              | 430               | 53,678       | 化学                      |  |
| LEGRAND SA                  | 199.2            | 233.08            | 1,308             | 163,087      | 電気設備                    |  |
| ADP                         | 23.13            | 23.13             | 376               | 46,891       | 運送インフラ                  |  |
| SCOR SE                     | 138.75           | 138.75            | 524               | 65,339       | 保険                      |  |
| REXEL SA                    | 232.45           | 232.45            | 246               | 30,749       | 商社・流通業                  |  |
| BUREAU VERITAS SA           | 214.8            | 214.8             | 417               | 52,009       | 専門サービス                  |  |
| GETLINK                     | 376.46           | 376.46            | 473               | 59,023       | 運送インフラ                  |  |
| SUEZ SA                     | 254.06           | 383.31            | 421               | 52,522       | 総合公益事業                  |  |
| EDENRED                     | 131.95           | 226.52            | 835               | 104,158      | 商業サービス・用品               |  |
| AMUNDI SA                   | 38.94            | 38.94             | 207               | 25,896       | 資本市場                    |  |
| 小 計                         | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 19,090.18<br>68銘柄 | 23,307.02<br>69銘柄 | 101,144<br>- | 12,610,645<br><3.6%>    |  |
| (ユーロ…ドイツ)                   | 百株               | 百株                | 千ユーロ              | 千円           |                         |  |
| ADIDAS AG                   | 135.03           | 163.56            | 3,222             | 401,735      | 繊維・アパレル・贅沢品             |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 227.05           | 303.04            | 2,101             | 262,025      | 自動車                     |  |
| COMMERZBANK AG              | 725.73           | 831.18            | 525               | 65,464       | 銀行                      |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA      | 285.3            | 346.4             | 1,621             | 202,125      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| UNITED INTERNET             | 98.82            | 98.82             | 303               | 37,899       | 各種電気通信サービス              |  |
| FUCHS PETROLUB SE PREF      | 55.46            | 55.46             | 225               | 28,129       | 化学                      |  |
| MAN SE                      | 33.96            | -                 | -                 | -            | 機械                      |  |
| HANNOVER RUECK SE           | 36.42            | 48.68             | 622               | 77,567       | 保険                      |  |
| GEA GROUP AG                | 118.38           | 118.38            | 239               | 29,858       | 機械                      |  |
| CONTINENTAL AG              | 77.76            | 95.28             | 1,273             | 158,829      | 自動車部品                   |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG        | 699.44           | 866.63            | 2,253             | 280,933      | 航空貨物・物流サービス             |  |
| AXEL SPRINGER SE            | 30.67            | 77.92             | 410               | 51,149       | メディア                    |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD  | 105.91           | 132.49            | 727               | 90,655       | 自動車                     |  |
| MERCK KGAA                  | 95.51            | 111.93            | 1,081             | 134,809      | 医薬品                     |  |
| RWE AG                      | 391.83           | 459.05            | 1,029             | 128,376      | 総合公益事業                  |  |
| SAP SE                      | 690.54           | 864.71            | 8,090             | 1,008,689    | ソフトウェア                  |  |
| E.ON SE                     | 1,640.12         | 1,974.27          | 1,907             | 237,807      | 総合公益事業                  |  |
| HENKEL AG & CO KGAA         | 75.25            | 93                | 750               | 93,515       | 家庭用品                    |  |
| SIEMENS AG-REG              | 537.06           | 671.82            | 6,197             | 772,709      | コングロマリット                |  |

| 銘 柄                               | 期 首(前期末)         |                   | 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…ドイツ)                         | 百株               | 百株                | 千ユーロ          | 千円                   |                         |
| PUMA AG                           | —                | 6                 | 270           | 33,738               | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| BAYER AG                          | 584.37           | 817.67            | 5,359         | 668,263              | 医薬品                     |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG        | 121.78           | 153.5             | 1,322         | 164,934              | 家庭用品                    |
| DAIMLER AG                        | 680.86           | 807.58            | 3,981         | 496,397              | 自動車                     |
| BASF SE                           | 651.28           | 798.36            | 5,151         | 642,229              | 化学                      |
| BEIERSDORF AG                     | 67.8             | 83.71             | 765           | 95,477               | パーソナル用品                 |
| HOCHTIEF AG                       | 17.07            | 17.07             | 225           | 28,114               | 建設・土木                   |
| HEIDELBERGCEMENT AG               | 110.09           | 141.26            | 847           | 105,673              | 建設資材                    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO    | 150.48           | 184.94            | 1,247         | 155,551              | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE                        | 319.55           | 374.94            | 6,906         | 861,089              | 保険                      |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE           | 176.02           | 176.02            | 268           | 33,478               | メディア                    |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG            | 159.63           | 249.26            | 539           | 67,221               | 旅客航空輸送業                 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG        | 107.6            | 129.66            | 2,606         | 324,936              | 保険                      |
| VOLKSWAGEN AG                     | 21.83            | 35.45             | 517           | 64,530               | 自動車                     |
| VOLKSWAGEN AG PFD                 | 131.34           | 153.82            | 2,182         | 272,063              | 自動車                     |
| THYSSENKRUPP AG                   | 299.03           | 378.94            | 503           | 62,837               | 金属・鉱業                   |
| 1&1 DRILLISCH AG                  | 31.49            | 31.49             | 105           | 13,168               | 無線通信サービス                |
| DEUTSCHE BANK AG-REG              | 1,492.44         | 1,719.85          | 1,269         | 158,250              | 資本市場                    |
| BMW VORZUG                        | 41.16            | 41.16             | 250           | 31,175               | 自動車                     |
| K & S                             | 149.82           | —                 | —             | —                    | 化学                      |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG           | 2,328.97         | 2,887.79          | 4,084         | 509,290              | 各種電気通信サービス              |
| SARTORIUS AG                      | —                | 27.12             | 397           | 49,536               | ヘルスケア機器・用品              |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 817.74           | 990.68            | 1,967         | 245,306              | 半導体・半導体製造装置             |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 138.44           | 169.13            | 1,864         | 232,485              | 資本市場                    |
| FRAPORT AG                        | 31.49            | 31.49             | 217           | 27,090               | 運送インフラ                  |
| WIRECARD AG                       | 79.9             | 98.91             | 1,011         | 126,095              | 情報技術サービス                |
| LANXESS AG                        | 68.56            | 68.56             | 322           | 40,227               | 化学                      |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG       | 31.34            | 48.59             | 930           | 116,014              | 航空宇宙・防衛                 |
| DEUTSCHE WOHNEN                   | 267.14           | 306.89            | 1,306         | 162,847              | 不動産管理・開発                |
| SYMRISE AG                        | 79.26            | 115.48            | 886           | 110,490              | 化学                      |
| BRENNTAG AG                       | 96               | 123.53            | 528           | 65,857               | 商社・流通業                  |
| EVONIK INDUSTRIES AG              | 115.75           | 227.84            | 557           | 69,483               | 化学                      |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 615.41           | 615.41            | 180           | 22,450               | 各種電気通信サービス              |
| HUGO BOSS AG -ORD                 | 52.18            | 52.18             | 324           | 40,518               | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| OSRAM LICHT AG                    | 70.17            | 70.17             | 280           | 34,933               | 電気設備                    |
| KION GROUP AG                     | 46.86            | 46.86             | 249           | 31,082               | 機械                      |
| VONOVIA SE                        | 353.08           | 407.75            | 1,790         | 223,281              | 不動産管理・開発                |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG           | —                | 152.54            | 533           | 66,565               | ヘルスケア機器・用品              |
| METRO AG                          | 107.74           | 107.74            | 162           | 20,317               | 食品・生活必需品小売り             |
| INNOGY SE                         | 97.69            | —                 | —             | —                    | 総合公益事業                  |
| LINDE AG-TENDER                   | 133.75           | —                 | —             | —                    | 化学                      |
| INNOGY SE-TEMPORARY               | —                | 97.69             | 365           | 45,510               | 総合公益事業                  |
| ZALANDO SE                        | 66.74            | 143.53            | 369           | 46,044               | インターネット販売・通信販売          |
| COVESTRO AG                       | 105              | 158.02            | 769           | 95,948               | 化学                      |
| SCHAEFFLER AG                     | 126.44           | —                 | —             | —                    | 自動車部品                   |
| UNIPER SE                         | 138.97           | 138.97            | 357           | 44,581               | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| DELIVERY HERO SE                  | —                | 72.38             | 257           | 32,054               | インターネット販売・通信販売          |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 20,772.55<br>61銘柄 | 86,617<br>—   | 10,799,427<br><3.1%> |                         |
| (ユーロ…ポルトガル)                       | 百株               | 百株                | 千ユーロ          | 千円                   |                         |
| JERONIMO MARTINS                  | 195.17           | 195.17            | 249           | 31,062               | 食品・生活必需品小売り             |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA           | 1,523.74         | 2,420.94          | 789           | 98,400               | 電力                      |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS       | 379.21           | 522.32            | 731           | 91,172               | 石油・ガス・消耗燃料              |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,098.12<br>3銘柄   | 3,138.43<br>— | 220,634<br><0.1%>    |                         |
| (ユーロ…スペイン)                        | 百株               | 百株                | 千ユーロ          | 千円                   |                         |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA       | 385.21           | —                 | —             | —                    | 運送インフラ                  |

| 銘柄   | 期首(前期末)          |                  | 当期     |           | 業種等         |
|--|------------------|------------------|--------|-----------|-------------|
|  | 株数               | 株数               | 評価額    |           |             |
|  |                  |                  | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |             |
| (ユーロ…スペイン)                                   | 百株               | 百株               | 千ユーロ   | 千円        |             |
| IBERDROLA SA                                 | 4,168.18         | 5,323.01         | 3,824  | 476,782   | 電力          |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY              | 144.26           | 144.26           | 192    | 23,966    | 電気設備        |
| REPSOL SA                                    | 826.64           | 1,267.23         | 1,900  | 236,918   | 石油・ガス・消耗燃料  |
| TELEFONICA S.A                               | 3,227.15         | 4,153.79         | 3,038  | 378,839   | 各種電気通信サービス  |
| ENDESA S.A.                                  | 210.37           | 293.14           | 639    | 79,676    | 電力          |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV                  | 150.49           | 232.16           | 855    | 106,664   | 建設・土木       |
| BANKINTER S.A.                               | 579.6            | 579.6            | 385    | 48,084    | 銀行          |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA                 | 4,643.5          | 5,956.67         | 2,995  | 373,418   | 銀行          |
| NATURGY ENERGY GROUP SA                      | 290.1            | 290.1            | 685    | 85,468    | ガス          |
| BANCO SANTANDER SA                           | 11,456.9         | 14,112.32        | 5,602  | 698,531   | 銀行          |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA              | 345.96           | 345.96           | 678    | 84,564    | 電力          |
| BANCO SABADELL                               | 3,677.53         | 5,633.71         | 510    | 63,708    | 銀行          |
| INDITEX                                      | 756.58           | 967.34           | 2,400  | 299,348   | 専門小売り       |
| MAPFRE SA                                    | 844.74           | 844.74           | 203    | 25,372    | 保険          |
| ENAGAS                                       | 180.95           | 180.95           | 452    | 56,356    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| GRIFOLS SA                                   | 188              | 235.18           | 547    | 68,203    | バイオテクノロジー   |
| FERROVIAL SA                                 | 369.97           | 468.31           | 922    | 114,967   | 建設・土木       |
| CAIXABANK                                    | 2,623.72         | 2,972.24         | 869    | 108,394   | 銀行          |
| AMADEUS IT GROUP SA                          | 301.69           | 384.92           | 2,635  | 328,552   | 情報技術サービス    |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA | 447.47           | 447.47           | 329    | 41,028    | 旅客航空輸送業     |
| BANKIA SA                                    | 631.97           | 1,006.75         | 249    | 31,091    | 銀行          |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERV-RTS   | 150              | -                | -      | -         | 建設・土木       |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION-RTS          | -                | 231.8            | 10     | 1,367     | 建設・土木       |
| AENA SME SA                                  | 52.56            | 61.75            | 928    | 115,754   | 運送インフラ      |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 30,855 | 3,847,062 |             |
| (ユーロ…イタリア)                                   | 百株               | 百株               | 千ユーロ   | 千円        |             |
| ASSICURAZIONI GENERALI                       | 859.95           | 1,040.14         | 1,561  | 194,721   | 保険          |
| INTESA SANPAOLO                              | 9,349.15         | 13,499.21        | 2,678  | 333,923   | 銀行          |
| INTESA SANPAOLO-RNC                          | 511.78           | -                | -      | -         | 銀行          |
| UNICREDIT SPA                                | 1,426.64         | 1,701.44         | 1,813  | 226,136   | 銀行          |
| ENI SPA                                      | 1,772.97         | 2,222.05         | 3,284  | 409,472   | 石油・ガス・消耗燃料  |
| MEDIOBANCA SPA                               | 424.04           | 620.22           | 497    | 62,017    | 銀行          |
| LUXOTTICA GROUP SPA                          | 116.02           | -                | -      | -         | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ENEL SPA                                     | 5,792.18         | 6,744.93         | 3,515  | 438,307   | 電力          |
| LEONARDO SPA                                 | 262.69           | 262.69           | 230    | 28,736    | 航空宇宙・防衛     |
| UNIPOLSAI SPA                                | 919.92           | -                | -      | -         | 保険          |
| SNAM SPA                                     | 1,584.19         | 1,997.02         | 831    | 103,728   | 石油・ガス・消耗燃料  |
| TELECOM ITALIA SPA                           | 7,921.63         | 11,584.73        | 558    | 69,619    | 各種電気通信サービス  |
| TELECOM ITALIA-RNC                           | 4,975.96         | 4,975.96         | 207    | 25,870    | 各種電気通信サービス  |
| ATLANTIA SPA                                 | 349.69           | 436.88           | 907    | 113,189   | 運送インフラ      |
| TERNA SPA                                    | 819.15           | 1,126.86         | 604    | 75,418    | 電力          |
| RECORDATI SPA                                | 68.59            | 68.59            | 229    | 28,665    | 医薬品         |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA                    | 355.83           | 557.25           | 452    | 56,416    | 飲料          |
| PRYSMIAN SPA                                 | 149.25           | 294.18           | 549    | 68,515    | 電気設備        |
| MONCLER SPA                                  | -                | 143.53           | 497    | 62,007    | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| POSTE ITALIANE SPA                           | 400.15           | 400.15           | 306    | 38,246    | 保険          |
| PIRELLI & C SPA                              | -                | 340.86           | 203    | 25,431    | 自動車部品       |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 18,931 | 2,360,424 |             |
| (ユーロ…フィンランド)                                 | 百株               | 百株               | 千ユーロ   | 千円        |             |
| WARTSILA OYJ                                 | 116.45           | 349.35           | 502    | 62,613    | 機械          |
| NOKIAN RENKAAT OYJ                           | 93.99            | 93.99            | 283    | 35,284    | 自動車部品       |
| UPM-KYMMENE OYJ                              | 369.17           | 493.71           | 1,319  | 164,538   | 紙製品・林産品     |
| STORA ENSO OYJ-R SHS                         | 423.03           | 423.03           | 508    | 63,371    | 紙製品・林産品     |
| SAMPO OYJ-A SHS                              | 288.97           | 394.03           | 1,664  | 207,515   | 保険          |
| FORTUM OYJ                                   | 297.39           | 374.52           | 752    | 93,763    | 電力          |



| 銘柄                            | 期首(前期末)          |                  | 当期     |             | 業種等        |
|-------------------------------|------------------|------------------|--------|-------------|------------|
|                               | 株数               | 株数               | 評価額    | 期末          |            |
|                               |                  |                  | 外貨建金額  | 邦貨換算金額      |            |
| (ユーロ…フィンランド)                  | 百株               | 百株               | 千ユーロ   | 千円          |            |
| NOKIA OYJ                     | 4,172.48         | 4,959.75         | 2,745  | 342,336     | 通信機器       |
| ELISA OYJ                     | 95.17            | 141.76           | 518    | 64,689      | 各種電気通信サービス |
| METSO OYJ                     | 85.85            | 85.85            | 245    | 30,666      | 機械         |
| NESTE OYJ                     | 88.39            | 108.4            | 943    | 117,637     | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KONE OYJ                      | 237.17           | 291.24           | 1,282  | 159,844     | 機械         |
| ORION OYJ                     | 80.51            | 80.51            | 237    | 29,612      | 医薬品        |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 11,003 | 1,371,872   |            |
| (ユーロ…オーストリア)                  | 百株               | 百株               | 千ユーロ   | 千円          |            |
| OMV AG                        | 97.66            | 128.17           | 585    | 73,029      | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VERBUND AG                    | -                | 67.78            | 284    | 35,459      | 電力         |
| VOEST-ALPINE AG               | 98.75            | 98.75            | 247    | 30,854      | 金属・鉱業      |
| ERSTE GROUP BANK AG           | 207.54           | 251.17           | 766    | 95,576      | 銀行         |
| ANDRITZ AG                    | 62.65            | 62.65            | 272    | 33,978      | 機械         |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL | 96.41            | 96.41            | 212    | 26,456      | 銀行         |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,368  | 295,355     |            |
| 合計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | -      | 333,346,813 |            |
|                               |                  |                  | -      | <95.3%>     |            |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の中値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## (2) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄                              | 期首(前期末) |         | 当期       |         | 期末 |     |
|---------------------------------|---------|---------|----------|---------|----|-----|
|                                 | □数      | □数      | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  | 比  | 率   |
| 不動産ファンド<br>(アメリカ)               | 千□      | 千□      | 千アメリカ・ドル | 千円      |    | %   |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT    | 7.304   | 9.644   | 1,291    | 142,604 |    | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC           | 11.168  | 13.309  | 1,771    | 195,651 |    | 0.1 |
| SL GREEN                        | 5.382   | 7.097   | 645      | 71,301  |    | 0.0 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT       | 77.528  | 125.554 | 1,288    | 142,267 |    | 0.0 |
| PROLOGIS INC                    | 38.966  | 55.164  | 3,908    | 431,640 |    | 0.1 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC       | 9.642   | 12.353  | 2,417    | 267,014 |    | 0.1 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST           | 6.285   | 8.062   | 794      | 87,799  |    | 0.0 |
| EQUINIX INC                     | 5.448   | 6.964   | 2,928    | 323,477 |    | 0.1 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC  | 10.544  | 13.649  | 713      | 78,836  |    | 0.0 |
| DUKE REALTY TRUST               | 24.47   | 32.954  | 978      | 108,054 |    | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 28.166  | 35.534  | 4,219    | 466,019 |    | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC        | 4.524   | 5.653   | 1,570    | 173,466 |    | 0.0 |
| EQUITY RESIDENTIAL              | 27.07   | 32.976  | 2,411    | 266,293 |    | 0.1 |
| FEDERAL REALTY INVST TRUST      | 4.144   | 6       | 805      | 88,939  |    | 0.0 |
| GGP INC                         | 43.463  | -       | -        | -       |    | -   |
| HCP INC                         | 34.13   | 39.277  | 1,215    | 134,210 |    | 0.0 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP         | 8.169   | 10.277  | 1,892    | 209,054 |    | 0.1 |
| WELLTOWER INC                   | 26.516  | 33.309  | 2,580    | 284,984 |    | 0.1 |
| KIMCO REALTY                    | 32.98   | 32.98   | 583      | 64,396  |    | 0.0 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST          | 11.649  | 11.649  | 553      | 61,083  |    | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC               | 19.265  | 23.977  | 845      | 93,395  |    | 0.0 |
| THE MACERICH COMPANY            | 9.014   | 9.014   | 392      | 43,324  |    | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC       | 51.147  | 64.001  | 1,173    | 129,632 |    | 0.0 |
| MID AMERICA                     | 8.123   | 10.258  | 1,063    | 117,401 |    | 0.0 |
| REALTY INCOME CORP              | 18.985  | 26.616  | 1,857    | 205,116 |    | 0.1 |
| REGENCY CENTERS CORP            | 11.294  | 13.023  | 856      | 94,579  |    | 0.0 |
| UDR INC                         | 17.458  | 21.658  | 966      | 106,774 |    | 0.0 |

| 銘柄                              | 期首(前期末)       |               | 当期              |                 |              |                 |           |
|---------------------------------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|--------------|-----------------|-----------|
|                                 | 口数            | 口数            | 外貨建金額           | 邦貨換算金額          | 比率           | 率               |           |
| <b>(アメリカ)</b>                   | 千口            | 千口            | 千アメリカ・ドル        | 千円              |              | %               |           |
| SIMON PROPERTY GROUP INC        | 21.825        | 26.5          | 4,869           | 537,803         |              | 0.2             |           |
| PUBLIC STORAGE                  | 11.151        | 13.721        | 2,856           | 315,419         |              | 0.1             |           |
| VENTAS INC                      | 25.041        | 30.244        | 1,957           | 216,241         |              | 0.1             |           |
| VORNADO REALTY TRUST            | 12.211        | 15.346        | 1,047           | 115,704         |              | 0.0             |           |
| WEYERHAEUSER CO                 | 51.939        | 63.699        | 1,619           | 178,827         |              | 0.1             |           |
| EXTRA SPACE STORAGE INC         | 8.141         | 11.885        | 1,176           | 129,919         |              | 0.0             |           |
| DIGITAL REALTY TRUST INC        | 15.118        | 18.388        | 2,092           | 231,122         |              | 0.1             |           |
| AGNC INVESTMENT CORP            | 25.741        | 44.741        | 791             | 87,409          |              | 0.0             |           |
| VEREIT INC                      | 72.429        | 93.429        | 772             | 85,332          |              | 0.0             |           |
| AMERICAN TOWER CORP             | 30.693        | 38.497        | 6,767           | 747,390         |              | 0.2             |           |
| WP CAREY INC                    | -             | 15.148        | 1,138           | 125,705         |              | 0.0             |           |
| INVITATION HOMES INC            | 22.567        | 30.427        | 692             | 76,448          |              | 0.0             |           |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC      | 21.975        | -             | -               | -               |              | -               |           |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC    | -             | 19.124        | 381             | 42,177          |              | 0.0             |           |
| COLONY CAPITAL INC              | 39.311        | -             | -               | -               |              | -               |           |
| 小計                              | 口数<br>銘柄数<比率> | 口数<br>銘柄数<比率> | 金額<br>910,976   | 金額<br>1,082,101 | 金額<br>65,889 | 金額<br>7,276,820 | 比率<br>2.1 |
| <b>(カナダ)</b>                    | 千口            | 千口            | 千カナダ・ドル         | 千円              |              | %               |           |
| SMARTCENTRES REIT               | 2.582         | 9.288         | 317             | 26,346          |              | 0.0             |           |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT    | 10.748        | 10.748        | 240             | 19,971          |              | 0.0             |           |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 9.675         | 9.675         | 247             | 20,506          |              | 0.0             |           |
| 小計                              | 口数<br>銘柄数<比率> | 口数<br>銘柄数<比率> | 金額<br>23,005    | 金額<br>29,711    | 金額<br>805    | 金額<br>66,824    | 比率<br>0.0 |
| <b>(オーストラリア)</b>                | 千口            | 千口            | 千オーストラリア・ドル     | 千円              |              | %               |           |
| MIRVAC GROUP                    | 295.783       | 295.783       | 757             | 59,326          |              | 0.0             |           |
| GPT GROUP                       | 144.955       | 144.955       | 843             | 66,099          |              | 0.0             |           |
| LENDLEASE GROUP                 | 37.363        | 60.871        | 811             | 63,574          |              | 0.0             |           |
| STOCKLAND                       | 126.459       | 194.018       | 715             | 56,092          |              | 0.0             |           |
| WESTFIELD CORP                  | 140.035       | -             | -               | -               |              | -               |           |
| DEXUS                           | 63.819        | 80.596        | 967             | 75,776          |              | 0.0             |           |
| GOODMAN GROUP                   | 121.619       | 147.572       | 1,846           | 144,643         |              | 0.0             |           |
| VICINITY CENTRES                | 270.443       | 270.443       | 695             | 54,456          |              | 0.0             |           |
| SCENTRE GROUP                   | 383.688       | 476.956       | 1,888           | 147,983         |              | 0.0             |           |
| 小計                              | 口数<br>銘柄数<比率> | 口数<br>銘柄数<比率> | 金額<br>1,584,164 | 金額<br>1,671,194 | 金額<br>8,525  | 金額<br>667,952   | 比率<br>0.2 |
| <b>(香港)</b>                     | 千口            | 千口            | 千香港・ドル          | 千円              |              | %               |           |
| LINK REIT                       | 163.5         | 185.5         | 16,073          | 226,155         |              | 0.1             |           |
| 小計                              | 口数<br>銘柄数<比率> | 口数<br>銘柄数<比率> | 金額<br>163.5     | 金額<br>185.5     | 金額<br>16,073 | 金額<br>226,155   | 比率<br>0.1 |
| <b>(シンガポール)</b>                 | 千口            | 千口            | 千シンガポール・ドル      | 千円              |              | %               |           |
| CAPITALAND MALL TRUST           | 199           | 199           | 473             | 38,524          |              | 0.0             |           |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT       | 200.806       | 200.806       | 552             | 44,917          |              | 0.0             |           |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST     | -             | 206.3         | 383             | 31,211          |              | 0.0             |           |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR    | 192.1         | 192.1         | 359             | 29,219          |              | 0.0             |           |
| 小計                              | 口数<br>銘柄数<比率> | 口数<br>銘柄数<比率> | 金額<br>591,906   | 金額<br>798,206   | 金額<br>1,768  | 金額<br>143,872   | 比率<br>0.0 |
| <b>(イギリス)</b>                   | 千口            | 千口            | 千イギリス・ポンド       | 千円              |              | %               |           |
| BRITISH LAND CO PLC             | 71.871        | 71.871        | 419             | 59,307          |              | 0.0             |           |
| HAMMERSON PLC                   | 58.616        | 58.616        | 222             | 31,481          |              | 0.0             |           |
| LAND SECURITIES GROUP PLC       | 37.974        | 59.062        | 522             | 73,857          |              | 0.0             |           |
| SEGRO PLC                       | 61.113        | 82.914        | 537             | 75,941          |              | 0.0             |           |
| 小計                              | 口数<br>銘柄数<比率> | 口数<br>銘柄数<比率> | 金額<br>229,574   | 金額<br>272,463   | 金額<br>1,702  | 金額<br>240,587   | 比率<br>0.1 |
| <b>(オランダ)</b>                   | 千口            | 千口            | 千ユーロ            | 千円              |              | %               |           |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD       | -             | 12.061        | 1,729           | 215,670         |              | 0.1             |           |
| 小計                              | 口数<br>銘柄数<比率> | 口数<br>銘柄数<比率> | 金額<br>-         | 金額<br>12,061    | 金額<br>1,729  | 金額<br>215,670   | 比率<br>0.1 |
| <b>(フランス)</b>                   | 千口            | 千口            | 千ユーロ            | 千円              |              | %               |           |
| GECINA SA                       | 3.67          | 3.67          | 462             | 57,700          |              | 0.0             |           |

| 銘柄                 | 期首(前期末)                 |                         | 当期    |           |    | 期末  |  |
|--------------------|-------------------------|-------------------------|-------|-----------|----|-----|--|
|                    | 口数                      | 口数                      | 外貨建金額 | 邦貨換算金額    | 比率 | 比率  |  |
| (フランス)             | 千口                      | 千口                      | 千ユーロ  | 千円        |    | %   |  |
| ICADE              | 2.234                   | 2.234                   | 164   | 20,569    |    | 0.0 |  |
| KLEPIERRE          | 17.042                  | 17.042                  | 507   | 63,233    |    | 0.0 |  |
| COVIVIO            | 2.343                   | 4.675                   | 406   | 50,710    |    | 0.0 |  |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 7.221                   | -                       | -     | -         |    | -   |  |
| 小計                 | 32.51<br>5銘柄<0.1%>      | 27.621<br>4銘柄<0.1%>     | 1,541 | 192,214   |    | 0.1 |  |
| 合計                 | 3,535.635<br>65銘柄<2.2%> | 4,078.857<br>64銘柄<2.6%> | -     | 9,030,097 |    | 2.6 |  |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 銘柄別                   | 当期    |     | 期末  |     |
|----|-----------------------|-------|-----|-----|-----|
|    |                       | 買建額   | 売建額 | 買建額 | 売建額 |
| 外国 | S & P 500 EMINI FUT   | 4,908 |     |     |     |
|    | S & P / TSE 60 IX FUT | 263   |     |     |     |
|    | SPI 200 FUTURES       | 188   |     |     |     |
|    | FTSE 100 INDEX FUTURE | 445   |     |     |     |
|    | DJ EURO STOXX 50      | 1,174 |     |     |     |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を期末の仲値により、邦貨換算したものです。

## ■投資信託財産の構成

2019年2月15日現在

| 項目            | 当期          |       | 期末  |    |
|---------------|-------------|-------|-----|----|
|               | 評価額         | 比率    | 評価額 | 比率 |
| 株式            | 333,346,813 | 94.0  |     |    |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 9,030,097   | 2.5   |     |    |
| コール・ローン等、その他  | 12,119,648  | 3.4   |     |    |
| 投資信託財産総額      | 354,496,559 | 100.0 |     |    |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、349,667,585千円、98.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.44円、1カナダ・ドル=82.99円、1オーストラリア・ドル=78.35円、1香港・ドル=14.07円、1シンガポール・ドル=81.34円、1ニュージーランド・ドル=75.29円、1イギリス・ポンド=141.30円、1イスラエル・シケル=30.36円、1スイス・フラン=109.80円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=12.76円、1スウェーデン・クローナ=11.88円、1ユーロ=124.68円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月15日)現在

| 項 目                              | 当 期 末            |
|----------------------------------|------------------|
| (A) 資 産                          | 354,641,793,311円 |
| 株 券 (評 価 額)                      | 8,845,419,791    |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)          | 333,346,813,573  |
| 未 収 入 当 期 配 入 証 券 (評 価 額)        | 811,825,352      |
| 未 収 入 当 期 配 入 証 券 (評 価 額)        | 8,218,272,061    |
| 未 収 入 当 期 配 入 証 券 (評 価 額)        | 581,033,916      |
| 未 収 入 当 期 配 入 証 券 (評 価 額)        | 498,296,652      |
| (B) 負 債                          | 2,340,131,966    |
| 未 収 入 当 期 配 入 証 券 (評 価 額)        | 4,951,972,087    |
| 未 収 入 当 期 配 入 証 券 (評 価 額)        | 4,817,636,087    |
| 未 収 入 当 期 配 入 証 券 (評 価 額)        | 134,336,000      |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B)            | 349,689,821,224  |
| 元 次 期 繰 越 損 益 本 金 数              | 101,602,311,525  |
| (D) 受 取 万 益 当 たり 基 準 価 額 (C / D) | 248,087,509,699  |
|                                  | 101,602,311,525円 |
|                                  | 34,418円          |

|                                |                 |   |                  |
|--------------------------------|-----------------|---|------------------|
| (注1) 期首元本額                     | 85,414,197,806円 | DIAMコア資産設計ファンド (積極型)                    | 8,330,426円       |
| 追加設定元本額                        | 42,163,749,070円 | 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                     | 40,452,146円      |
| 一部解約元本額                        | 25,975,635,351円 | ダイナミック・ナビゲーション                          | 388,924円         |
| (注2) 期末における元本の内訳               |                 | リスク抑制世界8資産バランスファンド                      | 677,295,161円     |
| DIAM外国株式パッシブ・ファンド              | 2,617,753,619円  | ワールドアセットバランス (基本コース)                    | 610,427,443円     |
| MITO ラップ型ファンド (安定型)            | 2,665,744円      | ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)                 | 1,868,456,055円   |
| MITO ラップ型ファンド (中立型)            | 8,231,580円      | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)                 | 724,126円         |
| MITO ラップ型ファンド (積極型)            | 16,074,086円     | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)                 | 562,792円         |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)          | 22,332,727円     | リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)                 | 267,666円         |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)          | 23,592,520円     | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)                 | 436,307円         |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)          | 19,511,274円     | 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>                    | 5,484,883円       |
| たわらノーロード 先進国株式                 | 8,653,055,227円  | リスクコントロール世界資産分散ファンド                     | 97,310,489円      |
| たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>          | 423,862円        | 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                    | 13,989円          |
| たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>        | 1,132,564,401円  | DIAM外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)        | 90,212,011円      |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)         | 81,659,165円     | DIAM外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)          | 2,386,078,283円   |
| たわらノーロード バランス (堅実型)            | 6,355,387円      | DIAM先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)           | 12,399,994,368円  |
| たわらノーロード バランス (標準型)            | 57,012,813円     | 外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)              | 206,166,728円     |
| たわらノーロード バランス (積極型)            | 90,265,532円     | DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)            | 21,819,707円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)   | 251,550円        | DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)      | 84,992,541円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)   | 20,129,423円     | DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)      | 203,822,815円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 60,351,621円     | DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)        | 11,034,426円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)   | 45,644,551円     | DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)        | 69,806,746円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)   | 115,690,976円    | DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)        | 6,136,844円       |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型)         | 26,534円         | DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)        | 6,677,114円       |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)         | 143,098円        | DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)          | 19,449,829円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)       | 869,061円        | DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)          | 60,207,131円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)         | 667,205円        | DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)            | 499,415,290円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)         | 2,472,482円      | DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)          | 622,804,311円     |
| DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>       | 40,530,877,161円 | DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)            | 1,971,721,205円   |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型        | 177,133,387円    | DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)       | 715,995,121円     |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型     | 908,186,447円    | DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)      | 114,907,490円     |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型        | 1,088,583,348円  | DIAM アサヒ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 817,522,480円     |
| DIAM DC バランス30インデックスファンド       | 128,572,029円    | DIAM世界アセットバランスファンド (適格機関投資家向け)          | 85,003,032円      |
| DIAM DC バランス50インデックスファンド       | 360,021,829円    | DIAMグローバル私募ファンド (適格機関投資家向け)             | 2,754,975円       |
| DIAM DC バランス70インデックスファンド       | 323,498,598円    | DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)          | 25,760,341円      |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)          | 30,117,672円     | DIAM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)          | 14,513,929円      |
| マネックス資産設計ファンド (育成型)            | 800,847,222円    | DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)       | 4,330,444,265円   |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション         | 211,264,940円    | DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)      | 117,506,788円     |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)    | 215,665,489円    | DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)      | 1,323,905,558円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)    | 144,342,457円    | DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)       | 5,050,880,568円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)    | 249,688,816円    | DIAMバランス30VA (適格機関投資家限定)                | 17,998,120円      |
| 投資のソムリエ                        | 1,214,413,350円  | DIAMバランス50VA (適格機関投資家限定)                | 860,549円         |
| クルーズコントロール                     | 462,306,913円    | DIAMバランス70VA (適格機関投資家限定)                | 9,815,345円       |
| 投資のソムリエ<DC年金>                  | 113,522,125円    | DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)       | 6,744,194,888円   |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>        | 164,698,295円    | DIAMバランス20VA (適格機関投資家限定)                | 58,588,772円      |
| DIAM DC バランス・F (成長型)           | 95,711,034円     | DIAMバランス40VA (適格機関投資家限定)                | 234,611円         |
| クルーズコントロール<DC年金>               | 328,099円        | DIAMバランス60VA (適格機関投資家限定)                | 262,654円         |
| DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)           | 3,148,634円      | 期末元本合計                                  | 101,602,311,525円 |

## ■損益の状況

当期 自2018年2月16日 至2019年2月15日

| 項   | 目   | 当                           | 期                                 |
|-----|---|-----------------------------|-----------------------------------|
| (A) | 配当<br>受取<br>受取<br>その<br>支取<br>の<br>他<br>の<br>払<br>金 | 等配<br>取<br>取<br>利<br>収<br>当 | 益<br>金<br>息<br>金<br>息<br>△592,512 |
| (B) | 有価<br>証券<br>買<br>売<br>損<br>益                        | 買<br>売<br>損<br>益            | 益<br>益<br>損<br>△27,320,596,477    |
| (C) | 先物<br>取引<br>取<br>引<br>損<br>益                        | 取<br>引<br>損<br>益            | 損<br>益<br>△1,722,285,196          |
| (D) | その<br>他<br>の<br>費<br>用                              | 引<br>引<br>引<br>引<br>費<br>用  | 用<br>△54,363,769                  |
| (E) | 当期<br>損<br>益  | 金(A+B+C+D)                  | 12,167,024,228                    |
| (F) | 前期<br>繰<br>越<br>損<br>益                              | 損<br>益                      | 金<br>199,033,935,190              |
| (G) | 解約<br>差<br>損<br>益                                   | 損<br>益                      | 金<br>△63,448,458,649              |
| (H) | 追加<br>信託<br>差<br>損<br>益                             | 損<br>益                      | 金<br>100,335,008,930              |
| (I) | 合計  | 計(E+F+G+H)                  | 248,087,509,699                   |
|     | 繰<br>越<br>損<br>益                                    | 損<br>益                      | 金(I)<br>248,087,509,699           |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

## 《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

# 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第16期（決算日 2019年2月21日）

（計算期間 2018年2月22日～2019年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第16期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。

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 2002年12月10日から無期限です。  |
| 運用方針   | 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。                                 |
| 主要投資対象 | 海外の公社債を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限 | 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。<br>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>外貨建資産への投資には、制限を設けません。 |

## ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |      | FTSE世界国債インデックス                  |           | 債券組入率     | 債券先物比率 | 純資産総額          |
|-----------------|--------|------|---------------------------------|-----------|-----------|--------|----------------|
|                 | 円      | 騰落率  | （除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）<br>（ベンチマーク） | 騰落率       |           |        |                |
| 12期（2015年2月23日） | 18,820 | 14.8 | ポイント<br>117,697.87              | %<br>14.9 | %<br>97.5 | %<br>- | 百万円<br>345,838 |
| 13期（2016年2月22日） | 17,881 | △5.0 | 111,769.89                      | △5.0      | 97.6      | -      | 267,780        |
| 14期（2017年2月21日） | 17,364 | △2.9 | 108,792.68                      | △2.7      | 97.9      | -      | 248,485        |
| 15期（2018年2月21日） | 17,876 | 2.9  | 111,885.82                      | 2.8       | 97.7      | -      | 217,863        |
| 16期（2019年2月21日） | 18,170 | 1.6  | 113,733.36                      | 1.7       | 98.1      | -      | 197,670        |

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注3）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

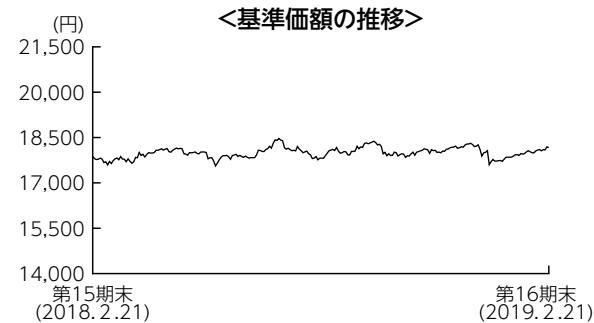
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                    | 基 準 価 額     |        | F T S E世界国債インデックス<br>(除く日本、<br>円ベース、<br>為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |        | 債券組入<br>比 率 | 債券先物<br>比 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--|--------|-------------|-------------|
|                          | 騰 落 率       |        | 騰 落 率  |        |             |             |
| (期 首)<br>2018 年 2 月 21 日 | 円<br>17,876 | %<br>- | ポイント<br>111,885.82   | %<br>- | %<br>97.7   | %<br>-      |
| 2 月 末                    | 17,790      | △0.5   | 111,369.59   | △0.5   | 98.1        | -           |
| 3 月 末                    | 17,907      | 0.2    | 112,110.56   | 0.2    | 96.6        | -           |
| 4 月 末                    | 18,127      | 1.4    | 113,447.49   | 1.4    | 101.8       | -           |
| 5 月 末                    | 17,660      | △1.2   | 110,306.34   | △1.4   | 97.4        | -           |
| 6 月 末                    | 17,925      | 0.3    | 112,167.37   | 0.3    | 97.3        | -           |
| 7 月 末                    | 18,060      | 1.0    | 113,026.89   | 1.0    | 97.4        | -           |
| 8 月 末                    | 18,047      | 1.0    | 112,887.86   | 0.9    | 97.0        | -           |
| 9 月 末                    | 18,348      | 2.6    | 115,005.76   | 2.8    | 97.2        | -           |
| 10 月 末                   | 18,016      | 0.8    | 112,853.40   | 0.9    | 97.9        | -           |
| 11 月 末                   | 18,179      | 1.7    | 113,725.26   | 1.6    | 97.5        | -           |
| 12 月 末                   | 18,064      | 1.1    | 112,822.19   | 0.8    | 97.6        | -           |
| 2019 年 1 月 末             | 17,952      | 0.4    | 111,997.50   | 0.1    | 98.1        | -           |
| (期 末)<br>2019 年 2 月 21 日 | 18,170      | 1.6    | 113,733.36   | 1.7    | 98.1        | -           |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年2月22日から2019年2月21日まで）



### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は18,170円となり、前期末比で1.6%上昇しました。

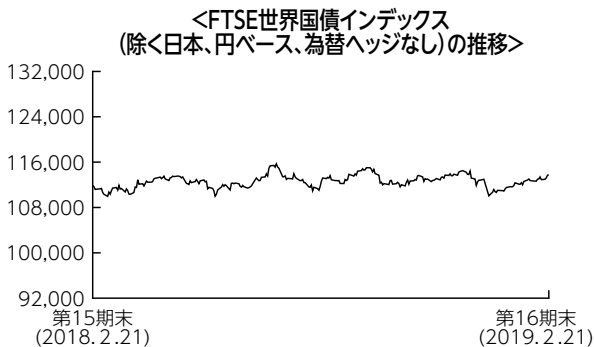
### 基準価額の主な変動要因

E C B（欧州中央銀行）が金融緩和政策を継続していることや、世界的に景気減速懸念が強まっていることを背景に、国債利回りが世界的に低下（価格は上昇）したことから、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

外国債券市場では、米国債利回りは上昇傾向にあったものの、2018年末に低下する展開となり、欧州債は期を通して概ね利回りが低下する展開となりました。米国では堅調な経済情勢を背景にした段階的な利上げ等により利回りは上昇傾向となりましたが、2018年末には米中貿易摩擦の経済への影響が懸念される中で利回りは低下に転じました。その結果、期末の利回りは期初と比べ小幅低下しました。欧州圏ではE C Bが金融緩和政策を継続する中で金利の上昇は抑えられ、欧州債の利回りは概ね低下する展開となりました。

為替市場では、円は対ドルでドル高円安に、対ユーロではユーロ安円高になりました。ドル／円は米国の



段階的な利上げ等によりドル高円安が進みましたが、2018年末には世界的な株安がリスク回避の動きを招き、ドル安円高が進みました。その結果、前期末比ではドル高円安となりました。ユーロ／円はE C Bが金融緩和政策を継続していること、2018年末に世界的に景気減速懸念が強まったこと等からユーロ安円高となりました。



## ポートフォリオについて

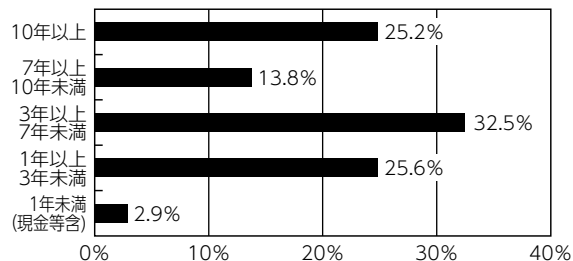
ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

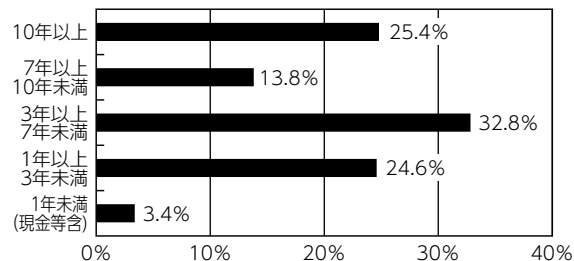
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○残存別構成比

#### 期首（前期末）



#### 期末



### ○国別構成比

#### 期首（前期末）

| 国         | 当ファンド   | 世界国債インデックス | 差     |       |
|-----------|---------|------------|-------|-------|
| 北米        | 米国      | 41.3%      | △0.6% |       |
|           | カナダ     | 2.1%       | △0.1% |       |
|           | 計       | 43.4%      | △0.7% |       |
| 中南米       | メキシコ    | 0.8%       | △0.0% |       |
|           | 計       | 0.8%       | △0.0% |       |
| 欧州        | オーストリア  | 1.6%       | △0.1% |       |
|           | ベルギー    | 2.5%       | △0.1% |       |
|           | フィンランド  | 0.6%       | △0.0% |       |
|           | フランス    | 10.3%      | △0.2% |       |
|           | ドイツ     | 7.1%       | △0.1% |       |
|           | アイルランド  | 0.8%       | △0.1% |       |
|           | イタリア    | 10.0%      | △0.2% |       |
|           | オランダ    | 2.1%       | △0.1% |       |
|           | スペイン    | 5.9%       | △0.1% |       |
|           | ユーロ計    | 40.9%      | 41.9% | △1.0% |
|           | デンマーク   | 0.6%       | △0.0% |       |
|           | スウェーデン  | 0.5%       | △0.0% |       |
|           | スイス     | 0.0%       | △0.2% |       |
| 英国        | 7.0%    | 7.3%       | △0.2% |       |
| ポーランド     | 0.7%    | △0.0%      |       |       |
| ノルウェー     | 0.3%    | 0.3%       | △0.0% |       |
|           | 計       | 49.9%      | 51.4% | △1.5% |
| アジア・オセアニア | オーストラリア | 2.2%       | △0.1% |       |
|           | シンガポール  | 0.4%       | △0.0% |       |
|           | マレーシア   | 0.4%       | △0.1% |       |
|           | 計       | 2.9%       | 3.1%  | △0.2% |
| アフリカ      | 南アフリカ   | 0.6%       | △0.0% |       |
|           | 計       | 0.6%       | △0.0% |       |
| 現金など      | 2.3%    | -          | -     |       |
| 合計        | 100.0%  | 100.0%     | -     |       |

#### 期末

| 国         | 当ファンド   | 世界国債インデックス | 差     |       |
|-----------|---------|------------|-------|-------|
| 北米        | 米国      | 45.6%      | △0.3% |       |
|           | カナダ     | 2.0%       | 2.0%  | △0.1% |
|           | 計       | 47.5%      | 47.9% | △0.4% |
| 中南米       | メキシコ    | 0.7%       | 0.8%  | △0.1% |
|           | 計       | 0.7%       | 0.8%  | △0.1% |
| 欧州        | オーストリア  | 1.5%       | 1.5%  | △0.0% |
|           | ベルギー    | 2.4%       | 2.5%  | △0.0% |
|           | フィンランド  | 0.7%       | 0.6%  | 0.0%  |
|           | フランス    | 9.9%       | 10.1% | △0.2% |
|           | ドイツ     | 6.6%       | 6.7%  | △0.1% |
|           | アイルランド  | 0.8%       | 0.8%  | 0.0%  |
|           | イタリア    | 8.6%       | 9.1%  | △0.5% |
|           | オランダ    | 2.0%       | 2.0%  | 0.0%  |
|           | スペイン    | 5.6%       | 5.9%  | △0.3% |
|           | ユーロ計    | 38.2%      | 39.1% | △1.0% |
| デンマーク     | 0.5%    | 0.5%       | △0.0% |       |
| スウェーデン    | 0.3%    | 0.4%       | △0.0% |       |
| 英国        | 6.7%    | 6.8%       | △0.1% |       |
| ポーランド     | 0.6%    | 0.6%       | △0.1% |       |
| ノルウェー     | 0.2%    | 0.2%       | △0.0% |       |
|           | 計       | 46.5%      | 47.7% | △1.2% |
| アジア・オセアニア | オーストラリア | 2.1%       | 2.1%  | △0.0% |
|           | シンガポール  | 0.3%       | 0.4%  | △0.1% |
|           | マレーシア   | 0.4%       | 0.5%  | △0.0% |
|           | 計       | 2.8%       | 3.0%  | △0.1% |
| アフリカ      | 南アフリカ   | 0.5%       | 0.6%  | △0.1% |
|           | 計       | 0.5%       | 0.6%  | △0.1% |
| 現金など      | 1.9%    | -          | -     |       |
| 合計        | 100.0%  | 100.0%     | -     |       |

(注) 世界国債インデックスとはFTSE世界国債インデックス（除く日本）です。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.01%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスになりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

## 今後の運用方針

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目       | 当 期 |         |
|-----------|-----|---------|
|           | 金 額 | 比 率     |
| (a) その他費用 | 2円  | 0.010%  |
| （保管費用）    | (2) | (0.010) |
| （その他）     | (0) | (0.000) |
| 合 計       | 2   | 0.010   |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,996円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については13ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

## ■売買及び取引の状況（2018年2月22日から2019年2月21日まで）

### 公社債

|   |         |        | 買付額                    | 売付額                    |
|---|---------|--------|------------------------|------------------------|
| 外 | アメリカ    | 国債証券   | 千アメリカ・ドル<br>223,619    | 千アメリカ・ドル<br>257,893    |
|   | カナダ     | 国債証券   | 千カナダ・ドル<br>8,675       | 千カナダ・ドル<br>17,519      |
|   | オーストラリア | 国債証券   | 千オーストラリア・ドル<br>8,641   | 千オーストラリア・ドル<br>14,674  |
|   | シンガポール  | 国債証券   | 千シンガポール・ドル<br>636      | 千シンガポール・ドル<br>2,171    |
|   | イギリス    | 国債証券   | 千イギリス・ポンド<br>14,690    | 千イギリス・ポンド<br>26,425    |
|   | デンマーク   | 国債証券   | 千デンマーク・クローネ<br>15,758  | 千デンマーク・クローネ<br>30,724  |
|   | ノルウェー   | 国債証券   | 千ノルウェー・クローネ<br>14,512  | 千ノルウェー・クローネ<br>29,450  |
|   | スウェーデン  | 国債証券   | 千スウェーデン・クローナ<br>11,457 | 千スウェーデン・クローナ<br>32,234 |
|   | メキシコ    | 国債証券   | 千メキシコ・ペソ<br>19,317     | 千メキシコ・ペソ<br>54,916     |
|   | マレーシア   | 国債証券   | 千マレーシア・リンギット<br>1,521  | 千マレーシア・リンギット<br>5,243  |
|   | 南アフリカ   | 国債証券   | 千南アフリカ・ランド<br>16,287   | 千南アフリカ・ランド<br>19,842   |
|   | ポーランド   | 国債証券   | 千ポーランド・ズロチ<br>9,239    | 千ポーランド・ズロチ<br>17,201   |
| 国 | ユーロ     | アイルランド | 千ユーロ<br>2,138          | 千ユーロ<br>2,592          |
|   |         | オランダ   | 4,655                  | 8,533                  |
|   |         | ベルギー   | 7,375                  | 11,030                 |
|   |         | フランス   | 26,275                 | 40,934                 |
|   |         | ドイツ    | 18,136                 | 34,087                 |
|   |         | スペイン   | 20,715                 | 29,890                 |
|   |         | イタリア   | 21,298                 | 40,427                 |
|   |         | フィンランド | 1,741                  | 1,083                  |
|   | オーストリア  | 5,253  | 8,282                  |                        |

(注) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

## ■利害関係人との取引状況等（2018年2月22日から2019年2月21日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

## ■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分     | 当 期 末                   |                         |                   |           |                 |           |           |          |  |
|---------|-------------------------|-------------------------|-------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|--|
|         | 額 面 金 額                 | 評 価 額                   |                   | 組入比率      | うちBB格<br>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<br>811,860     | 千アメリカ・ドル<br>813,428     | 千円<br>90,046,589  | %<br>45.6 | %<br>-          | %<br>18.6 | %<br>17.2 | %<br>9.7 |  |
| カ ナ ダ   | 千カナダ・ドル<br>42,320       | 千カナダ・ドル<br>45,974       | 千円<br>3,864,133   | 2.0       | -               | 0.9       | 0.7       | 0.3      |  |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>47,170   | 千オーストラリア・ドル<br>51,717   | 千円<br>4,118,815   | 2.1       | -               | 1.4       | 0.6       | 0.1      |  |
| シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>7,770     | 千シンガポール・ドル<br>8,130     | 千円<br>666,012     | 0.3       | -               | 0.2       | 0.1       | -        |  |
| イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>74,480     | 千イギリス・ポンド<br>91,989     | 千円<br>13,280,489  | 6.7       | -               | 5.1       | 1.1       | 0.6      |  |
| デンマーク   | 千デンマーク・クローネ<br>44,900   | 千デンマーク・クローネ<br>58,974   | 千円<br>991,943     | 0.5       | -               | 0.4       | 0.1       | -        |  |
| ノルウェー   | 千ノルウェー・クローネ<br>29,640   | 千ノルウェー・クローネ<br>30,580   | 千円<br>393,883     | 0.2       | -               | 0.1       | 0.1       | -        |  |
| スウェーデン  | 千スウェーデン・クローナ<br>48,610  | 千スウェーデン・クローナ<br>54,908  | 千円<br>652,318     | 0.3       | -               | 0.2       | 0.1       | -        |  |
| メキシコ    | 千メキシコ・ペソ<br>251,739     | 千メキシコ・ペソ<br>247,524     | 千円<br>1,425,739   | 0.7       | -               | 0.5       | 0.3       | -        |  |
| マレーシア   | 千マレーシア・リングギット<br>29,750 | 千マレーシア・リングギット<br>29,948 | 千円<br>814,899     | 0.4       | -               | 0.3       | 0.1       | 0.0      |  |
| 南アフリカ   | 千南アフリカ・ランド<br>151,470   | 千南アフリカ・ランド<br>136,165   | 千円<br>1,075,710   | 0.5       | -               | 0.5       | 0.0       | -        |  |
| ポーランド   | 千ポーランド・ズロチ<br>36,520    | 千ポーランド・ズロチ<br>38,526    | 千円<br>1,116,887   | 0.6       | -               | 0.2       | 0.3       | 0.0      |  |
| ユ ー ロ   | 千ユーロ                    | 千ユーロ                    | 千円                |           |                 |           |           |          |  |
| アイルランド  | 11,360                  | 12,568                  | 1,577,178         | 0.8       | -               | 0.5       | 0.1       | 0.1      |  |
| オランダ    | 26,590                  | 31,424                  | 3,943,507         | 2.0       | -               | 1.2       | 0.7       | 0.1      |  |
| ベルギー    | 32,330                  | 38,532                  | 4,835,485         | 2.4       | -               | 1.8       | 0.5       | 0.1      |  |
| フランス    | 133,920                 | 156,515                 | 19,641,123        | 9.9       | -               | 6.3       | 2.6       | 1.0      |  |
| ドイツ     | 88,160                  | 104,329                 | 13,092,260        | 6.6       | -               | 3.7       | 2.0       | 0.9      |  |
| スペイン    | 75,970                  | 88,720                  | 11,133,550        | 5.6       | -               | 3.7       | 1.4       | 0.5      |  |
| イタリア    | 127,670                 | 135,633                 | 17,020,656        | 8.6       | -               | 5.1       | 2.8       | 0.8      |  |
| フィンランド  | 9,470                   | 10,384                  | 1,303,175         | 0.7       | -               | 0.4       | 0.2       | 0.1      |  |
| オーストリア  | 19,070                  | 23,005                  | 2,886,920         | 1.5       | -               | 0.9       | 0.4       | 0.1      |  |
| 合 計     | -                       | -                       | 千円<br>193,881,281 | 98.1      | -               | 52.1      | 31.4      | 14.6     |  |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘柄                      | 当 期  |        |          |           | 末           |            | 償還年月日 |
|-------------------------|------|--------|----------|-----------|-------------|------------|-------|
|                         | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額  | 評 価 額     |             |            |       |
|                         |      |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |       |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |       |
| US T N/B 2.125 01/31/21 | 国債証券 | 2.1250 | 5,000    | 4,963     | 549,409     | 2021/01/31 |       |
| US T N/B 2.25 01/31/24  | 国債証券 | 2.2500 | 350      | 346       | 38,324      | 2024/01/31 |       |
| US T N/B 1.375 01/31/21 | 国債証券 | 1.3750 | 2,750    | 2,690     | 297,858     | 2021/01/31 |       |
| US T N/B 1.75 01/31/23  | 国債証券 | 1.7500 | 8,570    | 8,334     | 922,676     | 2023/01/31 |       |
| US T N/B 2.5 01/15/22   | 国債証券 | 2.5000 | 3,850    | 3,852     | 426,476     | 2022/01/15 |       |
| US T N/B 1.25 01/31/20  | 国債証券 | 1.2500 | 10,800   | 10,673    | 1,181,548   | 2020/01/31 |       |
| US T N/B 6.0 02/15/26   | 国債証券 | 6.0000 | 2,360    | 2,875     | 318,327     | 2026/02/15 |       |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 国債証券 | 3.1250 | 1,800    | 1,850     | 204,895     | 2042/02/15 |       |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 国債証券 | 3.1250 | 2,600    | 2,666     | 295,127     | 2043/02/15 |       |
| US T N/B 2.5 02/15/46   | 国債証券 | 2.5000 | 4,460    | 4,053     | 448,669     | 2046/02/15 |       |
| US T N/B 3.5 02/15/39   | 国債証券 | 3.5000 | 1,300    | 1,428     | 158,142     | 2039/02/15 |       |
| US T N/B 5.25 02/15/29  | 国債証券 | 5.2500 | 1,000    | 1,225     | 135,607     | 2029/02/15 |       |
| US T N/B 5.375 02/15/31 | 国債証券 | 5.3750 | 1,500    | 1,908     | 211,285     | 2031/02/15 |       |
| US T N/B 4.5 02/15/36   | 国債証券 | 4.5000 | 1,230    | 1,521     | 168,391     | 2036/02/15 |       |
| US T N/B 4.75 02/15/41  | 国債証券 | 4.7500 | 1,800    | 2,334     | 258,398     | 2041/02/15 |       |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 国債証券 | 3.6250 | 4,510    | 5,020     | 555,772     | 2044/02/15 |       |
| US T N/B 2.0 02/15/22   | 国債証券 | 2.0000 | 11,050   | 10,901    | 1,206,794   | 2022/02/15 |       |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 国債証券 | 4.3750 | 750      | 923       | 102,217     | 2038/02/15 |       |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 国債証券 | 4.6250 | 2,300    | 2,929     | 324,268     | 2040/02/15 |       |
| US T N/B 1.625 02/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 5,500    | 5,170     | 572,410     | 2026/02/15 |       |
| US T N/B 2.5 02/15/45   | 国債証券 | 2.5000 | 4,500    | 4,099     | 453,819     | 2045/02/15 |       |
| US T N/B 3.625 02/15/20 | 国債証券 | 3.6250 | 15,300   | 15,460    | 1,711,426   | 2020/02/15 |       |
| US T N/B 3.0 02/15/47   | 国債証券 | 3.0000 | 4,430    | 4,441     | 491,700     | 2047/02/15 |       |
| US T N/B 3.0 02/15/48   | 国債証券 | 3.0000 | 4,020    | 4,019     | 444,907     | 2048/02/15 |       |
| US T N/B 2.75 02/15/24  | 国債証券 | 2.7500 | 8,040    | 8,139     | 901,082     | 2024/02/15 |       |
| US T N/B 2.0 02/15/25   | 国債証券 | 2.0000 | 9,500    | 9,220     | 1,020,668   | 2025/02/15 |       |
| US T N/B 3.625 02/15/21 | 国債証券 | 3.6250 | 5,500    | 5,619     | 622,092     | 2021/02/15 |       |
| US T N/B 2.75 02/15/28  | 国債証券 | 2.7500 | 5,950    | 6,005     | 664,783     | 2028/02/15 |       |
| US T N/B 2.0 02/15/23   | 国債証券 | 2.0000 | 9,500    | 9,329     | 1,032,751   | 2023/02/15 |       |
| US T N/B 2.25 02/15/27  | 国債証券 | 2.2500 | 7,040    | 6,866     | 760,086     | 2027/02/15 |       |
| US T N/B 2.125 02/29/24 | 国債証券 | 2.1250 | 1,300    | 1,277     | 141,469     | 2024/02/29 |       |
| US T N/B 2.75 02/28/25  | 国債証券 | 2.7500 | 5,810    | 5,881     | 651,052     | 2025/02/28 |       |
| US T N/B 1.875 02/28/22 | 国債証券 | 1.8750 | 1,680    | 1,650     | 182,749     | 2022/02/28 |       |
| US T N/B 1.125 02/28/21 | 国債証券 | 1.1250 | 3,680    | 3,580     | 396,315     | 2021/02/28 |       |
| US T N/B 1.75 03/31/22  | 国債証券 | 1.7500 | 10,660   | 10,433    | 1,154,985   | 2022/03/31 |       |
| US T N/B 2.25 03/31/21  | 国債証券 | 2.2500 | 9,760    | 9,710     | 1,074,943   | 2021/03/31 |       |
| US T N/B 2.625 03/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 4,080    | 4,100     | 453,945     | 2025/03/31 |       |
| US T N/B 1.375 03/31/20 | 国債証券 | 1.3750 | 6,300    | 6,220     | 688,608     | 2020/03/31 |       |
| US T N/B 2.5 03/31/23   | 国債証券 | 2.5000 | 1,020    | 1,020     | 113,009     | 2023/03/31 |       |
| US T N/B 1.375 04/30/20 | 国債証券 | 1.3750 | 12,000   | 11,840    | 1,310,745   | 2020/04/30 |       |
| US T N/B 1.375 04/30/21 | 国債証券 | 1.3750 | 11,210   | 10,944    | 1,211,511   | 2021/04/30 |       |
| US T N/B 2.75 04/30/23  | 国債証券 | 2.7500 | 2,490    | 2,516     | 278,570     | 2023/04/30 |       |
| US T N/B 6.25 05/15/30  | 国債証券 | 6.2500 | 1,400    | 1,880     | 208,204     | 2030/05/15 |       |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 国債証券 | 4.3750 | 2,000    | 2,467     | 273,116     | 2040/05/15 |       |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 国債証券 | 4.3750 | 1,700    | 2,101     | 232,634     | 2041/05/15 |       |

| 銘柄                      | 当    |        |          | 期        |           | 末          |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|
|                         | 種類   | 利率     | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| US T N/B 3.0 05/15/42   | 国債証券 | 3.0000 | 980      | 985      | 109,129   | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.25 05/15/39  | 国債証券 | 4.2500 | 810      | 982      | 108,756   | 2039/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 国債証券 | 2.8750 | 3,880    | 3,808    | 421,630   | 2043/05/15 |
| US T N/B 3.5 05/15/20   | 国債証券 | 3.5000 | 14,000   | 14,159   | 1,567,467 | 2020/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 国債証券 | 3.3750 | 3,910    | 4,180    | 462,793   | 2044/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/45   | 国債証券 | 3.0000 | 4,440    | 4,454    | 493,120   | 2045/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/47   | 国債証券 | 3.0000 | 3,380    | 3,385    | 374,805   | 2047/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/46   | 国債証券 | 2.5000 | 4,400    | 3,995    | 442,249   | 2046/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/48 | 国債証券 | 3.1250 | 4,350    | 4,455    | 493,241   | 2048/05/15 |
| US T N/B 1.75 05/15/22  | 国債証券 | 1.7500 | 10,570   | 10,333   | 1,143,947 | 2022/05/15 |
| US T N/B 1.375 05/31/20 | 国債証券 | 1.3750 | 3,500    | 3,449    | 381,816   | 2020/05/31 |
| US T N/B 4.5 05/15/38   | 国債証券 | 4.5000 | 800      | 1,000    | 110,789   | 2038/05/15 |
| US T N/B 1.75 05/15/23  | 国債証券 | 1.7500 | 7,000    | 6,796    | 752,373   | 2023/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/24   | 国債証券 | 2.5000 | 9,000    | 9,002    | 996,608   | 2024/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/21 | 国債証券 | 3.1250 | 8,000    | 8,109    | 897,670   | 2021/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | 国債証券 | 2.1250 | 8,930    | 8,714    | 964,677   | 2025/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 7,120    | 7,254    | 803,080   | 2028/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 国債証券 | 2.3750 | 6,330    | 6,225    | 689,119   | 2027/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/37   | 国債証券 | 5.0000 | 800      | 1,054    | 116,746   | 2037/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 7,330    | 6,874    | 761,033   | 2026/05/15 |
| US T N/B 2.0 05/31/21   | 国債証券 | 2.0000 | 12,000   | 11,871   | 1,314,119 | 2021/05/31 |
| US T N/B 1.625 05/31/23 | 国債証券 | 1.6250 | 5,300    | 5,117    | 566,538   | 2023/05/31 |
| US T N/B 2.0 05/31/24   | 国債証券 | 2.0000 | 6,180    | 6,029    | 667,474   | 2024/05/31 |
| US T N/B 2.75 05/31/23  | 国債証券 | 2.7500 | 3,270    | 3,305    | 365,945   | 2023/05/31 |
| US T N/B 2.875 05/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 2,530    | 2,578    | 285,451   | 2025/05/31 |
| US T N/B 1.375 06/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 7,000    | 6,682    | 739,781   | 2023/06/30 |
| US T N/B 1.875 06/30/20 | 国債証券 | 1.8750 | 11,000   | 10,902   | 1,206,947 | 2020/06/30 |
| US T N/B 2.125 06/30/22 | 国債証券 | 2.1250 | 9,500    | 9,393    | 1,039,892 | 2022/06/30 |
| US T N/B 2.75 06/30/25  | 国債証券 | 2.7500 | 790      | 799      | 88,511    | 2025/06/30 |
| US T N/B 2.625 06/30/23 | 国債証券 | 2.6250 | 1,820    | 1,830    | 202,668   | 2023/06/30 |
| US T N/B 2.875 07/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 3,390    | 3,455    | 382,542   | 2025/07/31 |
| US T N/B 2.75 07/31/23  | 国債証券 | 2.7500 | 6,500    | 6,574    | 727,752   | 2023/07/31 |
| US T N/B 6.25 08/15/23  | 国債証券 | 6.2500 | 1,000    | 1,158    | 128,233   | 2023/08/15 |
| US T N/B 3.75 08/15/41  | 国債証券 | 3.7500 | 2,000    | 2,265    | 250,837   | 2041/08/15 |
| US T N/B 5.5 08/15/28   | 国債証券 | 5.5000 | 1,100    | 1,360    | 150,651   | 2028/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 国債証券 | 3.8750 | 1,430    | 1,649    | 182,639   | 2040/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/42  | 国債証券 | 2.7500 | 1,800    | 1,732    | 191,801   | 2042/08/15 |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 国債証券 | 3.1250 | 4,600    | 4,715    | 521,986   | 2044/08/15 |
| US T N/B 4.5 08/15/39   | 国債証券 | 4.5000 | 1,400    | 1,753    | 194,123   | 2039/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | 3,700    | 4,115    | 455,636   | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | 4,400    | 4,306    | 476,763   | 2045/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/25   | 国債証券 | 2.0000 | 6,920    | 6,692    | 740,902   | 2025/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/47  | 国債証券 | 2.7500 | 4,420    | 4,209    | 465,974   | 2047/08/15 |
| US T N/B 2.125 08/15/21 | 国債証券 | 2.1250 | 11,000   | 10,906   | 1,207,325 | 2021/08/15 |
| US T N/B 2.5 08/15/23   | 国債証券 | 2.5000 | 8,000    | 8,007    | 886,423   | 2023/08/15 |
| US T N/B 2.375 08/15/24 | 国債証券 | 2.3750 | 8,900    | 8,838    | 978,451   | 2024/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/46  | 国債証券 | 2.2500 | 4,070    | 3,500    | 387,503   | 2046/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/48   | 国債証券 | 3.0000 | 4,770    | 4,769    | 527,996   | 2048/08/15 |

| 銘柄                      | 当    |        |          | 期        |           | 末          |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|
|                         | 種類   | 利率     | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| US T N/B 2.25 08/15/27  | 国債証券 | 2.2500 | 6,750    | 6,562    | 726,437   | 2027/08/15 |
| US T N/B 2.625 08/15/20 | 国債証券 | 2.6250 | 16,500   | 16,519   | 1,828,760 | 2020/08/15 |
| US T N/B 1.5 08/15/26   | 国債証券 | 1.5000 | 7,000    | 6,486    | 718,107   | 2026/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 5,730    | 5,837    | 646,204   | 2028/08/15 |
| US T N/B 1.625 08/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 9,500    | 9,231    | 1,021,898 | 2022/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/31/25  | 国債証券 | 2.7500 | 1,640    | 1,659    | 183,688   | 2025/08/31 |
| US T N/B 2.125 08/31/20 | 国債証券 | 2.1250 | 3,000    | 2,981    | 330,024   | 2020/08/31 |
| US T N/B 1.875 08/31/22 | 国債証券 | 1.8750 | 8,450    | 8,279    | 916,557   | 2022/08/31 |
| US T N/B 1.875 08/31/24 | 国債証券 | 1.8750 | 5,760    | 5,575    | 617,253   | 2024/08/31 |
| US T N/B 2.75 08/31/23  | 国債証券 | 2.7500 | 2,170    | 2,195    | 243,070   | 2023/08/31 |
| US T N/B 2.625 08/31/20 | 国債証券 | 2.6250 | 9,250    | 9,262    | 1,025,367 | 2020/08/31 |
| US T N/B 3.0 09/30/25   | 国債証券 | 3.0000 | 1,410    | 1,448    | 160,316   | 2025/09/30 |
| US T N/B 2.125 09/30/21 | 国債証券 | 2.1250 | 10,000   | 9,911    | 1,097,225 | 2021/09/30 |
| US T N/B 2.125 09/30/24 | 国債証券 | 2.1250 | 5,710    | 5,594    | 619,353   | 2024/09/30 |
| US T N/B 1.375 09/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 5,900    | 5,618    | 621,949   | 2023/09/30 |
| US T N/B 1.75 09/30/22  | 国債証券 | 1.7500 | 10,230   | 9,974    | 1,104,228 | 2022/09/30 |
| US T N/B 2.0 09/30/20   | 国債証券 | 2.0000 | 6,000    | 5,950    | 658,746   | 2020/09/30 |
| US T N/B 2.875 09/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 840      | 854      | 94,571    | 2023/09/30 |
| US T N/B 1.75 10/31/20  | 国債証券 | 1.7500 | 6,000    | 5,922    | 655,585   | 2020/10/31 |
| US T N/B 3.0 10/31/25   | 国債証券 | 3.0000 | 4,480    | 4,601    | 509,375   | 2025/10/31 |
| US T N/B 2.875 10/31/23 | 国債証券 | 2.8750 | 6,010    | 6,113    | 676,790   | 2023/10/31 |
| US T N/B 8.0 11/15/21   | 国債証券 | 8.0000 | 6,000    | 6,865    | 760,010   | 2021/11/15 |
| US T N/B 5.25 11/15/28  | 国債証券 | 5.2500 | 1,500    | 1,830    | 202,645   | 2028/11/15 |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 国債証券 | 6.1250 | 1,400    | 1,779    | 196,981   | 2027/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/44   | 国債証券 | 3.0000 | 3,760    | 3,770    | 417,401   | 2044/11/15 |
| US T N/B 4.25 11/15/40  | 国債証券 | 4.2500 | 2,000    | 2,428    | 268,843   | 2040/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/42  | 国債証券 | 2.7500 | 3,190    | 3,067    | 339,530   | 2042/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 1,800    | 1,851    | 204,988   | 2041/11/15 |
| US T N/B 3.75 11/15/43  | 国債証券 | 3.7500 | 4,120    | 4,674    | 517,472   | 2043/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/47  | 国債証券 | 2.7500 | 3,360    | 3,196    | 353,875   | 2047/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/45   | 国債証券 | 3.0000 | 3,900    | 3,910    | 432,943   | 2045/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 4,400    | 4,304    | 476,500   | 2046/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/24  | 国債証券 | 2.2500 | 8,590    | 8,466    | 937,238   | 2024/11/15 |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 1,470    | 1,812    | 200,651   | 2039/11/15 |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 国債証券 | 3.3750 | 5,270    | 5,666    | 627,277   | 2048/11/15 |
| US T N/B 2.625 11/15/20 | 国債証券 | 2.6250 | 6,000    | 6,009    | 665,209   | 2020/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/21   | 国債証券 | 2.0000 | 10,400   | 10,272   | 1,137,199 | 2021/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/25  | 国債証券 | 2.2500 | 7,000    | 6,868    | 760,308   | 2025/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 国債証券 | 3.1250 | 5,830    | 6,065    | 671,396   | 2028/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/30/20   | 国債証券 | 2.0000 | 7,920    | 7,847    | 868,721   | 2020/11/30 |
| US T N/B 1.625 11/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 9,420    | 9,134    | 1,011,218 | 2022/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/23  | 国債証券 | 2.7500 | 9,370    | 9,481    | 1,049,571 | 2023/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/26   | 国債証券 | 2.0000 | 7,000    | 6,712    | 743,113   | 2026/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/30/22   | 国債証券 | 2.0000 | 6,590    | 6,477    | 717,031   | 2022/11/30 |
| US T N/B 2.25 11/15/27  | 国債証券 | 2.2500 | 7,610    | 7,387    | 817,743   | 2027/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/30/25 | 国債証券 | 2.8750 | 3,480    | 3,548    | 392,848   | 2025/11/30 |
| US T N/B 2.875 11/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 5,640    | 5,742    | 635,661   | 2023/11/30 |
| US T N/B 1.625 11/30/20 | 国債証券 | 1.6250 | 8,510    | 8,377    | 927,408   | 2020/11/30 |

| 銘柄                       | 当    |        |             |             | 期          |            | 末 |
|--------------------------|------|--------|-------------|-------------|------------|------------|---|
|                          | 種類   | 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     |            |   |
| <b>(アメリカ)</b>            |      | %      | 千アメリカ・ドル    | 千アメリカ・ドル    | 千円         |            |   |
| US T N/B 2.875 11/15/21  | 国債証券 | 2.8750 | 4,880       | 4,930       | 545,807    | 2021/11/15 |   |
| US T N/B 2.75 11/30/20   | 国債証券 | 2.7500 | 7,840       | 7,871       | 871,376    | 2020/11/30 |   |
| US T N/B 2.25 12/31/23   | 国債証券 | 2.2500 | 5,860       | 5,798       | 641,910    | 2023/12/31 |   |
| US T N/B 2.625 12/31/23  | 国債証券 | 2.6250 | 3,060       | 3,080       | 340,964    | 2023/12/31 |   |
| US T N/B 2.625 12/31/25  | 国債証券 | 2.6250 | 2,290       | 2,300       | 254,651    | 2025/12/31 |   |
| US T N/B 2.375 12/31/20  | 国債証券 | 2.3750 | 8,300       | 8,277       | 916,365    | 2020/12/31 |   |
| US T N/B 2.125 12/31/21  | 国債証券 | 2.1250 | 10,330      | 10,231      | 1,132,621  | 2021/12/31 |   |
| US T N/B 2.125 12/31/22  | 国債証券 | 2.1250 | 8,000       | 7,896       | 874,113    | 2022/12/31 |   |
| US T N/B 1.75 12/31/20   | 国債証券 | 1.7500 | 9,000       | 8,876       | 982,670    | 2020/12/31 |   |
| US T N/B 2.625 12/15/21  | 国債証券 | 2.6250 | 3,770       | 3,785       | 419,079    | 2021/12/15 |   |
| 小計                       | —    | —      | 811,860     | 813,428     | 90,046,589 | —          |   |
| <b>(カナダ)</b>             |      | %      | 千カナダ・ドル     | 千カナダ・ドル     | 千円         |            |   |
| CANADA 0.75 03/01/21     | 国債証券 | 0.7500 | 2,300       | 2,253       | 189,423    | 2021/03/01 |   |
| CANADA 2.25 03/01/24     | 国債証券 | 2.2500 | 530         | 541         | 45,502     | 2024/03/01 |   |
| CANADA 1.75 03/01/23     | 国債証券 | 1.7500 | 1,160       | 1,157       | 97,324     | 2023/03/01 |   |
| CANADA 1.75 05/01/20     | 国債証券 | 1.7500 | 2,770       | 2,769       | 232,739    | 2020/05/01 |   |
| CANADA 1.5 06/01/26      | 国債証券 | 1.5000 | 1,700       | 1,658       | 139,411    | 2026/06/01 |   |
| CANADA 8.0 06/01/27      | 国債証券 | 8.0000 | 1,000       | 1,465       | 123,141    | 2027/06/01 |   |
| CANADA 5.75 06/01/29     | 国債証券 | 5.7500 | 1,600       | 2,166       | 182,098    | 2029/06/01 |   |
| CANADA 5.75 06/01/33     | 国債証券 | 5.7500 | 1,260       | 1,840       | 154,724    | 2033/06/01 |   |
| CANADA 5.0 06/01/37      | 国債証券 | 5.0000 | 1,400       | 2,010       | 168,970    | 2037/06/01 |   |
| CANADA 2.5 06/01/24      | 国債証券 | 2.5000 | 1,600       | 1,655       | 139,142    | 2024/06/01 |   |
| CANADA 4.0 06/01/41      | 国債証券 | 4.0000 | 1,400       | 1,853       | 155,789    | 2041/06/01 |   |
| CANADA 3.25 06/01/21     | 国債証券 | 3.2500 | 4,700       | 4,853       | 407,968    | 2021/06/01 |   |
| CANADA 2.75 06/01/22     | 国債証券 | 2.7500 | 3,230       | 3,328       | 279,780    | 2022/06/01 |   |
| CANADA 1.5 06/01/23      | 国債証券 | 1.5000 | 2,300       | 2,272       | 190,968    | 2023/06/01 |   |
| CANADA 2.0 06/01/28      | 国債証券 | 2.0000 | 1,020       | 1,028       | 86,484     | 2028/06/01 |   |
| CANADA 2.25 06/01/25     | 国債証券 | 2.2500 | 1,500       | 1,536       | 129,138    | 2025/06/01 |   |
| CANADA 1.0 06/01/27      | 国債証券 | 1.0000 | 800         | 746         | 62,730     | 2027/06/01 |   |
| CANADA 2.25 06/01/29     | 国債証券 | 2.2500 | 610         | 628         | 52,863     | 2029/06/01 |   |
| CANADA 3.5 06/01/20      | 国債証券 | 3.5000 | 2,800       | 2,860       | 240,418    | 2020/06/01 |   |
| CANADA 0.75 09/01/21     | 国債証券 | 0.7500 | 600         | 584         | 49,157     | 2021/09/01 |   |
| CANADA 0.75 09/01/20     | 国債証券 | 0.7500 | 2,400       | 2,363       | 198,655    | 2020/09/01 |   |
| CANADA 2.0 09/01/23      | 国債証券 | 2.0000 | 740         | 746         | 62,746     | 2023/09/01 |   |
| CANADA 1.0 09/01/22      | 国債証券 | 1.0000 | 800         | 778         | 65,426     | 2022/09/01 |   |
| CANADA 3.5 12/01/45      | 国債証券 | 3.5000 | 1,720       | 2,184       | 183,598    | 2045/12/01 |   |
| CANADA 2.75 12/01/48     | 国債証券 | 2.7500 | 1,450       | 1,640       | 137,910    | 2048/12/01 |   |
| CANADA 2.0 12/01/51      | 国債証券 | 2.0000 | 250         | 241         | 20,287     | 2051/12/01 |   |
| CANADA 2.75 12/01/64     | 国債証券 | 2.7500 | 680         | 805         | 67,730     | 2064/12/01 |   |
| 小計                       | —    | —      | 42,320      | 45,974      | 3,864,133  | —          |   |
| <b>(オーストラリア)</b>         |      | %      | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円         |            |   |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47  | 国債証券 | 3.0000 | 1,250       | 1,337       | 106,517    | 2047/03/21 |   |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 | 国債証券 | 3.2500 | 3,100       | 3,355       | 267,224    | 2025/04/21 |   |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 2,950       | 3,559       | 283,443    | 2027/04/21 |   |
| AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 国債証券 | 2.7500 | 3,100       | 3,255       | 259,294    | 2024/04/21 |   |
| AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 国債証券 | 4.2500 | 3,600       | 4,158       | 331,180    | 2026/04/21 |   |
| AUSTRALIAN 5.5 04/21/23  | 国債証券 | 5.5000 | 3,000       | 3,462       | 275,761    | 2023/04/21 |   |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 3,100       | 3,424       | 272,705    | 2029/04/21 |   |



| 銘柄                        | 当    |        |             | 期           |           |            | 末 |
|---------------------------|------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|---|
|                           | 種類   | 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    |            |   |
| <b>(オーストラリア)</b>          |      | %      | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円        |            |   |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33   | 国債証券 | 4.5000 | 1,500       | 1,909       | 152,041   | 2033/04/21 |   |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37  | 国債証券 | 3.7500 | 1,200       | 1,430       | 113,934   | 2037/04/21 |   |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28  | 国債証券 | 2.2500 | 2,570       | 2,602       | 207,294   | 2028/05/21 |   |
| AUSTRALIAN 5.75 05/15/21  | 国債証券 | 5.7500 | 3,700       | 4,025       | 320,557   | 2021/05/15 |   |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30   | 国債証券 | 2.5000 | 830         | 860         | 68,539    | 2030/05/21 |   |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39  | 国債証券 | 3.2500 | 900         | 1,005       | 80,113    | 2039/06/21 |   |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35  | 国債証券 | 2.7500 | 900         | 946         | 75,403    | 2035/06/21 |   |
| AUSTRALIAN 5.75 07/15/22  | 国債証券 | 5.7500 | 3,500       | 3,972       | 316,403   | 2022/07/15 |   |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28  | 国債証券 | 2.7500 | 2,700       | 2,853       | 227,265   | 2028/11/21 |   |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27  | 国債証券 | 2.7500 | 2,900       | 3,056       | 243,413   | 2027/11/21 |   |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29  | 国債証券 | 2.7500 | 1,560       | 1,654       | 131,746   | 2029/11/21 |   |
| AUSTRALIAN 1.75 11/21/20  | 国債証券 | 1.7500 | 2,150       | 2,150       | 171,234   | 2020/11/21 |   |
| AUSTRALIAN 2.25 11/21/22  | 国債証券 | 2.2500 | 890         | 909         | 72,429    | 2022/11/21 |   |
| AUSTRALIAN 2.0 12/21/21   | 国債証券 | 2.0000 | 1,770       | 1,786       | 142,310   | 2021/12/21 |   |
| 小計                        | —    | —      | 47,170      | 51,717      | 4,118,815 | —          |   |
| <b>(シンガポール)</b>           |      | %      | 千シンガポール・ドル  | 千シンガポール・ドル  | 千円        |            |   |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27    | 国債証券 | 3.5000 | 900         | 994         | 81,432    | 2027/03/01 |   |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46   | 国債証券 | 2.7500 | 660         | 685         | 56,196    | 2046/03/01 |   |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42   | 国債証券 | 2.7500 | 550         | 575         | 47,106    | 2042/04/01 |   |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25  | 国債証券 | 2.3750 | 500         | 510         | 41,820    | 2025/06/01 |   |
| SINGAPORE 2.125 06/01/26  | 国債証券 | 2.1250 | 210         | 211         | 17,289    | 2026/06/01 |   |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29  | 国債証券 | 2.8750 | 400         | 427         | 34,996    | 2029/07/01 |   |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36   | 国債証券 | 2.2500 | 200         | 195         | 16,012    | 2036/08/01 |   |
| SINGAPORE 3.0 09/01/24    | 国債証券 | 3.0000 | 810         | 852         | 69,858    | 2024/09/01 |   |
| SINGAPORE 3.125 09/01/22  | 国債証券 | 3.1250 | 1,600       | 1,664       | 136,341   | 2022/09/01 |   |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30  | 国債証券 | 2.8750 | 460         | 490         | 40,189    | 2030/09/01 |   |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33  | 国債証券 | 3.3750 | 480         | 540         | 44,243    | 2033/09/01 |   |
| SINGAPORE 1.25 10/01/21   | 国債証券 | 1.2500 | 1,000       | 983         | 80,527    | 2021/10/01 |   |
| 小計                        | —    | —      | 7,770       | 8,130       | 666,012   | —          |   |
| <b>(イギリス)</b>             |      | %      | 千イギリス・ポンド   | 千イギリス・ポンド   | 千円        |            |   |
| UK TREASURY 3.25 01/22/44 | 国債証券 | 3.2500 | 2,460       | 3,228       | 466,028   | 2044/01/22 |   |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45  | 国債証券 | 3.5000 | 2,300       | 3,158       | 456,038   | 2045/01/22 |   |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60  | 国債証券 | 4.0000 | 1,530       | 2,627       | 379,327   | 2060/01/22 |   |
| UK TREASURY 1.75 01/22/49 | 国債証券 | 1.7500 | 620         | 626         | 90,511    | 2049/01/22 |   |
| UK TREASURY 1.5 01/22/21  | 国債証券 | 1.5000 | 2,700       | 2,738       | 395,412   | 2021/01/22 |   |
| UK TREASURY 5.0 03/07/25  | 国債証券 | 5.0000 | 2,030       | 2,518       | 363,537   | 2025/03/07 |   |
| UK TREASURY 4.0 03/07/22  | 国債証券 | 4.0000 | 1,040       | 1,141       | 164,776   | 2022/03/07 |   |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 国債証券 | 4.2500 | 2,100       | 2,943       | 424,932   | 2036/03/07 |   |
| UK TREASURY 1.0 04/22/24  | 国債証券 | 1.0000 | 580         | 583         | 84,174    | 2024/04/22 |   |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 国債証券 | 4.2500 | 1,850       | 2,487       | 359,095   | 2032/06/07 |   |
| UK TREASURY 8.0 06/07/21  | 国債証券 | 8.0000 | 1,700       | 1,981       | 286,076   | 2021/06/07 |   |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47  | 国債証券 | 1.5000 | 2,400       | 2,291       | 330,757   | 2047/07/22 |   |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 国債証券 | 3.7500 | 1,630       | 2,509       | 362,326   | 2052/07/22 |   |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57 | 国債証券 | 1.7500 | 1,730       | 1,794       | 259,101   | 2057/07/22 |   |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65  | 国債証券 | 2.5000 | 1,890       | 2,446       | 353,164   | 2065/07/22 |   |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68  | 国債証券 | 3.5000 | 1,720       | 2,830       | 408,654   | 2068/07/22 |   |
| UK TREASURY 1.5 07/22/26  | 国債証券 | 1.5000 | 1,970       | 2,042       | 294,914   | 2026/07/22 |   |
| UK TREASURY 1.25 07/22/27 | 国債証券 | 1.2500 | 2,320       | 2,351       | 339,463   | 2027/07/22 |   |

| 銘柄                         | 当    |        |              | 期            |            | 末          |
|----------------------------|------|--------|--------------|--------------|------------|------------|
|                            | 種類   | 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     |            |
| <b>(イギリス)</b>              |      | %      | 千イギリス・ポンド    | 千イギリス・ポンド    | 千円         |            |
| UK TREASURY 2.0 07/22/20   | 国債証券 | 2.0000 | 1,820        | 1,852        | 267,440    | 2020/07/22 |
| UK TREASURY 0.5 07/22/22   | 国債証券 | 0.5000 | 2,350        | 2,328        | 336,229    | 2022/07/22 |
| UK TREASURY 0.75 07/22/23  | 国債証券 | 0.7500 | 1,560        | 1,554        | 224,399    | 2023/07/22 |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39  | 国債証券 | 4.2500 | 1,550        | 2,255        | 325,612    | 2039/09/07 |
| UK TREASURY 3.75 09/07/21  | 国債証券 | 3.7500 | 1,850        | 1,990        | 287,316    | 2021/09/07 |
| UK TREASURY 2.25 09/07/23  | 国債証券 | 2.2500 | 2,800        | 2,977        | 429,856    | 2023/09/07 |
| UK TREASURY 2.75 09/07/24  | 国債証券 | 2.7500 | 2,000        | 2,202        | 317,934    | 2024/09/07 |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25   | 国債証券 | 2.0000 | 1,110        | 1,186        | 171,290    | 2025/09/07 |
| UK TREASURY 3.75 09/07/20  | 国債証券 | 3.7500 | 2,900        | 3,033        | 437,944    | 2020/09/07 |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34   | 国債証券 | 4.5000 | 1,820        | 2,575        | 371,796    | 2034/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37  | 国債証券 | 1.7500 | 1,900        | 1,936        | 279,542    | 2037/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/22  | 国債証券 | 1.7500 | 3,000        | 3,101        | 447,718    | 2022/09/07 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/71 | 国債証券 | 1.6250 | 1,010        | 1,024        | 147,957    | 2071/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/28 | 国債証券 | 1.6250 | 1,790        | 1,862        | 268,937    | 2028/10/22 |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28   | 国債証券 | 6.0000 | 1,050        | 1,519        | 219,395    | 2028/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38  | 国債証券 | 4.7500 | 1,610        | 2,467        | 356,161    | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42   | 国債証券 | 4.5000 | 1,820        | 2,826        | 408,082    | 2042/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46  | 国債証券 | 4.2500 | 1,810        | 2,826        | 408,008    | 2046/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55  | 国債証券 | 4.2500 | 1,750        | 3,017        | 435,614    | 2055/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27  | 国債証券 | 4.2500 | 1,700        | 2,151        | 310,612    | 2027/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40  | 国債証券 | 4.2500 | 1,780        | 2,623        | 378,735    | 2040/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30  | 国債証券 | 4.7500 | 1,500        | 2,065        | 298,131    | 2030/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49  | 国債証券 | 4.2500 | 1,430        | 2,309        | 333,477    | 2049/12/07 |
| 小計                         | —    | —      | 74,480       | 91,989       | 13,280,489 | —          |
| <b>(デンマーク)</b>             |      | %      | 千デンマーク・クローネ  | 千デンマーク・クローネ  | 千円         |            |
| DENMARK 4.5 11/15/39       | 国債証券 | 4.5000 | 13,930       | 24,805       | 417,224    | 2039/11/15 |
| DENMARK 1.75 11/15/25      | 国債証券 | 1.7500 | 9,470        | 10,719       | 180,298    | 2025/11/15 |
| DENMARK 3.0 11/15/21       | 国債証券 | 3.0000 | 8,870        | 10,023       | 168,596    | 2021/11/15 |
| DENMARK 1.5 11/15/23       | 国債証券 | 1.5000 | 5,500        | 5,992        | 100,794    | 2023/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/27       | 国債証券 | 0.5000 | 7,130        | 7,433        | 125,029    | 2027/11/15 |
| 小計                         | —    | —      | 44,900       | 58,974       | 991,943    | —          |
| <b>(ノルウェー)</b>             |      | %      | 千ノルウェー・クローネ  | 千ノルウェー・クローネ  | 千円         |            |
| NORWAY 1.5 02/19/26        | 国債証券 | 1.5000 | 6,000        | 6,008        | 77,392     | 2026/02/19 |
| NORWAY 1.75 02/17/27       | 国債証券 | 1.7500 | 3,970        | 4,026        | 51,856     | 2027/02/17 |
| NORWAY 3.0 03/14/24        | 国債証券 | 3.0000 | 6,200        | 6,706        | 86,381     | 2024/03/14 |
| NORWAY 1.75 03/13/25       | 国債証券 | 1.7500 | 3,800        | 3,875        | 49,918     | 2025/03/13 |
| NORWAY 2.0 04/26/28        | 国債証券 | 2.0000 | 2,070        | 2,133        | 27,481     | 2028/04/26 |
| NORWAY 2.0 05/24/23        | 国債証券 | 2.0000 | 7,600        | 7,830        | 100,853    | 2023/05/24 |
| 小計                         | —    | —      | 29,640       | 30,580       | 393,883    | —          |
| <b>(スウェーデン)</b>            |      | %      | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円         |            |
| SWEDEN 3.5 03/30/39        | 国債証券 | 3.5000 | 4,600        | 6,683        | 79,397     | 2039/03/30 |
| SWEDEN 0.75 05/12/28       | 国債証券 | 0.7500 | 4,970        | 5,170        | 61,423     | 2028/05/12 |
| SWEDEN 2.5 05/12/25        | 国債証券 | 2.5000 | 7,300        | 8,435        | 100,218    | 2025/05/12 |
| SWEDEN 3.5 06/01/22        | 国債証券 | 3.5000 | 12,870       | 14,476       | 171,981    | 2022/06/01 |
| SWEDEN 1.5 11/13/23        | 国債証券 | 1.5000 | 9,700        | 10,468       | 124,363    | 2023/11/13 |
| SWEDEN 1.0 11/12/26        | 国債証券 | 1.0000 | 7,000        | 7,442        | 88,418     | 2026/11/12 |
| SWEDEN 0.75 11/12/29       | 国債証券 | 0.7500 | 2,170        | 2,231        | 26,515     | 2029/11/12 |
| 小計                         | —    | —      | 48,610       | 54,908       | 652,318    | —          |

| 銘柄                          | 当    |         |              | 期            |           | 末          |
|-----------------------------|------|---------|--------------|--------------|-----------|------------|
|                             | 種類   | 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    |            |
| <b>(メキシコ)</b>               |      | %       | 千メキシコ・ペソ     | 千メキシコ・ペソ     | 千円        |            |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 国債証券 | 5.7500  | 14,859       | 12,920       | 74,424    | 2026/03/05 |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29  | 国債証券 | 8.5000  | 31,000       | 31,279       | 180,172   | 2029/05/31 |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 国債証券 | 7.7500  | 10,000       | 9,437        | 54,361    | 2031/05/29 |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27  | 国債証券 | 7.5000  | 10,000       | 9,539        | 54,948    | 2027/06/03 |
| MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22  | 国債証券 | 6.5000  | 26,000       | 24,804       | 142,871   | 2022/06/09 |
| MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21  | 国債証券 | 6.5000  | 38,000       | 36,719       | 211,501   | 2021/06/10 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 国債証券 | 7.7500  | 22,000       | 19,852       | 114,350   | 2042/11/13 |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47  | 国債証券 | 8.0000  | 5,000        | 4,613        | 26,572    | 2047/11/07 |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38  | 国債証券 | 8.5000  | 15,000       | 14,697       | 84,659    | 2038/11/18 |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 国債証券 | 10.0000 | 13,000       | 14,579       | 83,977    | 2036/11/20 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 国債証券 | 7.7500  | 7,000        | 6,490        | 37,385    | 2034/11/23 |
| MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 国債証券 | 10.0000 | 35,000       | 38,012       | 218,949   | 2024/12/05 |
| MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23  | 国債証券 | 8.0000  | 14,000       | 13,935       | 80,267    | 2023/12/07 |
| MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21 | 国債証券 | 7.2500  | 10,880       | 10,641       | 61,297    | 2021/12/09 |
| 小計                          | -    | -       | 251,739      | 247,524      | 1,425,739 | -          |
| <b>(マレーシア)</b>              |      | %       | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円        |            |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27     | 国債証券 | 3.8920  | 800          | 794          | 21,609    | 2027/03/15 |
| MALAYSIA 3.48 03/15/23      | 国債証券 | 3.4800  | 1,220        | 1,208        | 32,882    | 2023/03/15 |
| MALAYSIA 3.492 03/31/20     | 国債証券 | 3.4920  | 2,200        | 2,201        | 59,897    | 2020/03/31 |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26     | 国債証券 | 4.3920  | 3,070        | 3,151        | 85,754    | 2026/04/15 |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30     | 国債証券 | 4.4980  | 1,800        | 1,858        | 50,574    | 2030/04/15 |
| MALAYSIA 4.127 04/15/32     | 国債証券 | 4.1270  | 1,850        | 1,826        | 49,699    | 2032/04/15 |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33     | 国債証券 | 3.8440  | 1,210        | 1,150        | 31,304    | 2033/04/15 |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27     | 国債証券 | 3.5020  | 2,570        | 2,477        | 67,412    | 2027/05/31 |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28     | 国債証券 | 3.7330  | 2,000        | 1,966        | 53,494    | 2028/06/15 |
| MALAYSIA 4.16 07/15/21      | 国債証券 | 4.1600  | 4,000        | 4,053        | 110,286   | 2021/07/15 |
| MALAYSIA 4.181 07/15/24     | 国債証券 | 4.1810  | 2,430        | 2,473        | 67,307    | 2024/07/15 |
| MALAYSIA 3.418 08/15/22     | 国債証券 | 3.4180  | 3,000        | 2,970        | 80,824    | 2022/08/15 |
| MALAYSIA 5.248 09/15/28     | 国債証券 | 5.2480  | 1,600        | 1,750        | 47,637    | 2028/09/15 |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43     | 国債証券 | 4.9350  | 2,000        | 2,065        | 56,212    | 2043/09/30 |
| 小計                          | -    | -       | 29,750       | 29,948       | 814,899   | -          |
| <b>(南アフリカ)</b>              |      | %       | 千南アフリカ・ランド   | 千南アフリカ・ランド   | 千円        |            |
| SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30   | 国債証券 | 8.0000  | 13,110       | 11,963       | 94,510    | 2030/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44  | 国債証券 | 8.7500  | 10,000       | 8,988        | 71,009    | 2044/01/31 |
| SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40   | 国債証券 | 9.0000  | 8,000        | 7,368        | 58,209    | 2040/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37   | 国債証券 | 8.5000  | 10,910       | 9,762        | 77,127    | 2037/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48  | 国債証券 | 8.7500  | 20,280       | 18,093       | 142,937   | 2048/02/28 |
| SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41   | 国債証券 | 6.5000  | 11,760       | 8,224        | 64,971    | 2041/02/28 |
| SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23  | 国債証券 | 7.7500  | 3,600        | 3,580        | 28,286    | 2023/02/28 |
| SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31   | 国債証券 | 7.0000  | 11,600       | 9,576        | 75,657    | 2031/02/28 |
| SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35 | 国債証券 | 8.8750  | 12,510       | 11,699       | 92,422    | 2035/02/28 |
| SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32  | 国債証券 | 8.2500  | 10,000       | 9,072        | 71,675    | 2032/03/31 |
| SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36  | 国債証券 | 6.2500  | 14,700       | 10,511       | 83,039    | 2036/03/31 |
| SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26  | 国債証券 | 10.5000 | 25,000       | 27,324       | 215,861   | 2026/12/21 |
| 小計                          | -    | -       | 151,470      | 136,165      | 1,075,710 | -          |
| <b>(ポーランド)</b>              |      | %       | 千ポーランド・ズロチ   | 千ポーランド・ズロチ   | 千円        |            |
| POLAND 2.5 01/25/23         | 国債証券 | 2.5000  | 1,350        | 1,380        | 40,018    | 2023/01/25 |
| POLAND 5.75 04/25/29        | 国債証券 | 5.7500  | 1,440        | 1,839        | 53,320    | 2029/04/25 |

| 銘柄                        | 当    |        |            | 期          |           | 末          |
|---------------------------|------|--------|------------|------------|-----------|------------|
|                           | 種類   | 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    |            |
| <b>(ポーランド)</b>            |      | %      | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円        |            |
| POLAND 2.75 04/25/28      | 国債証券 | 2.7500 | 1,900      | 1,910      | 55,393    | 2028/04/25 |
| POLAND 2.00 04/25/21      | 国債証券 | 2.0000 | 1,130      | 1,142      | 33,122    | 2021/04/25 |
| POLAND 2.25 04/25/22      | 国債証券 | 2.2500 | 4,000      | 4,061      | 117,738   | 2022/04/25 |
| POLAND 2.5 04/25/24       | 国債証券 | 2.5000 | 1,050      | 1,065      | 30,896    | 2024/04/25 |
| POLAND 2.5 07/25/26       | 国債証券 | 2.5000 | 4,200      | 4,203      | 121,845   | 2026/07/25 |
| POLAND 3.25 07/25/25      | 国債証券 | 3.2500 | 3,300      | 3,482      | 100,948   | 2025/07/25 |
| POLAND 2.5 07/25/27       | 国債証券 | 2.5000 | 3,000      | 2,988      | 86,636    | 2027/07/25 |
| POLAND 1.75 07/25/21      | 国債証券 | 1.7500 | 2,200      | 2,211      | 64,105    | 2021/07/25 |
| POLAND 5.75 09/23/22      | 国債証券 | 5.7500 | 3,200      | 3,629      | 105,223   | 2022/09/23 |
| POLAND 5.25 10/25/20      | 国債証券 | 5.2500 | 2,970      | 3,157      | 91,529    | 2020/10/25 |
| POLAND 5.75 10/25/21      | 国債証券 | 5.7500 | 3,680      | 4,079      | 118,273   | 2021/10/25 |
| POLAND 4.0 10/25/23       | 国債証券 | 4.0000 | 3,100      | 3,374      | 97,835    | 2023/10/25 |
| 小計                        | -    | -      | 36,520     | 38,526     | 1,116,887 | -          |
| <b>(ユーロ…アイルランド)</b>       |      | %      | 千ユーロ       | 千ユーロ       | 千円        |            |
| IRISH 2.0 02/18/45        | 国債証券 | 2.0000 | 870        | 950        | 119,254   | 2045/02/18 |
| IRISH 1.35 03/18/31       | 国債証券 | 1.3500 | 210        | 218        | 27,357    | 2031/03/18 |
| IRISH 3.4 03/18/24        | 国債証券 | 3.4000 | 930        | 1,088      | 136,548   | 2024/03/18 |
| IRISH 5.4 03/13/25        | 国債証券 | 5.4000 | 1,260      | 1,651      | 207,250   | 2025/03/13 |
| IRISH 3.9 03/20/23        | 国債証券 | 3.9000 | 700        | 815        | 102,318   | 2023/03/20 |
| IRISH 0.8 03/15/22        | 国債証券 | 0.8000 | 950        | 980        | 123,085   | 2022/03/15 |
| IRISH 4.5 04/18/20        | 国債証券 | 4.5000 | 1,130      | 1,195      | 150,028   | 2020/04/18 |
| IRISH 1.3 05/15/33        | 国債証券 | 1.3000 | 450        | 456        | 57,225    | 2033/05/15 |
| IRISH 2.4 05/15/30        | 国債証券 | 2.4000 | 1,100      | 1,273      | 159,760   | 2030/05/15 |
| IRISH 0.9 05/15/28        | 国債証券 | 0.9000 | 580        | 591        | 74,225    | 2028/05/15 |
| IRISH 1.1 05/15/29        | 国債証券 | 1.1000 | 340        | 348        | 43,788    | 2029/05/15 |
| IRISH 1.0 05/15/26        | 国債証券 | 1.0000 | 1,200      | 1,252      | 157,141   | 2026/05/15 |
| IRISH 1.7 05/15/37        | 国債証券 | 1.7000 | 570        | 598        | 75,095    | 2037/05/15 |
| IRISH 5.0 10/18/20        | 国債証券 | 5.0000 | 850        | 927        | 116,330   | 2020/10/18 |
| IRISH 10/18/22            | 国債証券 | -      | 220        | 221        | 27,767    | 2022/10/18 |
| 小計                        | -    | -      | 11,360     | 12,568     | 1,577,178 | -          |
| <b>(ユーロ…オランダ)</b>         |      | %      | 千ユーロ       | 千ユーロ       | 千円        |            |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 国債証券 | 3.7500 | 1,620      | 2,668      | 334,930   | 2042/01/15 |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 1,430      | 2,130      | 267,408   | 2047/01/15 |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/23 | 国債証券 | 3.7500 | 590        | 687        | 86,292    | 2023/01/15 |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28  | 国債証券 | 5.5000 | 1,350      | 1,998      | 250,729   | 2028/01/15 |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37  | 国債証券 | 4.0000 | 1,560      | 2,458      | 308,524   | 2037/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33  | 国債証券 | 2.5000 | 1,300      | 1,652      | 207,342   | 2033/01/15 |
| NETHERLANDS 01/15/22      | 国債証券 | -      | 2,310      | 2,342      | 294,018   | 2022/01/15 |
| NETHERLANDS 01/15/24      | 国債証券 | -      | 1,680      | 1,701      | 213,544   | 2024/01/15 |
| NETHERLANDS 3.5 07/15/20  | 国債証券 | 3.5000 | 1,670      | 1,765      | 221,561   | 2020/07/15 |
| NETHERLANDS 3.25 07/15/21 | 国債証券 | 3.2500 | 1,860      | 2,030      | 254,868   | 2021/07/15 |
| NETHERLANDS 1.75 07/15/23 | 国債証券 | 1.7500 | 2,000      | 2,186      | 274,333   | 2023/07/15 |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26  | 国債証券 | 0.5000 | 1,700      | 1,765      | 221,503   | 2026/07/15 |
| NETHERLANDS 2.25 07/15/22 | 国債証券 | 2.2500 | 1,550      | 1,694      | 212,583   | 2022/07/15 |
| NETHERLANDS 2.0 07/15/24  | 国債証券 | 2.0000 | 1,560      | 1,749      | 219,493   | 2024/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | 国債証券 | 0.2500 | 1,700      | 1,740      | 218,433   | 2025/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/28 | 国債証券 | 0.7500 | 1,260      | 1,323      | 166,145   | 2028/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | 国債証券 | 0.7500 | 1,450      | 1,528      | 191,793   | 2027/07/15 |
| 小計                        | -    | -      | 26,590     | 31,424     | 3,943,507 | -          |

| 銘柄                       | 当    |        |        | 期      |           | 末          |
|--------------------------|------|--------|--------|--------|-----------|------------|
|                          | 種類   | 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    |            |
| <b>(ユーロ…ベルギー)</b>        |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |            |
| BELGIUM 4.0 03/28/22     | 国債証券 | 4.0000 | 1,500  | 1,706  | 214,087   | 2022/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/28     | 国債証券 | 5.5000 | 2,270  | 3,288  | 412,699   | 2028/03/28 |
| BELGIUM 4.25 03/28/41    | 国債証券 | 4.2500 | 1,740  | 2,690  | 337,636   | 2041/03/28 |
| BELGIUM 4.5 03/28/26     | 国債証券 | 4.5000 | 1,200  | 1,565  | 196,439   | 2026/03/28 |
| BELGIUM 4.0 03/28/32     | 国債証券 | 4.0000 | 920    | 1,277  | 160,303   | 2032/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/35     | 国債証券 | 5.0000 | 1,980  | 3,118  | 391,382   | 2035/03/28 |
| BELGIUM 1.25 04/22/33    | 国債証券 | 1.2500 | 510    | 528    | 66,307    | 2033/04/22 |
| BELGIUM 3.75 06/22/45    | 国債証券 | 3.7500 | 990    | 1,475  | 185,111   | 2045/06/22 |
| BELGIUM 1.6 06/22/47     | 国債証券 | 1.6000 | 1,000  | 1,005  | 126,220   | 2047/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/57    | 国債証券 | 2.2500 | 380    | 424    | 53,282    | 2057/06/22 |
| BELGIUM 2.15 06/22/66    | 国債証券 | 2.1500 | 680    | 730    | 91,724    | 2066/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/26     | 国債証券 | 1.0000 | 1,500  | 1,582  | 198,619   | 2026/06/22 |
| BELGIUM 2.6 06/22/24     | 国債証券 | 2.6000 | 1,510  | 1,725  | 216,486   | 2024/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/31     | 国債証券 | 1.0000 | 1,140  | 1,162  | 145,906   | 2031/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/23    | 国債証券 | 2.2500 | 1,700  | 1,885  | 236,671   | 2023/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/28     | 国債証券 | 0.8000 | 1,260  | 1,291  | 162,052   | 2028/06/22 |
| BELGIUM 0.9 06/22/29     | 国債証券 | 0.9000 | 500    | 512    | 64,334    | 2029/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/34     | 国債証券 | 3.0000 | 720    | 918    | 115,199   | 2034/06/22 |
| BELGIUM 1.9 06/22/38     | 国債証券 | 1.9000 | 730    | 803    | 100,795   | 2038/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/25     | 国債証券 | 0.8000 | 1,570  | 1,640  | 205,828   | 2025/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/27     | 国債証券 | 0.8000 | 1,100  | 1,135  | 142,539   | 2027/06/22 |
| BELGIUM 1.45 06/22/37    | 国債証券 | 1.4500 | 440    | 452    | 56,841    | 2037/06/22 |
| BELGIUM 4.25 09/28/21    | 国債証券 | 4.2500 | 1,870  | 2,099  | 263,495   | 2021/09/28 |
| BELGIUM 3.75 09/28/20    | 国債証券 | 3.7500 | 2,200  | 2,350  | 294,925   | 2020/09/28 |
| BELGIUM 4.25 09/28/22    | 国債証券 | 4.2500 | 1,190  | 1,388  | 174,264   | 2022/09/28 |
| BELGIUM 0.5 10/22/24     | 国債証券 | 0.5000 | 1,070  | 1,100  | 138,097   | 2024/10/22 |
| BELGIUM 0.2 10/22/23     | 国債証券 | 0.2000 | 660    | 671    | 84,231    | 2023/10/22 |
| 小計                       | -    | -      | 32,330 | 38,532 | 4,835,485 | -          |
| <b>(ユーロ…フランス)</b>        |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |            |
| FRANCE OAT 02/25/21      | 国債証券 | -      | 1,370  | 1,382  | 173,497   | 2021/02/25 |
| FRANCE OAT 03/25/24      | 国債証券 | -      | 1,390  | 1,396  | 175,287   | 2024/03/25 |
| FRANCE OAT 03/25/23      | 国債証券 | -      | 1,900  | 1,918  | 240,741   | 2023/03/25 |
| FRANCE OAT 3.75 04/25/21 | 国債証券 | 3.7500 | 4,640  | 5,066  | 635,836   | 2021/04/25 |
| FRANCE BTAN 8.5 04/25/23 | 国債証券 | 8.5000 | 1,700  | 2,325  | 291,850   | 2023/04/25 |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26  | 国債証券 | 3.5000 | 3,810  | 4,729  | 593,486   | 2026/04/25 |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41  | 国債証券 | 4.5000 | 3,620  | 5,894  | 739,739   | 2041/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55  | 国債証券 | 4.0000 | 1,440  | 2,371  | 297,640   | 2055/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60  | 国債証券 | 4.0000 | 1,400  | 2,365  | 296,875   | 2060/04/25 |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29  | 国債証券 | 5.5000 | 3,650  | 5,454  | 684,465   | 2029/04/25 |
| FRANCE OAT 3.0 04/25/22  | 国債証券 | 3.0000 | 4,790  | 5,305  | 665,847   | 2022/04/25 |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/20  | 国債証券 | 3.5000 | 6,500  | 6,807  | 854,275   | 2020/04/25 |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 2,690  | 4,215  | 529,019   | 2035/04/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 2,470  | 3,466  | 435,026   | 2045/05/25 |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48  | 国債証券 | 2.0000 | 2,580  | 2,870  | 360,265   | 2048/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 国債証券 | 1.7500 | 1,150  | 1,149  | 144,241   | 2066/05/25 |
| FRANCE OAT 2.25 05/25/24 | 国債証券 | 2.2500 | 4,000  | 4,497  | 564,408   | 2024/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30  | 国債証券 | 2.5000 | 3,490  | 4,184  | 525,127   | 2030/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 3,590  | 3,685  | 462,492   | 2028/05/25 |

| 銘                          | 柄    | 当 期    |         |         |            |             | 末         |
|----------------------------|------|--------|---------|---------|------------|-------------|-----------|
|                            |      | 種 類    | 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 |           |
| <b>(ユーロ…フランス)</b>          |      |        | %       | 千ユーロ    | 千ユーロ       | 千円          |           |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31    | 国債証券 | 1.5000 | 5,090   | 5,527   | 693,676    | 2031/05/25  |           |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25    | 国債証券 | 0.5000 | 3,700   | 3,809   | 478,033    | 2025/05/25  |           |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34   | 国債証券 | 1.2500 | 1,290   | 1,339   | 168,112    | 2034/05/25  |           |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26    | 国債証券 | 0.5000 | 3,560   | 3,643   | 457,211    | 2026/05/25  |           |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27    | 国債証券 | 1.0000 | 3,350   | 3,534   | 443,542    | 2027/05/25  |           |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/23   | 国債証券 | 1.7500 | 4,400   | 4,775   | 599,304    | 2023/05/25  |           |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36   | 国債証券 | 1.2500 | 2,840   | 2,900   | 364,018    | 2036/05/25  |           |
| FRANCE OAT 05/25/22        | 国債証券 | -      | 3,000   | 3,034   | 380,739    | 2022/05/25  |           |
| FRANCE OAT 05/25/21        | 国債証券 | -      | 2,510   | 2,534   | 318,113    | 2021/05/25  |           |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39   | 国債証券 | 1.7500 | 1,440   | 1,572   | 197,391    | 2039/06/25  |           |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/23   | 国債証券 | 4.2500 | 5,000   | 6,048   | 759,032    | 2023/10/25  |           |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25    | 国債証券 | 6.0000 | 2,900   | 4,046   | 507,746    | 2025/10/25  |           |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27   | 国債証券 | 2.7500 | 3,580   | 4,319   | 542,070    | 2027/10/25  |           |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38    | 国債証券 | 4.0000 | 2,630   | 3,951   | 495,909    | 2038/10/25  |           |
| FRANCE OAT 3.25 10/25/21   | 国債証券 | 3.2500 | 4,190   | 4,606   | 578,015    | 2021/10/25  |           |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32   | 国債証券 | 5.7500 | 3,390   | 5,558   | 697,525    | 2032/10/25  |           |
| FRANCE OAT 2.25 10/25/22   | 国債証券 | 2.2500 | 3,400   | 3,720   | 466,904    | 2022/10/25  |           |
| FRANCE OAT 2.5 10/25/20    | 国債証券 | 2.5000 | 7,800   | 8,195   | 1,028,409  | 2020/10/25  |           |
| FRANCE OAT 1.75 11/25/24   | 国債証券 | 1.7500 | 3,630   | 4,005   | 502,625    | 2024/11/25  |           |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25    | 国債証券 | 1.0000 | 3,000   | 3,182   | 399,310    | 2025/11/25  |           |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26   | 国債証券 | 0.2500 | 3,000   | 3,000   | 376,582    | 2026/11/25  |           |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28   | 国債証券 | 0.7500 | 2,940   | 3,003   | 376,861    | 2028/11/25  |           |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/20   | 国債証券 | 0.2500 | 1,100   | 1,114   | 139,859    | 2020/11/25  |           |
| 小 計                        | -    | -      | 133,920 | 156,515 | 19,641,123 | -           |           |
| <b>(ユーロ…ドイツ)</b>           |      |        | %       | 千ユーロ    | 千ユーロ       | 千円          |           |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24  | 国債証券 | 6.2500 | 1,700   | 2,253   | 282,789    | 2024/01/04  |           |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 国債証券 | 5.6250 | 1,600   | 2,409   | 302,402    | 2028/01/04  |           |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30  | 国債証券 | 6.2500 | 1,100   | 1,833   | 230,146    | 2030/01/04  |           |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31   | 国債証券 | 5.5000 | 1,500   | 2,444   | 306,806    | 2031/01/04  |           |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37   | 国債証券 | 4.0000 | 2,310   | 3,717   | 466,466    | 2037/01/04  |           |
| DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22   | 国債証券 | 2.0000 | 2,700   | 2,898   | 363,723    | 2022/01/04  |           |
| DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21   | 国債証券 | 2.5000 | 2,200   | 2,328   | 292,214    | 2021/01/04  |           |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25   | 国債証券 | 0.5000 | 2,200   | 2,306   | 289,393    | 2025/02/15  |           |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26   | 国債証券 | 0.5000 | 2,690   | 2,824   | 354,487    | 2026/02/15  |           |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29  | 国債証券 | 0.2500 | 400     | 406     | 50,949     | 2029/02/15  |           |
| DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23   | 国債証券 | 1.5000 | 2,100   | 2,266   | 284,482    | 2023/02/15  |           |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28   | 国債証券 | 0.5000 | 2,210   | 2,312   | 290,142    | 2028/02/15  |           |
| DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24  | 国債証券 | 1.7500 | 1,500   | 1,661   | 208,517    | 2024/02/15  |           |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27  | 国債証券 | 0.2500 | 2,680   | 2,759   | 346,227    | 2027/02/15  |           |
| BUNDESUBL 04/17/20         | 国債証券 | -      | 1,130   | 1,137   | 142,758    | 2020/04/17  |           |
| BUNDESUBL 04/09/21         | 国債証券 | -      | 2,200   | 2,226   | 279,459    | 2021/04/09  |           |
| BUNDESUBL 04/08/22         | 国債証券 | -      | 2,010   | 2,043   | 256,409    | 2022/04/08  |           |
| BUNDESUBL 04/14/23         | 国債証券 | -      | 1,130   | 1,151   | 144,497    | 2023/04/14  |           |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24   | 国債証券 | 1.5000 | 2,000   | 2,197   | 275,714    | 2024/05/15  |           |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23   | 国債証券 | 1.5000 | 2,500   | 2,708   | 339,949    | 2023/05/15  |           |
| BUNDESSCHAT 06/12/20       | 国債証券 | -      | 1,270   | 1,279   | 160,575    | 2020/06/12  |           |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27   | 国債証券 | 6.5000 | 1,120   | 1,741   | 218,560    | 2027/07/04  |           |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28  | 国債証券 | 4.7500 | 1,120   | 1,618   | 203,101    | 2028/07/04  |           |

| 銘柄                        | 当    |        |        | 期       |            | 末          |
|---------------------------|------|--------|--------|---------|------------|------------|
|                           | 種類   | 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     |            |
| <b>(ユーロ…ドイツ)</b>          |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ    | 千円         |            |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,390  | 2,388   | 299,775    | 2039/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 1,500  | 2,366   | 297,004    | 2042/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44  | 国債証券 | 2.5000 | 2,710  | 3,871   | 485,825    | 2044/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国債証券 | 4.7500 | 1,740  | 3,220   | 404,183    | 2040/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21 | 国債証券 | 3.2500 | 3,150  | 3,435   | 431,107    | 2021/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20  | 国債証券 | 3.0000 | 3,000  | 3,147   | 394,917    | 2020/07/04 |
| DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22 | 国債証券 | 1.7500 | 2,700  | 2,908   | 364,942    | 2022/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国債証券 | 4.7500 | 2,080  | 3,450   | 433,033    | 2034/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46  | 国債証券 | 2.5000 | 2,600  | 3,773   | 473,531    | 2046/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 国債証券 | 1.2500 | 1,300  | 1,480   | 185,747    | 2048/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25  | 国債証券 | 1.0000 | 2,500  | 2,706   | 339,607    | 2025/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27  | 国債証券 | 0.5000 | 2,700  | 2,830   | 355,147    | 2027/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/26      | 国債証券 | —      | 2,370  | 2,399   | 301,122    | 2026/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,780  | 1,814   | 227,716    | 2028/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23  | 国債証券 | 2.0000 | 1,500  | 1,665   | 209,004    | 2023/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24  | 国債証券 | 1.0000 | 1,340  | 1,439   | 180,652    | 2024/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21 | 国債証券 | 2.2500 | 1,070  | 1,146   | 143,874    | 2021/09/04 |
| DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20 | 国債証券 | 2.2500 | 4,200  | 4,382   | 550,021    | 2020/09/04 |
| DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22  | 国債証券 | 1.5000 | 1,650  | 1,768   | 221,923    | 2022/09/04 |
| BUNDESUBL 0.25 10/16/20   | 国債証券 | 0.2500 | 1,500  | 1,520   | 190,804    | 2020/10/16 |
| BUNDESUBL 10/07/22        | 国債証券 | —      | 2,730  | 2,779   | 348,839    | 2022/10/07 |
| BUNDESUBL 10/13/23        | 国債証券 | —      | 1,280  | 1,304   | 163,699    | 2023/10/13 |
| 小計                        | —    | —      | 88,160 | 104,329 | 13,092,260 | —          |
| <b>(ユーロ…スペイン)</b>         |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ    | 千円         |            |
| SPAIN 5.85 01/31/22       | 国債証券 | 5.8500 | 2,300  | 2,701   | 339,032    | 2022/01/31 |
| SPAIN 6.0 01/31/29        | 国債証券 | 6.0000 | 2,750  | 3,977   | 499,169    | 2029/01/31 |
| SPAIN 4.8 01/31/24        | 国債証券 | 4.8000 | 2,200  | 2,683   | 336,699    | 2024/01/31 |
| SPAIN 4.2 01/31/37        | 国債証券 | 4.2000 | 1,960  | 2,638   | 331,163    | 2037/01/31 |
| SPAIN 5.4 01/31/23        | 国債証券 | 5.4000 | 2,800  | 3,386   | 424,970    | 2023/01/31 |
| SPAIN 0.05 01/31/21       | 国債証券 | 0.0500 | 400    | 401     | 50,423     | 2021/01/31 |
| SPAIN 1.6 04/30/25        | 国債証券 | 1.6000 | 2,160  | 2,296   | 288,232    | 2025/04/30 |
| SPAIN 3.8 04/30/24        | 国債証券 | 3.8000 | 1,720  | 2,021   | 253,725    | 2024/04/30 |
| SPAIN 5.5 04/30/21        | 国債証券 | 5.5000 | 3,600  | 4,046   | 507,787    | 2021/04/30 |
| SPAIN 4.0 04/30/20        | 国債証券 | 4.0000 | 2,400  | 2,522   | 316,575    | 2020/04/30 |
| SPAIN 1.5 04/30/27        | 国債証券 | 1.5000 | 2,000  | 2,078   | 260,818    | 2027/04/30 |
| SPAIN 1.95 04/30/26       | 国債証券 | 1.9500 | 1,790  | 1,933   | 242,651    | 2026/04/30 |
| SPAIN 1.4 04/30/28        | 国債証券 | 1.4000 | 2,230  | 2,281   | 286,293    | 2028/04/30 |
| SPAIN 1.45 04/30/29       | 国債証券 | 1.4500 | 980    | 992     | 124,562    | 2029/04/30 |
| SPAIN 0.4 04/30/22        | 国債証券 | 0.4000 | 2,200  | 2,232   | 280,177    | 2022/04/30 |
| SPAIN 5.9 07/30/26        | 国債証券 | 5.9000 | 2,040  | 2,783   | 349,329    | 2026/07/30 |
| SPAIN 4.9 07/30/40        | 国債証券 | 4.9000 | 1,840  | 2,725   | 341,988    | 2040/07/30 |
| SPAIN 4.7 07/30/41        | 国債証券 | 4.7000 | 2,100  | 3,050   | 382,754    | 2041/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/66       | 国債証券 | 3.4500 | 1,000  | 1,196   | 150,202    | 2066/07/30 |
| SPAIN 4.65 07/30/25       | 国債証券 | 4.6500 | 2,360  | 2,959   | 371,350    | 2025/07/30 |
| SPAIN 1.95 07/30/30       | 国債証券 | 1.9500 | 2,240  | 2,360   | 296,206    | 2030/07/30 |
| SPAIN 5.75 07/30/32       | 国債証券 | 5.7500 | 2,290  | 3,443   | 432,144    | 2032/07/30 |
| SPAIN 2.35 07/30/33       | 国債証券 | 2.3500 | 1,620  | 1,740   | 218,439    | 2033/07/30 |
| SPAIN 1.4 07/30/28        | 国債証券 | 1.4000 | 1,950  | 1,984   | 249,029    | 2028/07/30 |





| 銘柄                       | 当 | 種 | 利 | 率      | 額       | 期       |            | 末          |   |   |
|--------------------------|---|---|---|--------|---------|---------|------------|------------|---|---|
|                          |   |   |   |        |         | 面       | 価          |            | 額 |   |
|                          |   |   |   |        |         |         | 外          |            |   | 建 |
|                          |   |   |   | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ    | 千円         | 償還年月日      |   |   |
| <b>(ユーロ…イタリア)</b>        |   |   |   | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ    | 千円         |            |   |   |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国 | 債 | 証 | 2.0500 | 1,870   | 1,790   | 224,657    | 2027/08/01 |   |   |
| ITALY BTPS 0.9 08/01/22  | 国 | 債 | 証 | 0.9000 | 980     | 964     | 121,053    | 2022/08/01 |   |   |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国 | 債 | 証 | 2.9500 | 1,270   | 1,177   | 147,806    | 2038/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国 | 債 | 証 | 4.7500 | 1,790   | 2,106   | 264,399    | 2044/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国 | 債 | 証 | 3.2500 | 1,780   | 1,686   | 211,584    | 2046/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国 | 債 | 証 | 4.7500 | 2,400   | 2,804   | 351,924    | 2028/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40  | 国 | 債 | 証 | 5.0000 | 2,250   | 2,707   | 339,782    | 2040/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/21 | 国 | 債 | 証 | 4.7500 | 2,470   | 2,699   | 338,786    | 2021/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国 | 債 | 証 | 2.4500 | 1,100   | 1,009   | 126,654    | 2033/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 4.0 09/01/20  | 国 | 債 | 証 | 4.0000 | 3,700   | 3,895   | 488,893    | 2020/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 3.75 09/01/24 | 国 | 債 | 証 | 3.7500 | 1,900   | 2,064   | 259,102    | 2024/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 5.5 09/01/22  | 国 | 債 | 証 | 5.5000 | 2,480   | 2,825   | 354,573    | 2022/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国 | 債 | 証 | 2.2500 | 1,500   | 1,304   | 163,670    | 2036/09/01 |   |   |
| ITALY BTPS 1.45 09/15/22 | 国 | 債 | 証 | 1.4500 | 1,500   | 1,502   | 188,573    | 2022/09/15 |   |   |
| ITALY BTPS 0.65 10/15/23 | 国 | 債 | 証 | 0.6500 | 2,100   | 2,002   | 251,266    | 2023/10/15 |   |   |
| ITALY BTPS 9.0 11/01/23  | 国 | 債 | 証 | 9.0000 | 1,510   | 1,998   | 250,808    | 2023/11/01 |   |   |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 国 | 債 | 証 | 7.2500 | 1,080   | 1,438   | 180,484    | 2026/11/01 |   |   |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27  | 国 | 債 | 証 | 6.5000 | 3,020   | 3,904   | 489,982    | 2027/11/01 |   |   |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 国 | 債 | 証 | 5.2500 | 2,900   | 3,504   | 439,798    | 2029/11/01 |   |   |
| ITALY BTPS 5.5 11/01/22  | 国 | 債 | 証 | 5.5000 | 2,500   | 2,854   | 358,255    | 2022/11/01 |   |   |
| ITALY BTPS 1.45 11/15/24 | 国 | 債 | 証 | 1.4500 | 2,020   | 1,952   | 244,977    | 2024/11/15 |   |   |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25  | 国 | 債 | 証 | 2.5000 | 550     | 555     | 69,711     | 2025/11/15 |   |   |
| ITALY BTPS 0.65 11/01/20 | 国 | 債 | 証 | 0.6500 | 3,600   | 3,607   | 452,730    | 2020/11/01 |   |   |
| ITALY BTPS 0.35 11/01/21 | 国 | 債 | 証 | 0.3500 | 1,700   | 1,672   | 209,868    | 2021/11/01 |   |   |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25  | 国 | 債 | 証 | 2.0000 | 2,010   | 1,974   | 247,767    | 2025/12/01 |   |   |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 国 | 債 | 証 | 1.2500 | 2,000   | 1,839   | 230,846    | 2026/12/01 |   |   |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/24  | 国 | 債 | 証 | 2.5000 | 970     | 991     | 124,458    | 2024/12/01 |   |   |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28  | 国 | 債 | 証 | 2.8000 | 1,400   | 1,395   | 175,158    | 2028/12/01 |   |   |
| ITALY BTPS 2.15 12/15/21 | 国 | 債 | 証 | 2.1500 | 2,200   | 2,264   | 284,222    | 2021/12/15 |   |   |
| 小計                       | - | - | - | -      | 127,670 | 135,633 | 17,020,656 | -          |   |   |
| <b>(ユーロ…フィンランド)</b>      |   |   |   | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ    | 千円         |            |   |   |
| FINLAND 2.0 04/15/24     | 国 | 債 | 証 | 2.0000 | 680     | 756     | 94,929     | 2024/04/15 |   |   |
| FINLAND 3.5 04/15/21     | 国 | 債 | 証 | 3.5000 | 700     | 759     | 95,369     | 2021/04/15 |   |   |
| FINLAND 0.75 04/15/31    | 国 | 債 | 証 | 0.7500 | 450     | 459     | 57,628     | 2031/04/15 |   |   |
| FINLAND 1.375 04/15/47   | 国 | 債 | 証 | 1.3750 | 40      | 43      | 5,465      | 2047/04/15 |   |   |
| FINLAND 3.375 04/15/20   | 国 | 債 | 証 | 3.3750 | 980     | 1,024   | 128,505    | 2020/04/15 |   |   |
| FINLAND 0.5 04/15/26     | 国 | 債 | 証 | 0.5000 | 600     | 618     | 77,597     | 2026/04/15 |   |   |
| FINLAND 1.125 04/15/34   | 国 | 債 | 証 | 1.1250 | 420     | 443     | 55,679     | 2034/04/15 |   |   |
| FINLAND 1.5 04/15/23     | 国 | 債 | 証 | 1.5000 | 950     | 1,020   | 128,108    | 2023/04/15 |   |   |
| FINLAND 04/15/22         | 国 | 債 | 証 | -      | 320     | 323     | 40,634     | 2022/04/15 |   |   |
| FINLAND 4.0 07/04/25     | 国 | 債 | 証 | 4.0000 | 800     | 1,007   | 126,425    | 2025/07/04 |   |   |
| FINLAND 2.75 07/04/28    | 国 | 債 | 証 | 2.7500 | 630     | 772     | 96,978     | 2028/07/04 |   |   |
| FINLAND 2.625 07/04/42   | 国 | 債 | 証 | 2.6250 | 500     | 683     | 85,747     | 2042/07/04 |   |   |
| FINLAND 0.875 09/15/25   | 国 | 債 | 証 | 0.8750 | 300     | 317     | 39,851     | 2025/09/15 |   |   |
| FINLAND 0.5 09/15/28     | 国 | 債 | 証 | 0.5000 | 670     | 679     | 85,242     | 2028/09/15 |   |   |
| FINLAND 0.5 09/15/27     | 国 | 債 | 証 | 0.5000 | 300     | 306     | 38,478     | 2027/09/15 |   |   |
| FINLAND 1.625 09/15/22   | 国 | 債 | 証 | 1.6250 | 400     | 428     | 53,763     | 2022/09/15 |   |   |
| FINLAND 09/15/23         | 国 | 債 | 証 | -      | 230     | 232     | 29,172     | 2023/09/15 |   |   |

| 銘柄                     | 柄 | 当 期  |        |         |           | 末           |            |
|------------------------|---|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|                        |   | 種 類  | 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…フィンランド)           |   |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| FINLAND 0.375 09/15/20 |   | 国債証券 | 0.3750 | 500     | 506       | 63,595      | 2020/09/15 |
| 小                      | 計 | —    | —      | 9,470   | 10,384    | 1,303,175   | —          |
| (ユーロ…オーストリア)           |   |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62   |   | 国債証券 | 3.8000 | 820     | 1,476     | 185,284     | 2062/01/26 |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47   |   | 国債証券 | 1.5000 | 300     | 321       | 40,339      | 2047/02/20 |
| AUSTRIA 0.75 02/20/28  |   | 国債証券 | 0.7500 | 450     | 466       | 58,592      | 2028/02/20 |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26  |   | 国債証券 | 4.8500 | 1,100   | 1,472     | 184,788     | 2026/03/15 |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37  |   | 国債証券 | 4.1500 | 1,410   | 2,173     | 272,754     | 2037/03/15 |
| AUSTRIA 3.65 04/20/22  |   | 国債証券 | 3.6500 | 1,200   | 1,353     | 169,878     | 2022/04/20 |
| AUSTRIA 0.5 04/20/27   |   | 国債証券 | 0.5000 | 520     | 531       | 66,728      | 2027/04/20 |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34   |   | 国債証券 | 2.4000 | 780     | 956       | 120,008     | 2034/05/23 |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44  |   | 国債証券 | 3.1500 | 720     | 1,045     | 131,185     | 2044/06/20 |
| AUSTRIA 3.9 07/15/20   |   | 国債証券 | 3.9000 | 1,700   | 1,803     | 226,346     | 2020/07/15 |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27  |   | 国債証券 | 6.2500 | 1,150   | 1,729     | 217,001     | 2027/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/23       |   | 国債証券 | —      | 350     | 353       | 44,411      | 2023/07/15 |
| AUSTRIA 3.5 09/15/21   |   | 国債証券 | 3.5000 | 1,900   | 2,094     | 262,870     | 2021/09/15 |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17   |   | 国債証券 | 2.1000 | 220     | 270       | 33,990      | 2117/09/20 |
| AUSTRIA 09/20/22       |   | 国債証券 | —      | 470     | 475       | 59,728      | 2022/09/20 |
| AUSTRIA 1.65 10/21/24  |   | 国債証券 | 1.6500 | 1,250   | 1,376     | 172,722     | 2024/10/21 |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26  |   | 国債証券 | 0.7500 | 1,300   | 1,359     | 170,545     | 2026/10/20 |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25   |   | 国債証券 | 1.2000 | 1,000   | 1,079     | 135,525     | 2025/10/20 |
| AUSTRIA 1.75 10/20/23  |   | 国債証券 | 1.7500 | 1,400   | 1,532     | 192,288     | 2023/10/20 |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86   |   | 国債証券 | 1.5000 | 290     | 285       | 35,851      | 2086/11/02 |
| AUSTRIA 3.4 11/22/22   |   | 国債証券 | 3.4000 | 740     | 845       | 106,080     | 2022/11/22 |
| 小                      | 計 | —    | —      | 19,070  | 23,005    | 2,886,920   | —          |
| 合                      | 計 | —    | —      | —       | —         | 193,881,281 | —          |

## ■投資信託財産の構成

2019年2月21日現在

| 項 目                     | 当 期         |   | 末     |
|-------------------------|-------------|---|-------|
|                         | 評 価 額       | 比 | 率     |
| 公 社 債                   | 千円          |   | %     |
| 公 社 債                   | 193,881,281 |   | 98.0  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 4,022,957   |   | 2.0   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 197,904,239 |   | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、196,845,541千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.70円、1カナダ・ドル=84.05円、1オーストラリア・ドル=79.64円、1シンガポール・ドル=81.92円、1イギリス・ポンド=144.37円、1デンマーク・クローネ=16.82円、1ノルウェー・クローネ=12.88円、1スウェーデン・クローナ=11.88円、1メキシコ・ペソ=5.76円、1マレーシア・リングギット=27.21円、1南アフリカ・ランド=7.90円、1ポーランド・ズロチ=28.99円、1ユーロ=125.49円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月21日)現在

| 項 目                      | 当 期 末            |
|--------------------------|------------------|
| (A) 資 産                  | 197,904,239,281円 |
| コ ー ル ・ ク ー ン 等          | 2,490,289,965    |
| 公 社 債(評価額)               | 193,881,281,959  |
| 未 収 利 息                  | 1,470,920,873    |
| 前 払 費 用                  | 61,746,484       |
| (B) 負 債                  | 234,232,000      |
| 未 払 解 約 金                | 234,232,000      |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)     | 197,670,007,281  |
| 元 本                      | 108,789,722,301  |
| 次 期 繰 越 損 益              | 88,880,284,980   |
| (D) 受 益 権 総 口 数          | 108,789,722,301口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 18,170円          |

(注1) 期首元本額 121,875,729,918円  
 追加設定元本額 28,217,327,604円  
 一部解約元本額 41,303,335,221円

(注2) 期末における元本の内訳

|                                 |                |
|---------------------------------|----------------|
| D I AM外国債券パッシブ・ファンド             | 8,079,391,033円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型)          | 9,105,775円     |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型)          | 25,280,519円    |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型)          | 30,864,769円    |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)           | 76,286,272円    |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)           | 72,349,714円    |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)           | 38,058,966円    |
| たわらノーロード 先進国債券                  | 3,275,191,858円 |
| たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>           | 606,412円       |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)          | 159,226,230円   |
| たわらノーロード バランス (堅実型)             | 3,033,012円     |
| たわらノーロード バランス (標準型)             | 16,033,815円    |
| たわらノーロード バランス (積極型)             | 4,324,944円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)    | 461,289円       |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)    | 28,022,793円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)  | 52,535,294円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)    | 15,391,137円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)    | 18,472,796円    |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)          | 404,775円       |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)        | 1,631,952円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)          | 562,231円       |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)          | 1,090,262円     |
| D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>      | 5,431,832,485円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>1 (安定型)    | 533,531,954円   |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>2 (安定・成長型) | 1,686,524,738円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>3 (成長型)    | 1,750,349,034円 |
| D I AM DCバランス30インデックスファンド       | 372,685,112円   |
| D I AM DCバランス50インデックスファンド       | 812,192,171円   |
| D I AM DCバランス70インデックスファンド       | 621,735,533円   |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)           | 22,571,041円    |
| マネックス資産設計ファンド (育成型)             | 600,919,427円   |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション          | 3,924,410円     |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)   | 119,017,497円   |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)   | 71,193,232円    |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)   | 115,407,689円   |
| クルーズコントロール                      | 2,914,474,463円 |
| D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>       | 87,907,821円    |
| D I AM DC バランス・F (成長型)          | 149,376,214円   |

|  |                  |
|--|------------------|
| クルーズコントロール<DC年金>                         | 2,093,489円       |
| D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)                   | 8,556,081円       |
| D I AMコア資産設計ファンド (積極型)                   | 22,578,913円      |
| ダイナミック・ナビゲーション                           | 1,609,469円       |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>                     | 15,793,100円      |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                     | 11,075円          |
| D I AMパッシブ資産分散ファンド                       | 1,310,116,672円   |
| D I AM海替フルハッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 7,061,418,108円   |
| D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)           | 3,712,393,566円   |
| 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)                 | 3,093,632,320円   |
| 先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)                | 6,083,990,824円   |
| D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)           | 94,789,701円      |
| D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)     | 758,173,712円     |
| D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)     | 602,968,210円     |
| D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)       | 47,915,924円      |
| D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)       | 86,538,439円      |
| D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)       | 22,844,836円      |
| D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)       | 6,207,173円       |
| D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)         | 54,280,724円      |
| D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)         | 74,645,150円      |
| D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)           | 3,247,776,538円   |
| D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)         | 2,149,670,139円   |
| D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)           | 3,653,553,398円   |
| D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)      | 665,748,223円     |
| D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)     | 248,926,518円     |
| D I AM アクサグローバル・バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 3,039,294,314円   |
| D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)       | 1,707,250,047円   |
| D I AMグローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け)           | 14,665,687円      |
| D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)         | 15,979,183円      |
| D I AM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)         | 122,749,235円     |
| D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)      | 7,941,548,622円   |
| D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)      | 18,779,521,088円  |
| D I AMバランス30VA (適格機関投資家限定)               | 20,111,944円      |
| D I AMバランス50VA (適格機関投資家限定)               | 999,291円         |
| D I AMバランス70VA (適格機関投資家限定)               | 4,973,567円       |
| D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)      | 16,716,206,595円  |
| D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)             | 88,655,549円      |
| D I AMバランス20VA (適格機関投資家限定)               | 109,040,954円     |
| D I AMバランス40VA (適格機関投資家限定)               | 362,862円         |
| D I AMバランス60VA (適格機関投資家限定)               | 162,392円         |
| 期末元本合計                                   | 108,789,722,301円 |

## ■損益の状況

当期 自2018年2月22日 至2019年2月21日

| 項                        | 目 | 当 期             |
|--------------------------|---|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益            |   | 5,210,935,647円  |
| 受 取 利 息                  |   | 5,211,529,205   |
| 支 払 利 息                  |   | △593,558        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益      |   | △1,939,630,067  |
| 売 買 益                    |   | 6,493,469,639   |
| 売 買 損                    |   | △8,433,099,706  |
| (C) そ の 他 費 用            |   | △21,523,572     |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) |   | 3,249,782,008   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金        |   | 95,987,399,355  |
| (F) 解 約 差 損 益 金          |   | △32,966,517,779 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金      |   | 22,609,621,396  |
| (H) 合 計(D + E + F + G)   |   | 88,880,284,980  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)         |   | 88,880,284,980  |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

## 《お知らせ》

■当ファンドのベンチマークの名称に変更が生じたため約款に所要の変更を行いました。

変更前：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）

変更後：F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）

なお、当該名称変更は、「シティ債券インデックス」のロンドン証券取引所グループによる買収に伴うものであり、ファンドの運用方針および運用プロセスを変更するものではありません。

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

# エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 運用報告書

第11期（決算日 2019年4月18日）

（計算期間 2018年4月19日～2019年4月18日）

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第11期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。

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 2008年2月20日から無期限です。   |
| 運用方針   | 主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 海外の証券取引所に上場している株式*を主要投資対象とします。<br>※DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。              |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。<br>外貨建資産への投資には、制限を設けません。  |

### ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |       | MSCIエマージング・マーケット・インデックス                   |           | 株式組入比率    | 株式先物比率   | 投資信託<br>受益証券・<br>投資証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額     |
|-----------------|--------|-------|---|-----------|-----------|----------|-------------------------------|---------------|
|                 | 円      | 騰落率   | （円換算ベース、<br>配当込み、<br>為替ヘッジなし）<br>（ベンチマーク） | 騰落率       |           |          |                               |               |
| 7期(2015年4月20日)  | 11,412 | 22.2  | ポイント<br>250,241.33                        | %<br>23.2 | %<br>95.4 | %<br>3.6 | %<br>0.9                      | 百万円<br>41,339 |
| 8期(2016年4月18日)  | 8,600  | △24.6 | 189,749.05                                | △24.2     | 92.8      | 6.1      | 1.0                           | 36,196        |
| 9期(2017年4月18日)  | 10,121 | 17.7  | 224,042.80                                | 18.1      | 95.8      | 3.2      | 0.9                           | 40,863        |
| 10期(2018年4月18日) | 12,241 | 20.9  | 273,007.15                                | 21.9      | 92.1      | 7.1      | 0.7                           | 66,443        |
| 11期(2019年4月18日) | 12,260 | 0.2   | 276,323.22                                | 1.2       | 94.4      | 4.4      | 0.6                           | 61,535        |

（注1）株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

（注2）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注3）ベンチマークはMSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注4）MSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。

（注5）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

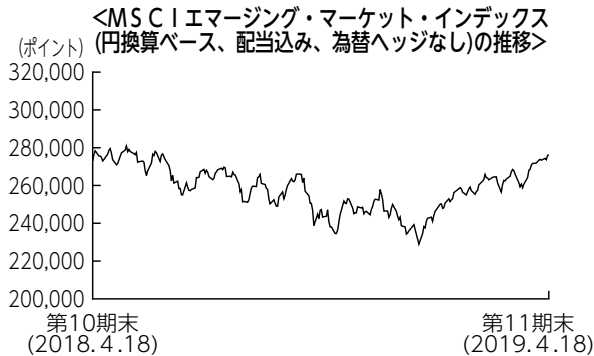
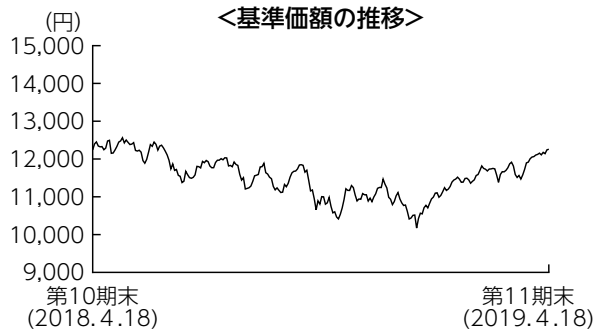
| 年 月 日                   | 基 準 価 額     |        | MSCIエマージング・<br>マーケット・インデックス               |        | 株式組入<br>比 率 | 株式先物<br>比 率 | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入 比率 |
|-------------------------|-------------|--------|---|--------|-------------|-------------|--------------------------------|
|                         | 円           | 騰落率    | (円換算ベース、<br>配当込み、<br>為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) | 騰落率    |             |             |                                |
| (期 首)<br>2018年 4 月 18 日 | 円<br>12,241 | %<br>- | ポイント<br>273,007.15                        | %<br>- | %<br>92.1   | %<br>7.1    | %<br>0.7                       |
| 4 月 末                   | 12,288      | 0.4    | 273,760.40                                | 0.3    | 92.2        | 7.1         | 0.7                            |
| 5 月 末                   | 11,889      | △2.9   | 265,261.40                                | △2.8   | 91.6        | 7.2         | 0.6                            |
| 6 月 末                   | 11,411      | △6.8   | 255,045.10                                | △6.6   | 93.0        | 6.3         | 0.7                            |
| 7 月 末                   | 11,979      | △2.1   | 268,351.33                                | △1.7   | 94.6        | 4.7         | 0.7                            |
| 8 月 末                   | 11,637      | △4.9   | 261,115.88                                | △4.4   | 87.4        | 11.6        | 0.6                            |
| 9 月 末                   | 11,843      | △3.3   | 266,012.81                                | △2.6   | 93.3        | 6.1         | 0.7                            |
| 10 月 末                  | 10,537      | △13.9  | 236,534.41                                | △13.4  | 94.8        | 4.5         | 0.7                            |
| 11 月 末                  | 11,248      | △8.1   | 252,772.61                                | △7.4   | 96.5        | 2.6         | 0.6                            |
| 12 月 末                  | 10,518      | △14.1  | 236,715.28                                | △13.3  | 95.4        | 2.7         | 0.6                            |
| 2019年 1 月 末             | 11,272      | △7.9   | 253,056.23                                | △7.3   | 93.4        | 5.9         | 0.6                            |
| 2 月 末                   | 11,731      | △4.2   | 263,953.75                                | △3.3   | 91.1        | 8.2         | 0.6                            |
| 3 月 末                   | 11,577      | △5.4   | 260,713.93                                | △4.5   | 92.0        | 7.4         | 0.6                            |
| (期 末)<br>2019年 4 月 18 日 | 12,260      | 0.2    | 276,323.22                                | 1.2    | 94.4        | 4.4         | 0.6                            |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年4月19日から2019年4月18日まで）



展期待などから米ドルが買われ、米ドル高円安方向へと反転しました。トランプ米大統領による制裁の発動が公言されたトルコではリラが大幅に下落し、経済成長見通しを引き下げ、財政赤字の拡大が示唆された南アフリカでもランドが下落しました。

### 基準価額の推移

当期末の基準価額は12,260円となり、前期末比で0.2%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

ブラジルやインドなどの株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

当期の新興国株式市場は前期末比で上昇しました。期前半は世界景気の先行きや米中の貿易摩擦を巡る思惑などから下落しましたが、2019年の年明け以降は米国が金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから世界景気の先行き懸念が和らぎ、新興国株式市場は上昇基調となりました。米中通商協議の進展期待もあり、その後も市場心理の改善を背景に堅調に推移しました。中でも原油価格の安定が好感されたロシアや、改革派の新大統領が誕生したブラジルなどが上昇を牽引しました。

為替市場では2018年末にかけて、米中通商問題や世界経済の減速懸念などから、安全資産とされる円が買われる展開となりました。2019年に入ると、米政府機関の閉鎖が回避されたことや、米中通商問題の進

## ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

#### ○組入上位10業種

##### 期首（前期末）

| No. | 業種                 | 組入比率  |
|-----|--------------------|-------|
| 1   | 銀行                 | 16.4% |
| 2   | ソフトウェア・サービス        | 12.6  |
| 3   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 7.7   |
| 4   | 素材                 | 6.9   |
| 5   | エネルギー              | 6.7   |
| 6   | 半導体・半導体製造装置        | 5.3   |
| 7   | 電気通信サービス           | 4.3   |
| 8   | 食品・飲料・タバコ          | 3.3   |
| 9   | 資本財                | 3.3   |
| 10  | 保険                 | 3.2   |

##### 期末

| No. | 業種                 | 組入比率  |
|-----|--------------------|-------|
| 1   | 銀行                 | 16.8% |
| 2   | 小売                 | 8.1   |
| 3   | メディア・娯楽            | 7.8   |
| 4   | エネルギー              | 7.5   |
| 5   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 7.1   |
| 6   | 素材                 | 6.9   |
| 7   | 半導体・半導体製造装置        | 5.2   |
| 8   | 電気通信サービス           | 4.1   |
| 9   | 保険                 | 3.8   |
| 10  | 食品・飲料・タバコ          | 3.3   |



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.2%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△1.1%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。



## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目   | 当 期                                 |  |
|---|-------------------------------------|--|
|   | 金 額                                 | 比 率  |
| (a) 売買委託手数料<br>(株 式)<br>(先物・オプション)<br>(投資信託受益証券)<br>(投 資 証 券) | 11円<br>( 9)<br>( 2)<br>( 0)<br>( 0) | 0.091%<br>(0.077)<br>(0.013)<br>(0.001)<br>(0.000) |
| (b) 有価証券取引税<br>(株 式)<br>(投 資 証 券)                             | 11<br>(11)<br>( 0)                  | 0.094<br>(0.094)<br>(0.000)                        |
| (c) そ の 他 費 用<br>(保 管 費 用)<br>(そ の 他)                         | 16<br>(14)<br>( 2)                  | 0.143<br>(0.125)<br>(0.017)                        |
| 合 計   | 38                                  | 0.327  |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(11,540円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については13ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (2018年4月19日から2019年4月18日まで)

### (1) 株 式

|       |                               | 買 付                             |                               | 売 付                   |                        |
|-------|-------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|-----------------------|------------------------|
|       |                               | 株 数                             | 金 額                           | 株 数                   | 金 額                    |
| 外 国   | ア メ リ カ                       | 百株<br>11,927.77<br>(276.59)     | 千アメリカ・ドル<br>31,719<br>(-)     | 百株<br>14,699.08       | 千アメリカ・ドル<br>29,840     |
|       | 香 港                           | 百株<br>548,003.92<br>(8,325.56)  | 千香港・ドル<br>493,096<br>(△399)   | 百株<br>443,554.62      | 千香港・ドル<br>464,252      |
|       | 台 湾                           | 百株<br>133,134.93<br>(△3,774.01) | 千台湾・ドル<br>766,554<br>(△6,020) | 百株<br>162,084.36      | 千台湾・ドル<br>902,409      |
|       | イ ギ リ ス                       | 百株<br>281.6<br>(-)              | 千イギリス・ポンド<br>233<br>(-)       | 百株<br>54.04           | 千イギリス・ポンド<br>47        |
|       | ト ル コ                         | 百株<br>8,193.77<br>(2,671.91)    | 千トルコ・リラ<br>7,585<br>(-)       | 百株<br>13,654.19       | 千トルコ・リラ<br>10,559      |
|       | メ キ シ コ                       | 百株<br>25,457.85<br>(-)          | 千メキシコ・ペソ<br>95,051<br>(△394)  | 百株<br>32,989.5        | 千メキシコ・ペソ<br>117,881    |
|       | フ ィ リ ピ ン                     | 百株<br>15,189.44<br>(3.17)       | 千フィリピン・ペソ<br>132,856<br>(-)   | 百株<br>23,495.7        | 千フィリピン・ペソ<br>142,265   |
|       | チ リ                           | 百株<br>202,488.51<br>(638.29)    | 千チリ・ペソ<br>1,724,802<br>(-)    | 百株<br>282,087.08      | 千チリ・ペソ<br>2,000,223    |
|       | コ ロ ン ビ ア                     | 百株<br>4,437.15<br>(-)           | 千コロンビア・ペソ<br>3,637,945<br>(-) | 百株<br>5,011.51        | 千コロンビア・ペソ<br>4,116,756 |
|       | カ タ ー ル                       | 百株<br>1,092.57<br>(-)           | 千カタール・リアル<br>11,083<br>(-)    | 百株<br>1,457.03        | 千カタール・リアル<br>8,059     |
| イ ン ド | 百株<br>23,664.17<br>(3,507.78) | 千インド・ルピー<br>1,463,123<br>(-)    | 百株<br>28,858.51               | 千インド・ルピー<br>1,650,478 |                        |

|        |          | 買 付                           |                                   | 売 付             |                           |
|--------|----------|-------------------------------|-----------------------------------|-----------------|---------------------------|
|        |          | 株 数                           | 金 額                               | 株 数             | 金 額                       |
| 外<br>国 | パキスタン    | 百株<br>(-)                     | 千パキスタン・ルピー<br>-                   | 百株<br>613       | 千パキスタン・ルピー<br>12,028      |
|        | インドネシア   | 百株<br>124,997<br>(-)          | 千インドネシア・ルピア<br>68,526,603<br>(-)  | 百株<br>162,218   | 千インドネシア・ルピア<br>76,953,524 |
|        | アラブ首長国連邦 | 百株<br>14,131.71<br>(420)      | 千アラブ首長国連邦・ディルハム<br>7,741<br>(-)   | 百株<br>16,834.42 | 千アラブ首長国連邦・ディルハム<br>6,415  |
|        | ブラジル     | 百株<br>21,389<br>(2,933.23)    | 千ブラジル・レアル<br>58,351<br>(△933)     | 百株<br>25,900.64 | 千ブラジル・レアル<br>66,920       |
|        | チエコ      | 百株<br>637.07<br>(-)           | 千チエコ・コルナ<br>9,092<br>(△22)        | 百株<br>744.1     | 千チエコ・コルナ<br>12,137        |
|        | 韓国       | 百株<br>6,193.84<br>(5,802.04)  | 千韓国・ウォン<br>35,916,372<br>(△1,871) | 百株<br>7,387.98  | 千韓国・ウォン<br>42,620,362     |
|        | 中国       | 百株<br>25,146<br>(315.2)       | 千オフショア・人民元<br>30,194<br>(-)       | 百株<br>2,485     | 千オフショア・人民元<br>3,687       |
|        | マレーシア    | 百株<br>36,236<br>(764.6)       | 千マレーシア・リンギット<br>24,326<br>(-)     | 百株<br>52,486.8  | 千マレーシア・リンギット<br>29,713    |
|        | 南アフリカ    | 百株<br>21,141.3<br>(△575.78)   | 千南アフリカ・ランド<br>213,051<br>(△4,806) | 百株<br>23,259.26 | 千南アフリカ・ランド<br>227,163     |
|        | タイ       | 百株<br>47,425<br>(10,608)      | 千タイ・バーツ<br>174,461<br>(△19)       | 百株<br>49,809    | 千タイ・バーツ<br>207,726        |
|        | ポーランド    | 百株<br>2,729.57<br>(-)         | 千ポーランド・ズロチ<br>8,768<br>(-)        | 百株<br>4,308.01  | 千ポーランド・ズロチ<br>11,516      |
|        | ハンガリー    | 百株<br>406.05<br>(-)           | 千ハンガリー・フォリント<br>185,732<br>(-)    | 百株<br>452.31    | 千ハンガリー・フォリント<br>227,297   |
|        | ユーロ<br>圏 | 百株<br>3,613.99<br>(△4,185.15) | 千ユーロ<br>527<br>(△2)               | 百株<br>8,481.84  | 千ユーロ<br>709               |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、株式分割、増資割当および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。

## (2) 新株予約権証券

|    |    | 買 付      |              | 売 付     |              |
|----|----|----------|--------------|---------|--------------|
|    |    | 証 券 数    | 金 額          | 証 券 数   | 金 額          |
| 外国 | タイ | 証券<br>-  | 千タイ・バーツ<br>- | 証券<br>- | 千タイ・バーツ<br>- |
|    |    | (59,033) | (19)         | (-)     | (-)          |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、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。

### (3) 投資信託受益証券、投資証券

|   | 買 |            | 付 |                    | 売 |               | 付 |                    |
|---|---|------------|---|--------------------|---|---------------|---|--------------------|
|   | □ | 数          | 金 | 額                  | □ | 数             | 金 | 額                  |
| トルコ<br>EMLAK KONUT GAYRIMENKUL<br>YATIRIM       |   | 千口<br>-    |   | 千トルコ・リラ<br>-       |   | 千口<br>231.071 |   | 千トルコ・リラ<br>399     |
|   |   | (-)        |   | (-)                |   | (-)           |   | (-)                |
| メキシコ<br>FOMENTO ECONOMICO<br>MEXICANO SAB DE CV |   | 千口<br>69.8 |   | 千メキシコ・ペソ<br>12,260 |   | 千口<br>89.3    |   | 千メキシコ・ペソ<br>15,870 |
|   |   | (-)        |   | (-)                |   | (-)           |   | (-)                |
| CEMEX SAB DE CV                                 |   | 715.2      |   | 7,226              |   | 776.7         |   | 8,656              |
|   |   | (-)        |   | (-)                |   | (-)           |   | (-)                |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA                     |   | 207        |   | 5,840              |   | 203.5         |   | 5,327              |
|   |   | (-)        |   | (△159)             |   | (-)           |   | (-)                |
| 南アフリカ<br>HYPROP INVESTMENTS LTD                 |   | 千口<br>-    |   | 千南アフリカ・ランド<br>-    |   | 千口<br>7.533   |   | 千南アフリカ・ランド<br>772  |
|   |   | (-)        |   | (-)                |   | (-)           |   | (-)                |
| FORTRESS REIT LTD-B                             |   | -          |   | -                  |   | 37.518        |   | 558                |
|   |   | (95.302)   |   | (1,476)            |   | (-)           |   | (-)                |
| RESILIENT REIT LTD                              |   | -          |   | -                  |   | -             |   | -                  |
|   |   | (-)        |   | (△161)             |   | (-)           |   | (-)                |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

### (4) 先物取引の種類別取引状況

| 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    |   | 百万円    |       | 百万円 |   | 百万円 |  |
|   |   |   |       | 53,548 |   | 55,556 |       | -   |   | -   |  |

(注) 金額は受渡代金です。

### ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項   | 目               | 当 | 期            |
|-----|-----------------|---|--------------|
| (a) | 期中の株式売買金額       |   | 56,174,054千円 |
| (b) | 期中の平均組入株式時価総額   |   | 52,855,602千円 |
| (c) | 売買高比率 (a) / (b) |   | 1.06         |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

### ■利害関係人との取引状況等 (2018年4月19日から2019年4月18日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

## ■組入資産の明細

### (1) 外国株式

| 銘柄                                    | 株数               | 当 期               |                   | 業 種 等       |                      |             |
|---------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------|----------------------|-------------|
|                                       |                  | 株 数               | 株 数               |             | 評 価 額                |             |
|                                       |                  |                   |                   |             | 外 貨 建 金 額            | 邦 貨 換 算 金 額 |
| (アメリカ)                                | 百株               | 百株                | 千アメリカ・ドル          | 千円          |                      |             |
| CTRIIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR      | 416              | 390.58            | 1,716             | 192,327     | インターネット販売・通信販売       |             |
| CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR      | 235              | 170               | 270               | 30,303      | 金属・鉱業                |             |
| SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF            | 755              | 699               | 431               | 48,305      | 石油・ガス・消耗燃料           |             |
| CREDICORP LTD                         | 70.49            | 64.94             | 1,508             | 169,062     | 銀行                   |             |
| SINA CORP                             | 61               | 58.7              | 380               | 42,577      | インタラクティブ・メディアおよびサービス |             |
| MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR           | 607.25           | 527.53            | 422               | 47,283      | 無線通信サービス             |             |
| NETEASE INC-ADR                       | 83               | 74.21             | 1,990             | 223,061     | 娯楽                   |             |
| SOUTHERN COPPER CORP                  | 87.8             | 72.48             | 303               | 33,976      | 金属・鉱業                |             |
| LUKOIL SPON ADR                       | 462.85           | 467               | 4,056             | 454,474     | 石油・ガス・消耗燃料           |             |
| GAZPROM PAO ADR                       | 5,826.6          | 5,196.69          | 2,631             | 294,844     | 石油・ガス・消耗燃料           |             |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR  | 1,198.44         | 1,570.79          | 645               | 72,332      | 銀行                   |             |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL CO          | -                | 1,058             | 125               | 14,082      | 石油・ガス・消耗燃料           |             |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE           | 962.8            | 1,028.8           | 157               | 17,693      | 不動産管理・開発             |             |
| SURGUTNEFTEGAZ ADR                    | 982.17           | 775.37            | 299               | 33,550      | 石油・ガス・消耗燃料           |             |
| 51.JOB INC ADR                        | -                | 23                | 214               | 24,034      | 専門サービス               |             |
| X5 RETAIL GROUP NV GDR                | -                | 126.36            | 338               | 37,885      | 食品・生活必需品小売り          |             |
| NOVATEK PJSC GDR                      | 103.65           | 88.33             | 1,604             | 179,819     | 石油・ガス・消耗燃料           |             |
| BAIDU INC -SPON ADR                   | 289              | 263.13            | 4,481             | 502,151     | インタラクティブ・メディアおよびサービス |             |
| NOVOLIPETSK STEEL GDR                 | 139.7            | 136.17            | 363               | 40,765      | 金属・鉱業                |             |
| MMC NORILSK NICKEL ADR                | 726.38           | 635.43            | 1,445             | 161,965     | 金属・鉱業                |             |
| ROSNEFT OIL CO GDR                    | 1,389.2          | 1,151             | 788               | 88,336      | 石油・ガス・消耗燃料           |             |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH         | 142              | 136.49            | 1,224             | 137,218     | 各種消費者サービス            |             |
| SEVERSTAL GDR                         | 269.57           | 247.28            | 397               | 44,550      | 金属・鉱業                |             |
| TATNEFT ADR                           | 284.7            | 246.84            | 1,727             | 193,591     | 石油・ガス・消耗燃料           |             |
| MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR    | -                | 237.48            | 210               | 23,627      | 金属・鉱業                |             |
| VTB BANK OJSC GDR                     | 3,220            | 1,720             | 199               | 22,334      | 銀行                   |             |
| DP WORLD PLC                          | 183.2            | 152.19            | 263               | 29,498      | 運送インフラ               |             |
| MAGNIT PJSC GDR                       | 388.47           | 356.89            | 503               | 56,400      | 食品・生活必需品小売り          |             |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR              | 434              | 424.34            | 331               | 37,178      | インターネット販売・通信販売       |             |
| RUSHYDRO PJSC ADR                     | 1,939.6          | -                 | -                 | -           | 電力                   |             |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR               | 339              | 339.86            | 1,177             | 131,901     | 各種消費者サービス            |             |
| NOAH HOLDINGS LTD ADR                 | -                | 27                | 145               | 16,265      | 資本市場                 |             |
| SBERBANK ADR                          | 2,890.2          | 2,588.17          | 3,856             | 432,068     | 銀行                   |             |
| PHOSAGRO PJSC GDR                     | 199.72           | 137.84            | 176               | 19,814      | 化学                   |             |
| HUAZHU GROUP LTD ADR                  | -                | 126.76            | 529               | 59,365      | ホテル・レストラン・レジャー       |             |
| YY INC-ADR                            | 43               | 43.98             | 387               | 43,376      | インタラクティブ・メディアおよびサービス |             |
| GDS HOLDINGS LTD ADR                  | -                | 56                | 215               | 24,193      | 情報技術サービス             |             |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR | -                | 81.15             | 150               | 16,883      | 娯楽                   |             |
| 58.COM INC ADR                        | 97               | 91.17             | 660               | 74,056      | インタラクティブ・メディアおよびサービス |             |
| AUTHOME INC ADR                       | 56               | 56.56             | 634               | 71,062      | インタラクティブ・メディアおよびサービス |             |
| WEIBO CORP ADR                        | 49               | 54.27             | 386               | 43,262      | インタラクティブ・メディアおよびサービス |             |
| JD.COM INC ADR                        | 692              | 697.18            | 2,081             | 233,164     | インターネット販売・通信販売       |             |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR         | 1,208.8          | 1,230.79          | 23,083            | 2,586,271   | インターネット販売・通信販売       |             |
| MOMO INC SPON ADR                     | 115              | 140.47            | 506               | 56,720      | インタラクティブ・メディアおよびサービス |             |
| BAOZUN INC-SPN ADR                    | -                | 34                | 141               | 15,869      | インターネット販売・通信販売       |             |
| PINDUODUO INC ADR                     | -                | 184.17            | 423               | 47,500      | インターネット販売・通信販売       |             |
| YUM CHINA HOLDINGS INC                | 405              | 343.85            | 1,524             | 170,819     | ホテル・レストラン・レジャー       |             |
| IQIYI INC ADR                         | -                | 111.09            | 254               | 28,502      | 娯楽                   |             |
| POLYUS PJSC GDR                       | -                | 60.12             | 233               | 26,135      | 金属・鉱業                |             |
| HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR      | -                | 47.46             | 144               | 16,223      | 医薬品                  |             |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR            | -                | 306.96            | 599               | 67,132      | 航空貨物・物流サービス          |             |
| 小 計                                   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 27,352.59<br>37銘柄 | 24,857.87<br>50銘柄 | 66,349<br>- | 7,433,825<br><12.1%> |             |

| 銘 柄   | 期 首(前期末) |          | 当 期 末     |             | 業 種 等              |
|---|----------|----------|-----------|-------------|--------------------|
|   | 株 数      | 株 数      | 評 価 額     |             |                    |
|   |          |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |                    |
| (香港)  | 百株       | 百株       | 千香港・ドル    | 千円          |                    |
| JIANGXI COPPER CO LTD                       | 1,380    | 1,240    | 1,396     | 19,938      | 金属・鉱業              |
| JIANGSU EXPRESS                             | 1,240    | 1,280    | 1,397     | 19,960      | 運送インフラ             |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD              | 1,620    | 1,260    | 936       | 13,368      | 旅客航空輸送業            |
| ANGANG STEEL CO LTD-H                       | -        | 1,040    | 601       | 8,583       | 金属・鉱業              |
| CHINA MOBILE LIMITED                        | 6,440    | 5,825    | 44,270    | 632,175     | 無線通信サービス           |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD                   | 1,310    | 1,060    | 5,363     | 76,592      | 建設資材               |
| DATANG INTERNATIONAL POWER GEN              | -        | 2,880    | 624       | 8,924       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BEIJING ENTERPRISES                         | 525      | 515      | 2,188     | 31,255      | ガス                 |
| HUANENG POWER INTERNATIONAL IN              | 4,240    | 4,360    | 2,075     | 29,636      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY       | 3,720    | 3,400    | 3,325     | 47,483      | ヘルスケア・テクノロジー       |
| YANZHOU COAL MINING CO LTD                  | 1,880    | 1,720    | 1,523     | 21,761      | 石油・ガス・消耗燃料         |
| HENGAN INTERNATIONAL GROUP                  | 770      | 700      | 4,861     | 69,422      | パーソナル用品            |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME              | -        | 1,440    | 499       | 7,135       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT              | -        | 1,240    | 739       | 10,553      | 旅客航空輸送業            |
| CNOOC LTD                                   | 18,770   | 16,970   | 25,183    | 359,620     | 石油・ガス・消耗燃料         |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE                 | 3,220    | 2,700    | 2,484     | 35,471      | 自動車                |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD               | 4,980    | 4,520    | 7,069     | 100,949     | 医薬品                |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME              | 4,051.2  | 3,651.2  | 10,771    | 153,810     | 不動産管理・開発           |
| CHINA RESOURCES LAND LTD                    | 2,928.88 | 2,648.88 | 9,059     | 129,364     | 不動産管理・開発           |
| CITIC LTD                                   | 6,300    | 5,620    | 6,676     | 95,341      | コングロマリット           |
| CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV              | -        | 1,980    | 362       | 5,174       | ホテル・レストラン・レジャー     |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL               | 1,880    | 1,620    | 1,143     | 16,332      | 運送インフラ             |
| LENOVO GROUP LTD                            | 7,300    | 6,980    | 4,976     | 71,067      | コンピュータ・周辺機器        |
| PETRO CHINA CO LTD                          | 22,000   | 19,820   | 10,028    | 143,212     | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD                  | 6,487.42 | 5,927.42 | 5,785     | 82,612      | 各種電気通信サービス         |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD     | 1,741.9  | 1,599.9  | 4,167     | 59,515      | 保険                 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR              | 26,652   | 24,092   | 14,840    | 211,924     | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO               | -        | 540      | 590       | 8,436       | 医薬品                |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H                  | 1,020    | 940      | 1,821     | 26,014      | 情報技術サービス           |
| KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD | -        | 2,320    | 2,308     | 32,963      | ソフトウェア             |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD                     | 800      | 755      | 5,617     | 80,213      | ガス                 |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD                   | 3,660    | 2,880    | 2,399     | 34,258      | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TOWNGAS CHINA CO LTD                        | -        | 910      | 546       | 7,809       | ガス                 |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD                    | 1,620    | 1,520    | 1,363     | 19,469      | 運送インフラ             |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD                      | -        | 6,340    | 1,217     | 17,382      | 不動産管理・開発           |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD        | 1,320    | 1,240    | 2,031     | 29,004      | 運送インフラ             |
| ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD                 | 3,740    | 3,740    | 1,260     | 17,998      | 金属・鉱業              |
| CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD             | -        | 800      | 1,848     | 26,389      | 資本市場               |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING              | -        | 1,040    | 1,851     | 26,435      | 運送インフラ             |
| CHINA EVERBRIGHT LTD                        | 1,120    | 1,060    | 1,600     | 22,856      | 資本市場               |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD                      | 1,858    | 1,710    | 4,172     | 59,581      | ガス                 |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD                      | 660      | 635      | 1,768     | 25,253      | 電子装置・機器・部品         |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD               | 5,220    | 4,780    | 8,995     | 128,462     | 自動車                |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD                     | -        | 3,060    | 973       | 13,895      | 不動産管理・開発           |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD               | 860      | 820      | 2,906     | 41,510      | ガス                 |
| BYD CO LTD                                  | 680      | 575      | 3,432     | 49,019      | 自動車                |
| CHINA TELECOM CORP LTD                      | 14,640   | 13,400   | 5,654     | 80,750      | 各種電気通信サービス         |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD                 | 2,020    | 1,720    | 1,446     | 20,656      | エネルギー設備・サービス       |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD                  | 11,700   | 14,300   | 2,330     | 33,285      | 娯楽                 |
| SINOTRANS LTD                               | -        | 1,900    | 668       | 9,550       | 航空貨物・物流サービス        |
| MAANSHAN IRON & STEEL                       | -        | 1,720    | 700       | 9,996       | 金属・鉱業              |
| CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL              | 2,490    | 3,375.92 | 2,636     | 37,650      | 商業サービス・用品          |
| MMG LTD                                     | -        | 2,200    | 869       | 12,409      | 金属・鉱業              |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD           | 1,700    | 1,360    | 884       | 12,623      | 紙製品・林産品            |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H                 | 4,851.92 | 6,617.88 | 6,181     | 88,266      | 保険                 |
| AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY              | 2,250    | 1,890    | 895       | 12,792      | 航空宇宙・防衛            |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS              | 1,952    | 1,912    | 2,168     | 30,962      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |

| 銘 柄  | 期 首(前期末)  |           | 当 期 末     |             | 業 種 等                |
|--|-----------|-----------|-----------|-------------|----------------------|
|  | 株 数       | 株 数       | 評 価 額     |             |                      |
|  |           |           | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |                      |
| (香港)   | 百株        | 百株        | 千香港・ドル    | 千円          |                      |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD                       | 2,900     | 3,125     | 2,221     | 31,728      | 自動車                  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD                        | 7,790     | 7,150     | 15,694    | 224,113     | 保険                   |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD                          | 5,850     | 5,610     | 1,924     | 27,478      | 金属・鉱業                |
| CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD                        | —         | 700       | 343       | 4,908       | 金属・鉱業                |
| SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H                    | 1,600     | 1,760     | 1,355     | 19,352      | ヘルスケア機器・用品           |
| SEMICONDUCTOR MANUFACTURING                        | 3,172     | 2,747     | 2,238     | 31,970      | 半導体・半導体製造装置          |
| WEICHAI POWER CO LTD                               | 2,154.4   | 1,764.4   | 2,558     | 36,533      | 機械                   |
| CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO                      | —         | 1,000     | 507       | 7,239       | 海運業                  |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL                     | 3,530     | 3,730     | 1,406     | 20,080      | 化学                   |
| SHANGHAI INDUSTRIAL                                | 430       | 460       | 872       | 12,454      | コンプロマリット             |
| TINGYI HOLDING CORP                                | 1,940     | 1,780     | 2,249     | 32,128      | 食品                   |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD                            | 400       | 340       | 1,598     | 22,819      | 飲料                   |
| GUANGDONG INVESTMENTS LTD                          | 2,980     | 2,820     | 4,094     | 58,471      | 水道                   |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD | —         | 2,080     | 998       | 14,257      | 医薬品                  |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS                      | 1,733.33  | 1,413.33  | 4,932     | 70,436      | 飲料                   |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD                         | 1,460     | 1,460     | 1,319     | 18,847      | 運送インフラ               |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL                             | 4,740     | 6,755     | 5,383     | 76,879      | 医薬品                  |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO                             | 2,920     | 2,650     | 7,499     | 107,092     | 食品                   |
| TENCENT HOLDINGS LTD                               | 5,979     | 5,426     | 214,652   | 3,065,238   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H                       | 5,470     | 4,920     | 46,469    | 663,583     | 保険                   |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD                | 5,660     | 5,080     | 2,458     | 35,110      | 水道                   |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD                           | 9,702.4   | 9,702.4   | 824       | 11,776      | 専門小売り                |
| CHINA POWER INTERNATIONAL                          | —         | 3,500     | 728       | 10,395      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者   |
| AIR CHINA / HONG KONG                              | 1,980     | 1,640     | 1,669     | 23,840      | 旅客航空輸送業              |
| ZTE CORP   | 712.88    | 712.88    | 1,867     | 26,671      | 通信機器                 |
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD                     | 2,500     | 2,500     | 792       | 11,316      | 電気設備                 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD                        | 3,600     | 3,340     | 6,032     | 86,137      | 石油・ガス・消耗燃料           |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD                     | —         | 2,485     | 921       | 13,165      | 海運業                  |
| BANK OF COMMUNICATIONS                             | 9,172.05  | 8,102.05  | 5,436     | 77,632      | 銀行                   |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD          | 2,062.5   | 1,862.5   | 1,495     | 21,356      | 建設・土木                |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC                      | 775       | 720       | 3,916     | 55,931      | 電子装置・機器・部品           |
| CHINA CONSTRUCTION BANK                            | 88,185.3  | 91,385.3  | 65,431    | 934,367     | 銀行                   |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD          | 800       | 726       | 7,506     | 107,197     | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H                        | 2,940     | 2,700     | 2,327     | 33,235      | 自動車                  |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD                        | 1,600     | 1,580     | 2,022     | 28,879      | 不動産管理・開発             |
| SSY GROUP LTD                                      | —         | 1,440     | 1,114     | 15,915      | 医薬品                  |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD                    | 1,680     | 1,710     | 1,332     | 19,022      | 紙製品・林産品              |
| CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL                       | 3,740     | 3,920     | 2,943     | 42,039      | 建設資材                 |
| BANK OF CHINA LTD                                  | 83,102    | 75,282    | 28,757    | 410,660     | 銀行                   |
| SHUI ON LAND LTD                                   | —         | 3,355     | 657       | 9,390       | 不動産管理・開発             |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD                       | 1,200     | 1,130     | 2,808     | 40,098      | 不動産管理・開発             |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD                       | —         | 820       | 636       | 9,086       | 不動産管理・開発             |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD                    | 1,004     | 800       | 1,342     | 19,169      | 不動産管理・開発             |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD                        | 4,089.7   | 3,709.7   | 15,228    | 217,460     | 銀行                   |
| IND & COMM BK OF CHINA - H                         | 77,302.35 | 65,902.35 | 39,936    | 570,297     | 銀行                   |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD                     | —         | 960       | 695       | 9,925       | 金属・鉱業                |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING                        | —         | 1,040     | 923       | 13,187      | 電子装置・機器・部品           |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES                      | 2,756     | 2,276     | 1,604     | 22,913      | 各種電気通信サービス           |
| CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD           | 4,830     | 4,420     | 3,593     | 51,314      | 建設・土木                |
| CHINA COAL ENERGY CO                               | —         | 1,780     | 623       | 8,896       | 石油・ガス・消耗燃料           |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD                 | 640       | 540       | 1,002     | 14,311      | 機械                   |
| ZHUZHOU CRRCC TIMES ELECTRIC CO LTD                | 607       | 510       | 2,129     | 30,405      | 電気設備                 |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD                     | 1,250     | 1,150     | 2,633     | 37,606      | 家庭用耐久財               |
| CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD                 | —         | 1,910     | 508       | 7,255       | 食品                   |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD                     | 5,691.42  | 7,271.42  | 9,409     | 134,363     | 不動産管理・開発             |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD                            | 3,690     | 3,690     | 1,265     | 18,073      | 金属・鉱業                |
| CHINA CITIC BANK-H                                 | 9,388     | 8,798     | 4,539     | 64,827      | 銀行                   |

| 銘 柄   | 期 首(前期末) |          | 当 期 末     |             | 業 種 等                   |
|---|----------|----------|-----------|-------------|-------------------------|
|   | 株 数      | 株 数      | 評 価 額     |             |                         |
|   |          |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |                         |
| (香港)  | 百株       | 百株       | 千香港・ドル    | 千円          |                         |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD                        | —        | 1,210    | 1,142     | 16,311      | 不動産管理・開発                |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD         | 757      | 687      | 6,753     | 96,435      | 電子装置・機器・部品              |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD                      | 1,150    | 1,040    | 5,761     | 82,275      | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| FOSUN INTERNATIONAL                           | 2,795.28 | 2,610.28 | 3,362     | 48,009      | コングロマリット                |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD               | 5,680    | 5,140    | 2,806     | 40,075      | 不動産管理・開発                |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD                  | 3,085    | 2,535    | 958       | 13,683      | 不動産管理・開発                |
| SOHO CHINA LTD                                | 1,780    | 1,725    | 520       | 7,439       | 不動産管理・開発                |
| KINGSOFT CORP LTD                             | 810      | 760      | 1,637     | 23,387      | ソフトウェア                  |
| GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD                  | 13,620   | —        | —         | —           | 半導体・半導体製造装置             |
| SINOTRUK HONG KONG LTD                        | —        | 645      | 1,208     | 17,260      | 機械                      |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD                       | 4,470    | 3,380    | 2,217     | 31,662      | 建設・土木                   |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD              | —        | 1,220    | 868       | 12,404      | 食品                      |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD           | 790      | 525      | 683       | 9,761       | 通信機器                    |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP               | 1,875    | 1,650    | 1,592     | 22,737      | 建設・土木                   |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD                  | 4,970    | 4,880    | 3,059     | 43,693      | 食品                      |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD          | 2,768    | 2,518    | 8,536     | 121,894     | 保険                      |
| CHINA EVERGRANDE GROUP                        | 3,490    | 2,500    | 6,362     | 90,856      | 不動産管理・開発                |
| CRRC CORP LTD - H                             | 4,034.5  | 3,374.5  | 2,460     | 35,128      | 機械                      |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD             | 1,530    | 1,260    | 913       | 13,044      | 医薬品                     |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD                      | 2,400    | 2,115    | 1,501     | 21,443      | 食品・生活必需品小売り             |
| BBMG CORP                                     | —        | 2,220    | 663       | 9,478       | 建設資材                    |
| CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD                  | —        | 1,452    | 651       | 9,309       | 金属・鉱業                   |
| SINOPHARM GROUP CO                            | 1,280    | 1,076    | 3,437     | 49,092      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA RESOURCES CEMENT                        | —        | 2,380    | 2,030     | 28,990      | 建設資材                    |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD               | —        | 2,760    | 637       | 9,104       | 建設・土木                   |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD             | 2,078.05 | 2,745.27 | 2,855     | 40,770      | 自動車                     |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD                      | —        | 1,995    | 1,302     | 18,603      | 金属・鉱業                   |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK               | 2,850    | 2,680    | 1,286     | 18,369      | 銀行                      |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP               | 3,170    | 2,720    | 1,471     | 21,013      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD       | 900      | 737      | 1,292     | 18,459      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUANENG RENEWABLES CORP LTD                   | 4,720    | 4,720    | 1,057     | 15,097      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD      | 3,250    | 3,250    | 627       | 8,957       | 医薬品                     |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD                      | 2,570    | 2,330    | 9,646     | 137,747     | 不動産管理・開発                |
| YUZHOU PROPERTIES CO LTD                      | —        | 1,660    | 750       | 10,714      | 不動産管理・開発                |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD                    | 1,615    | 1,440    | 4,068     | 58,091      | 不動産管理・開発                |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD               | 814      | 846      | 3,912     | 55,874      | 保険                      |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD               | 5,428.8  | 5,926.56 | 3,627     | 51,794      | 銀行                      |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD                      | —        | 2,030    | 702       | 10,029      | 不動産管理・開発                |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | —        | 848      | 812       | 11,600      | 電気設備                    |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD                  | 2,570    | 2,690    | 1,035     | 14,789      | 銀行                      |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA                    | 27,260   | 27,910   | 10,326    | 147,465     | 銀行                      |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD                 | —        | 550      | 1,193     | 17,043      | 専門小売り                   |
| FAR EAST HORIZON LTD                          | 2,020    | 1,990    | 1,671     | 23,870      | 各種金融サービス                |
| CITIC SECURITIES CO LTD                       | 2,425    | 2,025    | 3,685     | 52,628      | 資本市場                    |
| FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD          | —        | 1,720    | 1,668     | 23,824      | 不動産管理・開発                |
| HAITONG SECURITIES CO LTD                     | 3,636    | 2,920    | 3,095     | 44,199      | 資本市場                    |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD      | 6,910    | 7,890    | 2,674     | 38,194      | 保険                      |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD    | 490      | 460      | 1,343     | 19,180      | 医薬品                     |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD                    | 3,820    | 3,340    | 1,940     | 27,710      | 不動産管理・開発                |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD              | —        | 1,215    | 871       | 12,440      | 建設・土木                   |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD                | 3,455    | 3,285    | 1,833     | 26,175      | 資本市場                    |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP                 | 9,860    | 9,860    | 0         | 0           | 半導体・半導体製造装置             |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD                  | 1,000    | 850      | 1,067     | 15,245      | 自動車部品                   |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD           | 3,230    | 3,230    | 0         | 0           | 食品                      |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD                | —        | 960      | 668       | 9,541       | 商業サービス・用品               |
| JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD               | —        | 940      | 355       | 5,073       | 不動産管理・開発                |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD                | —        | 598      | 980       | 14,004      | 資本市場                    |

| 銘 柄   | 期 首(前期末)  |          | 当 期 末      |             | 業 種 等              |            |
|---|-----------|----------|------------|-------------|--------------------|------------|
|   | 株 数       | 株 数      | 評 価 額      |             |                    |            |
|   |           |          | 外 貨 建 金 額  | 邦 貨 換 算 金 額 |                    |            |
| (香港)  | 百株        | 百株       | 千香港・ドル     | 千円          |                    |            |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD           | —         | 7,170    | 3,427      | 48,941      | 銀行                 |            |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD               | —         | 430      | 1,593      | 22,750      | 食品                 |            |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP                        | —         | 740      | 1,594      | 22,772      | ライフサイエンス・ツール/サービス  |            |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD       | —         | 1,180    | 1,692      | 24,163      | 商業サービス・用品          |            |
| CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD                 | —         | 3,080    | 1,136      | 16,229      | 自動車部品              |            |
| CHINA TOWER CORP LTD                          | —         | 38,060   | 7,992      | 114,134     | 各種電気通信サービス         |            |
| XIAOMI CORP                                   | —         | 3,356    | 3,966      | 56,645      | コンピュータ・周辺機器        |            |
| MEITUAN DIANPING                              | —         | 294      | 1,622      | 23,174      | インターネット販売・通信販売     |            |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY-RTS    | —         | 114      | 11         | 167         | 電気設備               |            |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD                      | —         | 2,760    | 1,189      | 16,986      | 半導体・半導体製造装置        |            |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD           | 9,040     | 7,960    | 1,759      | 25,120      | 資本市場               |            |
| LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD                | —         | 1,340    | 1,779      | 25,411      | 不動産管理・開発           |            |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD              | 1,640     | 1,480    | 4,070      | 58,119      | 機械                 |            |
| CHINA VANKE CO LTD-H                          | 1,254.61  | 1,208.61 | 3,952      | 56,436      | 不動産管理・開発           |            |
| LUYE PHARMA GROUP LTD                         | —         | 1,080    | 774        | 11,057      | 医薬品                |            |
| CAR INC                                       | —         | 680      | 432        | 6,175       | 陸運・鉄道              |            |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD                    | —         | 390      | 748        | 10,681      | 半導体・半導体製造装置        |            |
| CGN POWER CO LTD                              | 12,130    | 9,810    | 2,158      | 30,819      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |            |
| FULLSHARE HOLDINGS LTD                        | 7,025     | 6,950    | 646        | 9,229       | 電気設備               |            |
| BAIC MOTOR CORP LTD                           | —         | 1,635    | 1,038      | 14,825      | 自動車                |            |
| GF SECURITIES CO LTD                          | 1,332     | 1,120    | 1,285      | 18,360      | 資本市場               |            |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD             | 512       | 512      | 1,584      | 22,628      | 自動車部品              |            |
| HUATAI SECURITIES CO LTD                      | 1,794     | 1,458    | 2,303      | 32,895      | 資本市場               |            |
| 3SBIO INC                                     | 1,130     | 1,290    | 1,984      | 28,331      | バイオテクノロジー          |            |
| LEGEND HOLDINGS CORP                          | —         | 315      | 685        | 9,783       | コンピュータ・周辺機器        |            |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD      | 2,120     | 1,605    | 1,810      | 25,853      | 医薬品                |            |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD         | 10,000    | 9,040    | 1,545      | 22,074      | 資本市場               |            |
| CHINA LITERATURE LTD                          | —         | 240      | 894        | 12,766      | メディア               |            |
| DALI FOODS GROUP CO LTD                       | —         | 1,880    | 1,017      | 14,523      | 食品                 |            |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD | —         | 1,410    | 922        | 13,168      | 電子装置・機器・部品         |            |
| CHINA REINSURANCE GROUP CORP                  | —         | 5,250    | 882        | 12,594      | 保険                 |            |
| MEITU INC                                     | 1,050     | 1,525    | 526        | 7,513       | コンピュータ・周辺機器        |            |
| BOC AVIATION LTD                              | —         | 194      | 1,320      | 18,852      | 商社・流通業             |            |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD           | —         | 230      | 686        | 9,803       | 保険                 |            |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD          | —         | 960      | 1,689      | 24,127      | 資本市場               |            |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC                     | —         | 445      | 3,722      | 53,156      | ライフサイエンス・ツール/サービス  |            |
| HENGTEN NETWORKS GROUP LTD                    | —         | 20,960   | 503        | 7,183       | 繊維・アパレル・贅沢品        |            |
| 小 計   | 株 数       | 金 額      | 779,691.89 | 892,466.75  | 981,470            | 14,015,400 |
|   | 銘 柄 数<比率> |          | 139銘柄      | 207銘柄       | —                  | <22.8%>    |
| (台湾)  | 百株        | 百株       | 千台湾・ドル     | 千円          |                    |            |
| ACER INC                                      | 3,145.32  | 2,785.32 | 5,918      | 21,485      | コンピュータ・周辺機器        |            |
| ASUSTEK COMPUTER INC                          | 745.54    | 675.54   | 16,212     | 58,853      | コンピュータ・周辺機器        |            |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP                    | 466.16    | 456.16   | 8,781      | 31,875      | 半導体・半導体製造装置        |            |
| ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC        | 7,378.06  | —        | —          | —           | 半導体・半導体製造装置        |            |
| ASIA CEMENT CORP                              | 2,629.28  | 1,949.28 | 8,109      | 29,435      | 建設資材               |            |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP                        | —         | 310      | 6,975      | 25,319      | 電子装置・機器・部品         |            |
| TAIWAN BUSINESS BANK                          | 3,361.71  | 3,714.57 | 4,438      | 16,113      | 銀行                 |            |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP     | 990       | 850      | 5,839      | 21,197      | 半導体・半導体製造装置        |            |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD               | 730       | 650      | 5,622      | 20,409      | コンピュータ・周辺機器        |            |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD                    | 725.43    | 549.75   | 4,150      | 15,066      | コンピュータ・周辺機器        |            |
| QUANTA COMPUTER INC                           | 2,668.58  | 2,608.58 | 15,834     | 57,477      | コンピュータ・周辺機器        |            |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP                  | 900.7     | 920.7    | 4,525      | 16,426      | 不動産管理・開発           |            |
| EVA AIRWAYS CORP                              | 2,861.61  | 1,962.69 | 3,081      | 11,185      | 旅客航空輸送業            |            |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD                     | 687.6     | 627.6    | 16,411     | 59,574      | コンピュータ・周辺機器        |            |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK                     | 5,397.55  | 5,123.45 | 9,401      | 34,127      | 銀行                 |            |
| CHINA AIRLINES                                | 2,321.56  | 2,321.56 | 2,309      | 8,385       | 旅客航空輸送業            |            |
| CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO                 | 2,011.69  | 1,961.69 | 8,072      | 29,302      | 自動車部品              |            |



| 銘 柄                                   | 期 首(前期末)  |           | 当 期 末     |             | 業 種 等       |
|---------------------------------------|-----------|-----------|-----------|-------------|-------------|
|                                       | 株 数       | 株 数       | 評 価 額     |             |             |
|                                       |           |           | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |             |
| (台湾)                                  | 百株        | 百株        | 千台湾・ドル    | 千円          |             |
| CHINA STEEL CORP                      | 13,500.58 | 12,110.58 | 30,579    | 111,002     | 金属・鉱業       |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN    | 2,641.46  | 2,649.94  | 6,704     | 24,336      | 保険          |
| ADVANTECH CO LTD                      | 368.89    | 298.89    | 7,412     | 26,907      | コンピュータ・周辺機器 |
| COMPAL ELECTRONICS INC                | 4,503.04  | 3,913.04  | 7,630     | 27,698      | コンピュータ・周辺機器 |
| DELTA ELECTRONICS INC                 | 2,066.63  | 1,976.63  | 32,021    | 116,237     | 電子装置・機器・部品  |
| NANYA TECHNOLOGY CORP                 | 1,100     | 1,080     | 6,901     | 25,051      | 半導体・半導体製造装置 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD               | 3,903.27  | 3,573.27  | 39,127    | 142,032     | 各種電気通信サービス  |
| AU OPTRONICS CORP                     | 8,801.94  | 8,731.94  | 9,954     | 36,134      | 電子装置・機器・部品  |
| TAIWAN MOBILE CO LTD                  | 1,718     | 1,468     | 16,368    | 59,416      | 無線通信サービス    |
| EVERGREEN MARINE CORP                 | 1,786.58  | 1,982.76  | 2,518     | 9,140       | 海運業         |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP          | 3,418.24  | 3,218.24  | 10,507    | 38,142      | コングロマリット    |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD            | 298.25    | 298.25    | 7,083     | 25,712      | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ECLAT TEXTILE CO LTD                  | 183.22    | 153.22    | 6,504     | 23,610      | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD          | 612.85    | 512.85    | 10,026    | 36,395      | 半導体・半導体製造装置 |
| FORMOSA PLASTICS CORP                 | 4,366.33  | 4,246.33  | 46,284    | 168,014     | 化学          |
| FORMOSA TAFFETA CO LTD                | 650       | 950       | 3,439     | 12,483      | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO          | 3,105.94  | 3,355.94  | 36,411    | 132,175     | 化学          |
| GIANT MANUFACTURING                   | 301.51    | 301.51    | 6,542     | 23,750      | レジャー用品      |
| MEDIATEK INC                          | 1,575.07  | 1,435.07  | 41,401    | 150,288     | 半導体・半導体製造装置 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD        | 7,039.36  | 6,319.36  | 28,563    | 103,685     | 保険          |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD     | 7,093.13  | 6,342.32  | 12,208    | 44,318      | 銀行          |
| HOTAI MOTOR CO LTD                    | 310       | 260       | 10,894    | 39,545      | 専門小売り       |
| FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD | 1,770     | 1,440     | 10,742    | 38,994      | 無線通信サービス    |
| YUANITA FINANCIAL HOLDING CO LTD      | 10,461.41 | 8,761.41  | 15,682    | 56,929      | 資本市場        |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO           | 8,589.2   | 7,749.2   | 34,173    | 124,051     | 保険          |
| CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING          | 13,614.03 | 12,234.03 | 12,234    | 44,409      | 銀行          |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD        | 9,070.28  | 9,361.68  | 22,421    | 81,389      | 銀行          |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY            | 16,345.32 | 12,492.25 | 114,678   | 416,284     | 電子装置・機器・部品  |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD         | 11,374.95 | 10,264.95 | 28,844    | 104,705     | 銀行          |
| LARGAN PRECISION CO LTD               | 102.2     | 92.2      | 42,642    | 154,792     | 電子装置・機器・部品  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD     | 9,989.77  | 9,785.89  | 13,895    | 50,442      | 銀行          |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO        | 8,567.24  | 9,430.61  | 8,232     | 29,885      | 保険          |
| INVENTEC CO LTD                       | 2,680.05  | 2,060.05  | 5,150     | 18,694      | コンピュータ・周辺機器 |
| HTC CORPORATION                       | 568.32    | -         | -         | -           | コンピュータ・周辺機器 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP               | 2,188.45  | 1,848.45  | 8,188     | 29,724      | コンピュータ・周辺機器 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD     | 10,955.33 | 10,584.43 | 12,330    | 44,761      | 銀行          |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD         | 18,500.48 | 16,720.48 | 34,026    | 123,515     | 銀行          |
| MACRONIX INTERNATIONAL                | 1,930     | -         | -         | -           | 半導体・半導体製造装置 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD        | 8,913.27  | 9,322.2   | 19,902    | 72,247      | 銀行          |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC              | 685.6     | 855.6     | 6,485     | 23,542      | 半導体・半導体製造装置 |
| NAN YA PLASTICS CORP                  | 4,998.28  | 4,898.28  | 38,010    | 137,978     | 化学          |
| WISTRON CORP                          | 2,593.01  | 2,669.16  | 6,873     | 24,949      | コンピュータ・周辺機器 |
| POU CHEN CORP                         | 2,369.9   | 2,289.9   | 8,655     | 31,420      | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP        | 5,112.97  | 4,622.97  | 33,655    | 122,168     | 食品          |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP            | 573.92    | 543.92    | 15,692    | 56,962      | 食品・生活必需品小売り |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP            | 1,374.8   | 1,084.8   | 12,475    | 45,284      | 石油・ガス・消耗燃料  |
| PHISON ELECTRONICS CORP               | 166.58    | 126.58    | 3,930     | 14,267      | 半導体・半導体製造装置 |
| RUJENTEX DEVELOPMENT CO LTD           | 906.56    | 543.93    | 2,328     | 8,450       | 不動産管理・開発    |
| RUJENTEX INDUSTRIES LTD               | 687.15    | 338.29    | 2,611     | 9,480       | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD             | 945.88    | 955.88    | 6,882     | 24,982      | 電子装置・機器・部品  |
| SILICONWARE PRECISION INDS            | 2,277.43  | -         | -         | -           | 半導体・半導体製造装置 |
| STANDARD FOODS CORP                   | 706.39    | 346.39    | 1,773     | 6,437       | 食品          |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP  | 1,448.99  | 1,518.99  | 5,870     | 21,311      | 電子装置・機器・部品  |
| TAIWAN CEMENT CORP                    | 3,898.74  | 4,445.61  | 18,649    | 67,697      | 建設資材        |
| TATUNG CO LTD                         | -         | 1,640     | 4,239     | 15,389      | 家庭用耐久財      |
| TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD    | 2,280     | -         | -         | -           | 電気設備        |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR                  | 25,800.83 | 23,370.83 | 611,147   | 2,218,464   | 半導体・半導体製造装置 |

| 銘 柄                                       | 期 首(前期末)         |                  | 当 期 末             |                | 業 種 等       |
|---|------------------|------------------|-------------------|----------------|-------------|
|   | 株 数              | 株 数              | 評 価 額             |                |             |
|   |                  |                  | 外 貨 建 金 額         | 邦 貨 換 算 金 額    |             |
| (台湾)                                      | 百株               | 百株               | 千台湾・ドル            | 千円             |             |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP              | 12,005.25        | 11,565.25        | 14,109            | 51,217         | 半導体・半導体製造装置 |
| WINBOND ELECTRONICS CORP                  | 3,240            | 3,180            | 5,342             | 19,392         | 半導体・半導体製造装置 |
| YAGEO CORP                                | 220              | 231.6            | 7,990             | 29,004         | 電子装置・機器・部品  |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP               | 2,270            | 2,030            | 7,226             | 26,233         | 運送インフラ      |
| ININOLUX CORPORATION                      | 9,643.45         | 8,203.45         | 8,490             | 30,820         | 電子装置・機器・部品  |
| WPG HOLDINGS CO LTD                       | 1,995.26         | 1,432.03         | 5,814             | 21,104         | 電子装置・機器・部品  |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP                   | 205.6            | 190.73           | 5,521             | 20,043         | 機械          |
| TAIMED BIOLOGICS INC                      | 180              | 180              | 3,033             | 11,009         | バイオテクノロジー   |
| PEGATRON CORP                             | 1,955.54         | 1,925.54         | 11,765            | 42,707         | コンピュータ・周辺機器 |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP                | 130              | 90               | 3,640             | 13,215         | 機械          |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP                   | 340              | 310              | 6,789             | 24,644         | 半導体・半導体製造装置 |
| CHAILASE HOLDING CO LTD                   | 1,300.76         | 1,117.37         | 14,916            | 54,148         | 各種金融サービス    |
| ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD               | 1,880            | —                | —                 | —              | 各種電気通信サービス  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD          | 483.85           | 453.85           | 5,105             | 18,534         | 電子装置・機器・部品  |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING      | 8,528.28         | 8,394.12         | 16,536            | 60,027         | 銀行          |
| SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD    | —                | 2,990            | 14,531            | 52,748         | 銀行          |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD             | —                | 3,329.03         | 25,034            | 90,874         | 半導体・半導体製造装置 |
| GLOBALWAFERS CO LTD                       | 210              | 190              | 6,555             | 23,794         | 半導体・半導体製造装置 |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD               | 150              | 150              | 3,802             | 13,803         | 家庭用耐久財      |
| GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD    | 180              | —                | —                 | —              | 電子装置・機器・部品  |
| 小 計                                       | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,833,403<br>87銘柄 | 6,655,254<br>— | <10.8%>     |
| (イギリス)                                    | 百株               | 百株               | 千イギリス・ポンド         | 千円             |             |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC               | —                | 227.56           | 184               | 26,881         | 金属・鉱業       |
| 小 計                                       | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 184<br>1銘柄        | 26,881<br>—    | <0.0%>      |
| (トルコ)                                     | 百株               | 百株               | 千トルコ・リラ           | 千円             |             |
| AKBANK TAS                                | 2,165.63         | 2,958.91         | 1,938             | 37,676         | 銀行          |
| ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS | 215.2            | 197.24           | 402               | 7,822          | 飲料          |
| ARCELIK                                   | 304.29           | 189.02           | 350               | 6,816          | 家庭用耐久財      |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI                 | 176.77           | 317.66           | 679               | 13,215         | 航空宇宙・防衛     |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS     | 1,527.76         | 1,259.6          | 1,161             | 22,576         | 金属・鉱業       |
| FORD OTOMOTIV SANAYI AS                   | 89.14            | 59.19            | 307               | 5,983          | 自動車         |
| KOC HOLDING AS                            | 845.07           | 673.25           | 1,145             | 22,275         | コングロマリット    |
| PETKIM PETROKIMYA HOLDING                 | 801.59           | 881.74           | 417               | 8,107          | 化学          |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS           | 796.24           | 543.97           | 323               | 6,291          | コングロマリット    |
| TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS          | 177.97           | —                | —                 | —              | 自動車         |
| TURK HAVA YOLLARI                         | 578.27           | 490.81           | 704               | 13,691         | 旅客航空輸送業     |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS               | 1,108.41         | 931.18           | 1,219             | 23,713         | 無線通信サービス    |
| TURKIYE GARANTI BANKASI AS                | 2,430.61         | 2,383.94         | 2,074             | 40,319         | 銀行          |
| TURKIYE IS BANKASI                        | 1,625.02         | 1,510.63         | 919               | 17,884         | 銀行          |
| TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE              | 129.01           | 106.81           | 1,408             | 27,387         | 石油・ガス・消耗燃料  |
| ULKER BISKUVI SANAYI AS                   | 131.21           | —                | —                 | —              | 食品          |
| YAPI VE KREDI BANKASI AS                  | 735.99           | —                | —                 | —              | 銀行          |
| HACI OMER SABANCI HOLDING AS              | 983.54           | 1,091.14         | 892               | 17,351         | 各種金融サービス    |
| COCA-COLA ICECEK AS                       | 64.51            | —                | —                 | —              | 飲料          |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS                 | 218.17           | 190.11           | 1,533             | 29,806         | 食品・生活必需品小売り |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO              | 907.31           | —                | —                 | —              | 銀行          |
| TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS              | 137.35           | 137.35           | 332               | 6,472          | 運送インフラ      |
| TURKIYE HALK BANKASI AS                   | 619.7            | 619.7            | 394               | 7,673          | 銀行          |
| TURK TELEKOMUNIKASYON AS                  | 562              | —                | —                 | —              | 各種電気通信サービス  |
| 小 計                                       | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 16,207<br>18銘柄    | 315,065<br>—   | <0.5%>      |
| (メキシコ)                                    | 百株               | 百株               | 千メキシコ・ペソ          | 千円             |             |
| ALFA SAB DE CV                            | 3,062            | 2,641            | 5,379             | 32,009         | コングロマリット    |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV                 | 538              | —                | —                 | —              | 飲料          |
| EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV          | 191              | 191              | 2,286             | 13,604         | 複合小売り       |

| 銘 柄  | 期 首(前期末)         |                  | 当 期 末           |                     | 業 種 等              |
|--|------------------|------------------|-----------------|---------------------|--------------------|
|  | 株 数              | 株 数              | 評 価 額           |                     |                    |
|  |                  |                  | 外 貨 建 金 額       | 邦 貨 換 算 金 額         |                    |
| <b>(メキシコ)</b>                              | 百株               | 百株               | 千メキシコ・ペソ        | 千円                  |                    |
| GRUPO TELEVISIVA SAB                       | 2,614            | 2,389            | 9,718           | 57,824              | メディア               |
| GRUPO BIMBO SAB DE CV                      | 1,644            | 1,626            | 6,588           | 39,201              | 食品                 |
| GRUMA SAB DE CV                            | 245.7            | 216.4            | 4,322           | 25,716              | 食品                 |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA   | 220.3            | 202.6            | 3,867           | 23,011              | 運送インフラ             |
| GRUPO CARSO SAB DE CV                      | 543              | 376              | 2,745           | 16,338              | コングロマリット           |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV         | 2,616            | 2,484            | 30,533          | 181,673             | 銀行                 |
| MEXICHEM SAB DE CV                         | 1,082.25         | 940.25           | 4,305           | 25,617              | 化学                 |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV               | 147              | 161.55           | 3,703           | 22,036              | 金属・鉱業              |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV         | 1,567            | 1,343            | 4,579           | 27,248              | 家庭用品               |
| ALSEA SAB DE CV                            | -                | 437              | 1,959           | 11,661              | ホテル・レストラン・レジャー     |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV  | 206.85           | 204.65           | 6,310           | 37,549              | 運送インフラ             |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV                     | 4,110.52         | 3,389.52         | 19,913          | 118,484             | 金属・鉱業              |
| AMERICA MOVIL SAB DE CV                    | 35,278.78        | 32,125.78        | 47,899          | 285,002             | 無線通信サービス           |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA SA                | 2,447            | 1,988            | 5,741           | 34,160              | 銀行                 |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV                 | 434              | 426              | 4,559           | 27,126              | 飲料                 |
| WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV               | 5,462            | 4,962            | 27,519          | 163,739             | 食品・生活必需品小売り        |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV | 397              | 312              | 6,083           | 36,196              | 運送インフラ             |
| MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV               | -                | 274              | 2,493           | 14,838              | メディア               |
| GENERATA SAB DE CV                         | 1,030            | -                | -               | -                   | 消費者金融              |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV  | 532              | 544              | 4,579           | 27,247              | ガス                 |
| BANCO SANTANDER MEXICO SA                  | 1,953.9          | 1,545.9          | 5,024           | 29,893              | 銀行                 |
| GRUPO LALA SAB DE CV                       | 504              | -                | -               | -                   | 食品                 |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV                  | -                | 515              | 6,283           | 37,386              | 飲料                 |
| 小 計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 216,398<br>23銘柄 | 1,287,571<br><2.1%> |                    |
| <b>(フィリピン)</b>                             | 百株               | 百株               | 千フィリピン・ペソ       | 千円                  |                    |
| AYALA LAND INC                             | 7,964            | 7,186            | 33,774          | 73,290              | 不動産管理・開発           |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC                | 2,309.4          | 1,798.9          | 9,893           | 21,469              | コングロマリット           |
| BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND              | 1,040.86         | 855.7            | 7,102           | 15,412              | 銀行                 |
| AYALA CORP                                 | 248.03           | 244.33           | 21,989          | 47,717              | 各種金融サービス           |
| ALLIANCE GLOBAL GROUP INC                  | 3,406            | 3,077            | 4,609           | 10,002              | コングロマリット           |
| DMCI HOLDINGS INC                          | 3,518.5          | 3,518.5          | 4,222           | 9,162               | コングロマリット           |
| GLOBE TELECOM INC                          | 27.85            | 27.85            | 5,194           | 11,271              | 無線通信サービス           |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC  | 406.8            | 814.2            | 10,503          | 22,791              | 運送インフラ             |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC                     | 2,900.5          | 2,892.4          | 17,744          | 38,506              | コングロマリット           |
| JOLLIBEE FOODS CORP                        | 441.3            | 437.2            | 13,290          | 28,841              | ホテル・レストラン・レジャー     |
| METROPOLITAN BANK & TRUST                  | 820.37           | 1,449.97         | 11,309          | 24,542              | 銀行                 |
| BDO UNIBANK INC                            | 2,130.13         | 1,925.83         | 25,420          | 55,163              | 銀行                 |
| MEGAWORLD CORP                             | 9,620            | 9,620            | 5,473           | 11,878              | 不動産管理・開発           |
| PLDT INC                                   | 95.2             | 86               | 10,526          | 22,842              | 無線通信サービス           |
| ROBINSONS LAND CORP                        | 2,187.22         | 2,187.22         | 5,314           | 11,533              | 不動産管理・開発           |
| SECURITY BANK CORP                         | 234.2            | 234.2            | 4,215           | 9,147               | 銀行                 |
| SM PRIME HOLDINGS INC                      | 9,369.75         | 9,700.75         | 38,414          | 83,360              | 不動産管理・開発           |
| UNIVERSAL ROBINA CORP                      | 902.1            | 791.3            | 12,027          | 26,100              | 食品                 |
| SM INVESTMENTS CORP                        | 241.58           | 219.38           | 20,402          | 44,273              | コングロマリット           |
| METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP             | 18,109           | 11,489           | 5,147           | 11,169              | 各種金融サービス           |
| ABOITIZ POWER CORP                         | 2,163            | 1,282            | 4,608           | 10,001              | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| MANILA ELECTRIC COMPANY                    | 240              | 234.3            | 8,879           | 19,269              | 電力                 |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC                    | 90.7             | 91.37            | 7,876           | 17,091              | 各種金融サービス           |
| 小 計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 287,943<br>23銘柄 | 624,836<br><1.0%>   |                    |
| <b>(チリ)</b>                                | 百株               | 百株               | 千チリ・ペソ          | 千円                  |                    |
| BANCO SANTANDER CHILE                      | 70,291.7         | 64,144.7         | 315,207         | 53,364              | 銀行                 |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES             | 45.34            | 47.7             | 217,860         | 36,883              | 銀行                 |
| BANCO DE CHILE                             | 27,488.49        | 22,134.93        | 220,441         | 37,320              | 銀行                 |
| EMPRESAS CMPC SA                           | 1,248.39         | 1,115.77         | 255,399         | 43,239              | 紙製品・林産品            |
| EMPRESAS COPEC SA                          | 392.14           | 376.73           | 325,080         | 55,036              | 石油・ガス・消耗燃料         |

| 銘柄  | 期首(前期末)          |                    | 当期                 |                | 業種等                |
|---|------------------|--------------------|--------------------|----------------|--------------------|
|   | 株数               | 株数                 | 評価額                |                |                    |
|   |                  |                    | 外貨建金額              | 邦貨換算金額         |                    |
| <b>(チリ)</b>                               | 百株               | 百株                 | 千チリ・ペソ             | 千円             |                    |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS SA                 | 151.7            | 130.24             | 123,728            | 20,947         | 飲料                 |
| ENTEL CHILE SA                            | 165              | 135.72             | 95,954             | 16,245         | 無線通信サービス           |
| ENEL AMERICAS SA                          | 30,871.2         | 28,187.18          | 332,552            | 56,301         | 電力                 |
| COLBUIN SA                                | 9,365.35         | 8,191.36           | 125,901            | 21,315         | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AGUAS ANDINAS SA                          | 3,253.57         | 2,240.14           | 85,774             | 14,521         | 水道                 |
| EMBOTELLADORA ANDINA SA                   | 272.7            | 404.01             | 99,984             | 16,927         | 飲料                 |
| LATAM AIRLINES GROUP SA                   | 326.04           | 306.55             | 220,102            | 37,263         | 旅客航空輸送業            |
| SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA     | 93.43            | 106.24             | 271,974            | 46,045         | 化学                 |
| SACI FALABELLA                            | 774.28           | 674.78             | 338,807            | 57,360         | 複合小売り              |
| ITAU CORPBANCA                            | 194,162.26       | 132,369.77         | 79,805             | 13,511         | 銀行                 |
| CENCOSUD SA                               | 1,483.98         | 1,511.41           | 210,977            | 35,718         | 食品・生活必需品小売り        |
| AES GENER SA                              | 2,571.35         | -                  | -                  | -              | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ENEL CHILE SA                             | 26,991.19        | 28,910.6           | 201,477            | 34,110         | 電力                 |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 369,948.11<br>18銘柄 | 290,987.83<br>17銘柄 | 3,521,029<br>- | 596,110<br><1.0%>  |
| <b>(コロンビア)</b>                            | 百株               | 百株                 | 千コロンビア・ペソ          | 千円             |                    |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP            | 453.24           | 441.5              | 719,645            | 25,547         | 電力                 |
| ECOPETROL SA                              | 4,479.53         | 4,555.98           | 1,380,461          | 49,006         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF | 101.38           | 101.38             | 345,705            | 12,272         | 各種金融サービス           |
| GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF     | 3,736.94         | 3,418.31           | 447,798            | 15,896         | 銀行                 |
| CEMENTOS ARGOS SA                         | 622.75           | 377.2              | 305,909            | 10,859         | 建設資材               |
| GRUPO ARGOS SA                            | 271.99           | 282.17             | 503,955            | 17,890         | 建設資材               |
| BANCOLOMBIA SA                            | 259.2            | 209.47             | 860,502            | 30,547         | 銀行                 |
| BANCOLOMBIA SA-PREF                       | 471.49           | 449.76             | 1,863,805          | 66,165         | 銀行                 |
| GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA      | 254.28           | 240.67             | 850,046            | 30,176         | 各種金融サービス           |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 10,650.8<br>9銘柄    | 10,076.44<br>9銘柄   | 7,277,830<br>- | 258,362<br><0.4%>  |
| <b>(カタール)</b>                             | 百株               | 百株                 | 千カタール・リアル          | 千円             |                    |
| QATAR INSURANCE CO SAQ                    | 174.87           | 144.17             | 570                | 17,512         | 保険                 |
| QATAR NATIONAL BANK                       | 242.17           | 429.98             | 7,781              | 238,822        | 銀行                 |
| COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC              | 217.11           | 182.02             | 844                | 25,914         | 銀行                 |
| OOREDOO QSC                               | 84.1             | 67.6               | 438                | 13,445         | 各種電気通信サービス         |
| DOHA BANK QSC                             | 180.35           | -                  | -                  | -              | 銀行                 |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO              | 32.22            | 50.5               | 856                | 26,300         | 総合公益事業             |
| INDUSTRIES QATAR QSC                      | 155.52           | 174.05             | 2,193              | 67,304         | コンプロマリット           |
| QATAR ISLAMIC BANK SAQ                    | 69.65            | 114.06             | 1,877              | 57,635         | 銀行                 |
| QATAR GAS TRANSPORT CO LTD                | 285.29           | -                  | -                  | -              | 石油・ガス・消耗燃料         |
| MASRAF AL RAYAN                           | 389.23           | 365.35             | 1,329              | 40,813         | 銀行                 |
| BARWA REAL ESTATE CO                      | 79.16            | 167.63             | 592                | 18,170         | 不動産管理・開発           |
| EZDAN HOLDING GROUP QSC                   | 844.31           | 694.16             | 770                | 23,647         | 不動産管理・開発           |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,753.98<br>12銘柄   | 2,389.52<br>10銘柄   | 17,255<br>-    | 529,567<br><0.9%>  |
| <b>(インド)</b>                              | 百株               | 百株                 | 千インド・ルピー           | 千円             |                    |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD                   | 2,984.36         | 2,705.06           | 363,492            | 592,492        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD                 | 748.55           | 729.4              | 26,076             | 42,503         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ASIAN PAINTS LTD                          | 286.21           | 278.04             | 40,566             | 66,122         | 化学                 |
| EICHER MOTORS LTD                         | 14.43            | 12.23              | 26,013             | 42,402         | 自動車                |
| GRASIM INDUSTRIES LTD                     | 356.29           | 326.39             | 28,838             | 47,006         | 建設資材               |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD                   | 800.51           | 721.96             | 49,678             | 80,975         | 自動車                |
| SHREE CEMENT LTD                          | 8.3              | 8.46               | 16,577             | 27,021         | 建設資材               |
| ICICI BANK LTD                            | 2,503.82         | 2,271.54           | 92,451             | 150,696        | 銀行                 |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD              | 657.34           | 584.63             | 15,472             | 25,219         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| STATE BANK OF INDIA LTD                   | 1,838.08         | 1,709.63           | 53,981             | 87,989         | 銀行                 |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD               | 36.57            | 189.35             | 9,698              | 15,808         | 陸運・鉄道              |
| LIC HOUSING FINANCE LTD                   | 343.15           | 262.42             | 13,735             | 22,388         | 貯蓄・抵当・不動産金融        |
| TATA STEEL LTD                            | 374.27           | 301.06             | 16,656             | 27,149         | 金属・鉱業              |
| TATA MOTORS LTD                           | 1,746.54         | 1,561.48           | 35,992             | 58,667         | 自動車                |

| 銘柄                                | 期首(前期末)  | 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  |  |                    |
| (インド)                             | 百株       | 百株       | 千インド・ルピー | 千円      |  |                    |
| JSW STEEL LTD                     | 860      | 834.15   | 24,290   | 39,593  |  | 金属・鉱業              |
| TATA POWER CO LTD                 | 1,147.7  | 1,004.83 | 7,179    | 11,702  |  | 電力                 |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD          | 33.39    | 57.51    | 17,370   | 28,314  |  | 食品                 |
| NESTLE INDIA LTD                  | 23.43    | 22.5     | 25,100   | 40,913  |  | 食品                 |
| BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD      | 736.48   | —        | —        | —       |  | 電気設備               |
| GAIL INDIA LTD                    | 689.58   | 700.27   | 24,621   | 40,133  |  | ガス                 |
| VEDANTA LTD                       | 1,603.88 | 1,150.72 | 21,282   | 34,690  |  | 金属・鉱業              |
| AXIS BANK LTD                     | 1,895.45 | 1,810.46 | 139,604  | 227,555 |  | 銀行                 |
| TITAN COMPANY LTD                 | 311.53   | 276.48   | 30,967   | 50,476  |  | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD        | 1,215.18 | 1,226.55 | 19,679   | 32,078  |  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| LUPIN LTD                         | 225      | 224.53   | 18,702   | 30,484  |  | 医薬品                |
| ACC LTD                           | 39.22    | —        | —        | —       |  | 建設資材               |
| BAJAJ FINANCE LTD                 | 175.42   | 165.95   | 50,324   | 82,028  |  | 消費者金融              |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP  | 1,591.84 | 1,555.5  | 315,253  | 513,862 |  | 貯蓄・抵当・不動産金融        |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD | 581.63   | 438.7    | 18,230   | 29,715  |  | メディア               |
| INFOSYS LTD                       | 1,833.01 | 3,320.56 | 240,441  | 391,920 |  | 情報技術サービス           |
| WIPRO LTD                         | 1,215.45 | 1,346.1  | 37,811   | 61,633  |  | 情報技術サービス           |
| INDIAN OIL CORP LTD               | 1,166.92 | 1,682.52 | 26,196   | 42,700  |  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD            | 683.93   | 615.5    | 107,007  | 174,422 |  | 家庭用品               |
| HCL TECHNOLOGIES LTD              | 592.5    | 518.18   | 57,365   | 93,505  |  | 情報技術サービス           |
| DABUR INDIA LTD                   | 613.72   | 515.6    | 21,088   | 34,373  |  | パーソナル用品            |
| HERO MOTOCORP LTD                 | 47.9     | 45.09    | 12,353   | 20,135  |  | 自動車                |
| DR REDDYS LABORATORIES LTD        | 115.96   | 103.89   | 29,349   | 47,840  |  | 医薬品                |
| BHARTI AIRTEL LTD                 | 1,486.01 | 1,351.06 | 47,118   | 76,802  |  | 無線通信サービス           |
| UNITED SPIRITS LTD                | 63.66    | 292.61   | 16,270   | 26,521  |  | 飲料                 |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | 1,027.77 | 813.13   | 37,611   | 61,306  |  | 医薬品                |
| DIVI'S LABORATORIES LTD           | —        | 77.03    | 13,207   | 21,528  |  | ライフサイエンス・ツール/サービス  |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD           | 112.21   | 101.11   | 75,413   | 122,923 |  | 自動車                |
| GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD      | 170.84   | 136.89   | 8,799    | 14,343  |  | 医薬品                |
| AUROBINDO PHARMA LTD              | 304.26   | 262.23   | 20,516   | 33,442  |  | 医薬品                |
| HAVELLS INDIA LTD                 | 248      | 264.92   | 20,084   | 32,738  |  | 電気設備               |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD        | 644.6    | 950.48   | 15,036   | 24,509  |  | 自動車部品              |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD  | 150.42   | 138.34   | 17,010   | 27,726  |  | 消費者金融              |
| PETRONET LNG LTD                  | 702.38   | 528.75   | 12,721   | 20,736  |  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CIPLA LTD/INDIA                   | 355      | 318.7    | 17,826   | 29,057  |  | 医薬品                |
| LARSEN & TOUBRO LTD               | 504.12   | 456.02   | 62,994   | 102,681 |  | 建設・土木              |
| ULTRATECH CEMENT LTD              | 96.16    | 93.55    | 39,805   | 64,883  |  | 建設資材               |
| ASHOK LEYLAND LTD                 | 1,138.2  | 1,108.86 | 10,683   | 17,414  |  | 機械                 |
| BOSCH LTD                         | 7.74     | 6.87     | 12,553   | 20,462  |  | 自動車部品              |
| TATA CONSULTANCY SERVICES LTD     | 481.21   | 853.92   | 182,038  | 296,723 |  | 情報技術サービス           |
| NTPC LTD                          | 1,803.33 | 2,100.66 | 28,894   | 47,098  |  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD           | 82       | 74.74    | 19,977   | 32,563  |  | 医薬品                |
| YES BANK LTD                      | 1,816.38 | 1,622.58 | 43,233   | 70,470  |  | 銀行                 |
| AMBUJA CEMENTS LTD                | 722.16   | 546.35   | 12,675   | 20,660  |  | 建設資材               |
| BHARAT FORGE LTD                  | 237.4    | 184.21   | 9,362    | 15,260  |  | 自動車部品              |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD           | 1,156.54 | 1,161.35 | 24,963   | 40,690  |  | 金属・鉱業              |
| ITC LTD                           | 3,583.67 | 3,281.99 | 100,822  | 164,341 |  | タバコ                |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD           | —        | 116.66   | 15,069   | 24,563  |  | 化学                 |
| UNITED PHOSPHORUS LTD             | 361.1    | 348.38   | 32,535   | 53,032  |  | 化学                 |
| SIEMENS INDIA LTD                 | 62.19    | —        | —        | —       |  | コンプロマリット           |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD      | 238.24   | 328.23   | 21,932   | 35,749  |  | パーソナル用品            |
| TECH MAHINDRA LTD                 | 467.41   | 455.27   | 36,335   | 59,226  |  | 情報技術サービス           |
| VODAFONE IDEA LTD                 | 1,965.27 | 1,965.27 | 5,699    | 9,289   |  | 無線通信サービス           |
| MARICO LTD                        | 453.8    | 456.6    | 16,620   | 27,090  |  | パーソナル用品            |
| POWER FINANCE CORP LTD            | 659.1    | —        | —        | —       |  | 各種金融サービス           |
| PAGE INDUSTRIES LTD               | —        | 5.28     | 12,585   | 20,514  |  | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD      | —        | 1,710.78 | 33,676   | 54,893  |  | 電力                 |

| 銘柄  | 期首(前期末)           |          | 当期          |           | 業種等         |
|---|-------------------|----------|-------------|-----------|-------------|
|   | 株数                | 株数       | 評価額         |           |             |
|   |                   |          | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |             |
| <b>(インド)</b>                                  | 百株                | 百株       | 千インド・ルピー    | 千円        |             |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE REC LTD | 716.16            | 508.92   | 20,135      | 32,820    | 運送インフラ      |
| BAJAJ FINSERV LTD                             | 856.77            | 551.73   | 8,300       | 13,530    | 各種金融サービス    |
| BAJAJ AUTO LTD                                | 37.2              | 37.23    | 28,216      | 45,992    | 保険          |
| COAL INDIA LTD                                | 84.02             | 79.67    | 24,446      | 39,847    | 自動車         |
| TATA MOTORS LTD                               | 759.01            | 1,124.57 | 28,294      | 46,119    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| VAKRANGEE LTD                                 | 315.68            | —        | —           | —         | 自動車         |
| MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD    | 359.54            | —        | —           | —         | 情報技術サービス    |
| BHARTI INFRATEL LTD                           | 329.95            | 289.33   | 12,185      | 19,861    | 消費者金融       |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD                | 283.64            | 322.96   | 10,107      | 16,474    | 各種電気通信サービス  |
| TATA STEEL LTD-PARTLY PAID                    | 344.12            | 254.66   | 21,199      | 34,554    | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| CADILA HEALTHCARE LTD                         | 23.33             | 23.33    | 223         | 363       | 金属・鉱業       |
| AVENUE SUPERMARTS LTD                         | 181.46            | 169.62   | 5,731       | 9,342     | 医薬品         |
| IDFC BANK LTD                                 | —                 | 112.16   | 15,821      | 25,789    | 食品・生活必需品小売り |
| INTERGLOBE AVIATION LTD                       | 1,144.21          | —        | —           | —         | 銀行          |
|   | —                 | 83       | 13,129      | 21,401    | 旅客航空輸送業     |
| 小計  | 株数・金・額<br>銘柄数<比率> | 株数       | 3,245,320   | 5,289,872 |             |
|   | 80銘柄              | 79銘柄     | —           | <8.6%>    |             |
| <b>(パキスタン)</b>                                | 百株                | 百株       | 千パキスタン・ルピー  | 千円        |             |
| LUCKY CEMENT LTD                              | 99                | —        | —           | —         | 建設資材        |
| MCB BANK LTD                                  | 390               | 390      | 7,264       | 5,811     | 銀行          |
| OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD                  | 745               | 745      | 10,622      | 8,497     | 石油・ガス・消耗燃料  |
| UNITED BANK LTD                               | 514               | —        | —           | —         | 銀行          |
| HABIB BANK LTD                                | 544               | 544      | 6,597       | 5,278     | 銀行          |
| 小計  | 株数・金・額<br>銘柄数<比率> | 株数       | 24,483      | 19,587    |             |
|   | 5銘柄               | 3銘柄      | —           | <0.0%>    |             |
| <b>(インドネシア)</b>                               | 百株                | 百株       | 千インドネシア・ルピア | 千円        |             |
| AKR CORPORINDO TBK PT                         | 1,504             | —        | —           | —         | 商社・流通業      |
| UNITED TRACTORS TBK PT                        | 1,692.01          | 1,670.01 | 4,413,001   | 35,304    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT                 | 4,792             | 4,588    | 2,959,260   | 23,674    | 食品          |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT                     | 1,673             | 1,375    | 6,792,500   | 54,340    | 家庭用品        |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK                    | 21,705            | 19,392   | 15,028,800  | 120,230   | 自動車         |
| TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK          | 53,615            | 47,363   | 18,329,481  | 146,635   | 各種電気通信サービス  |
| CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT             | 8,456             | 6,756    | 4,171,830   | 33,374    | 食品          |
| GUDANG GARAM TBK PT                           | 486               | 448      | 3,692,640   | 29,541    | タバコ         |
| HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK                 | 9,248             | 7,955    | 2,967,215   | 23,737    | タバコ         |
| INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT            | 1,856             | 1,803    | 3,876,450   | 31,011    | 建設資材        |
| INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT         | —                 | 2,620    | 2,037,050   | 16,296    | 紙製品・林産品     |
| BUKIT ASAM TBK PT                             | —                 | 2,567    | 1,021,666   | 8,173     | 石油・ガス・消耗燃料  |
| BANK DANAMON INDONESIA TBK PT                 | 2,904.16          | 2,613.16 | 2,462,903   | 19,703    | 銀行          |
| BANK MANDIRI                                  | 19,918            | 17,900   | 13,648,750  | 109,190   | 銀行          |
| MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK                 | 2,765             | —        | —           | —         | 複合小売り       |
| PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT              | —                 | 980      | 1,026,550   | 8,212     | 紙製品・林産品     |
| BANK RAKYAT INDONESIA                         | 58,799            | 52,904   | 22,960,336  | 183,682   | 銀行          |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA PT                      | 10,641            | 10,641   | 2,511,276   | 20,090    | ガス          |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT          | 7,443             | 7,244    | 7,026,680   | 56,213    | 銀行          |
| KALBE FARMA TBK PT                            | 24,762            | 18,222   | 2,724,189   | 21,793    | 医薬品         |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT                | 3,303             | 2,765    | 3,684,362   | 29,474    | 建設資材        |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT                      | 10,390            | 9,338    | 25,656,155  | 205,249   | 銀行          |
| XL AXIATA TBK PT                              | 2,907             | —        | —           | —         | 無線通信サービス    |
| JASA MARGA PERSERO TBK PT                     | 2,001.25          | 2,001.25 | 1,220,762   | 9,766     | 運送インフラ      |
| BUMI SERPONG DAMAI PT                         | 8,517             | 7,465    | 1,052,565   | 8,420     | 不動産管理・開発    |
| ADARO ENERGY PT                               | 14,345            | 14,345   | 1,872,022   | 14,976    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| PAKUWON JATI TBK                              | 19,128            | 16,599   | 1,195,128   | 9,561     | 不動産管理・開発    |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT             | 2,390             | 2,385    | 2,164,387   | 17,315    | 食品          |
| TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT           | 1,808             | 1,808    | 690,656     | 5,525     | 各種電気通信サービス  |
| BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT                   | 4,803             | 4,803    | 1,239,174   | 9,913     | 銀行          |
| WASKITA KARYA PERSERO TBK PT                  | 3,920             | —        | —           | —         | 建設・土木       |

| 銘柄   | 期首(前期末)          |                    | 当期                 |                  | 業種等                     |
|--|------------------|--------------------|--------------------|------------------|-------------------------|
|  | 株数               | 株数                 | 評価額                |                  |                         |
|  |                  |                    | 外貨建金額              | 邦貨換算金額           |                         |
| (インドネシア)   | 百株               | 百株                 | 千円                 | 千円               |                         |
| PT SURYA CITRA MEDIA TBK                           | 5,113            | 5,113              | 892,218            | 7,137            | メディア                    |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 310,884.42<br>29銘柄 | 273,663.42<br>28銘柄 | 157,318,009<br>- | 1,258,544<br><2.0%>     |
| (アラブ首長国連邦)   | 百株               | 百株                 | 千円                 | 千円               |                         |
| DUBAI ISLAMIC BANK PJSC                            | 1,260            | 1,361.45           | 697                | 21,295           | 銀行                      |
| EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC          | 1,869.09         | 1,648.45           | 2,739              | 83,698           | 各種電気通信サービス              |
| DUBAI INVESTMENTS PJSC                             | 1,322.22         | -                  | -                  | -                | コンピュータリット               |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC                     | 2,083.32         | 2,010.06           | 1,887              | 57,661           | 銀行                      |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC                          | 1,528.79         | 2,589.74           | 4,122              | 125,953          | 銀行                      |
| EMAAR PROPERTIES PJSC                              | 3,868.87         | 3,431.66           | 1,705              | 52,104           | 不動産管理・開発                |
| ALDAR PROPERTIES PJSC                              | 3,000            | 3,561.42           | 644                | 19,693           | 不動産管理・開発                |
| EMAAR DEVELOPMENT PJSC                             | -                | 774.63             | 292                | 8,945            | 不動産管理・開発                |
| EMAAR MALLS PJSC                                   | 1,781.66         | 1,781.66           | 297                | 9,089            | 不動産管理・開発                |
| DXB ENTERTAINMENTS PJSC                            | 2,727.83         | -                  | -                  | -                | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC                     | 1,902.35         | 1,902.35           | 251                | 7,671            | 不動産管理・開発                |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 21,344.13<br>10銘柄  | 19,061.42<br>9銘柄   | 12,638<br>-      | 386,112<br><0.6%>       |
| (ブラジル)   | 百株               | 百株                 | 千円                 | 千円               |                         |
| BRF SA   | 442.92           | 474.92             | 1,340              | 38,102           | 食品                      |
| VALE SA  | 3,340.21         | 3,005.21           | 15,702             | 446,257          | 金属・鉱業                   |
| RAIA DROGASIL SA                                   | 234              | 206                | 1,333              | 37,908           | 食品・生活必需品小売り             |
| TIM PARTICIPACOES SA                               | 950              | 763                | 906                | 25,761           | 無線通信サービス                |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA                  | 194.5            | 238.5              | 800                | 22,754           | 電力                      |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA                  | 294              | 198                | 621                | 17,674           | 電力                      |
| BANCO DO BRASIL SA                                 | 907              | 847                | 3,997              | 113,618          | 銀行                      |
| INVESTIMENTOS ITAU SA                              | 4,166.86         | 4,323.6            | 4,959              | 140,939          | 銀行                      |
| LOJAS AMERICANAS SA                                | 744.74           | 770.74             | 1,153              | 32,769           | 複合小売り                   |
| GERDAU SA  | 1,022.3          | 1,010.3            | 1,513              | 43,011           | 金属・鉱業                   |
| CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR | 170.06           | 158.06             | 1,446              | 41,102           | 食品・生活必需品小売り             |
| PETROLEO BRASILEIRO SA                             | 3,075.1          | 2,782.1            | 8,396              | 238,625          | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA                         | -                | 328                | 729                | 20,740           | 専門小売り                   |
| PETROLEO BRASILEIRO SA                             | 4,104.12         | 3,774.12           | 10,095             | 286,921          | 石油・ガス・消耗燃料              |
| KROTON EDUCACIONAL SA                              | 1,482.68         | 1,373.68           | 1,344              | 38,220           | 各種消費者サービス               |
| CCR SA   | 1,328.2          | 1,214.2            | 1,404              | 39,925           | 運送インフラ                  |
| WEG SA   | 564.4            | 900.72             | 1,667              | 47,382           | 機械                      |
| BANCO BRADESCO SA PREF                             | 3,513.25         | 3,505.5            | 12,016             | 341,518          | 銀行                      |
| BANCO BRADESCO SA                                  | 1,079.18         | 997.41             | 3,000              | 85,265           | 銀行                      |
| NATURA COSMETICOS SA                               | 194              | 198                | 902                | 25,659           | パーソナル用品                 |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA                        | 616.06           | 617.06             | 947                | 26,919           | 金属・鉱業                   |
| SUZANO SA  | 470              | 523.75             | 2,163              | 61,474           | 紙製品・林産品                 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA                           | 3,386.98         | 4,639.47           | 15,027             | 427,074          | 銀行                      |
| PORTO SEGURO SA                                    | 126              | 88                 | 496                | 14,107           | 保険                      |
| FIBRIA CELULOSE SA                                 | 246.9            | -                  | -                  | -                | 紙製品・林産品                 |
| B2W CIA DIGITAL                                    | -                | 162                | 587                | 16,703           | インターネット販売・通信販売          |
| BRASKEM SA   | 170.3            | 157.3              | 768                | 21,847           | 化学                      |
| ENGIE BRASIL SA                                    | 173.7            | 211.87             | 896                | 25,476           | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| LOCALIZA RENT A CAR                                | 511.8            | 584.8              | 1,899              | 53,981           | 陸運・鉄道                   |
| TELEFONICA BRASIL S.A.                             | 472.28           | 434.28             | 2,019              | 57,391           | 各種電気通信サービス              |
| LOJAS RENNNER SA                                   | 772.7            | 713.7              | 2,918              | 82,938           | 複合小売り                   |
| EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA                        | 318.64           | -                  | -                  | -                | 電力                      |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA                          | 381.52           | 358.52             | 1,594              | 45,311           | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COSAN SA   | 165              | 162                | 726                | 20,649           | 石油・ガス・消耗燃料              |
| EQUATORIAL ENERGIA SA                              | 224              | 177                | 1,382              | 39,286           | 電力                      |
| EMBRAER SA   | 670.6            | 656.6              | 1,249              | 35,511           | 航空宇宙・防衛                 |
| M DIAS BRANCO SA                                   | 104              | 104                | 419                | 11,926           | 食品                      |
| TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA        | 250              | -                  | -                  | -                | 電力                      |
| ODONTOPREV SA                                      | 322              | -                  | -                  | -                | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘柄  | 期首(前期末)          |                   | 当期               |              | 業種等                     |
|---|------------------|-------------------|------------------|--------------|-------------------------|
|   | 株数               | 株数                | 評価額              |              |                         |
|   |                  |                   | 外貨建金額            | 邦貨換算金額       |                         |
| <b>(ブラジル)</b>                                   | 百株               | 百株                | 千ブラジル・レアル        | 千円           |                         |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA                       | 855.65           | 765.65            | 927              | 26,351       | 不動産管理・開発                |
| JBS SA  | 899              | 900               | 1,719            | 48,853       | 食品                      |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS                  | 962.49           | 794.49            | 1,094            | 31,114       | 電力                      |
| CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO | 346.98           | 338.98            | 1,383            | 39,305       | 水道                      |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA       | 103.8            | 344.4             | 768              | 21,826       | 不動産管理・開発                |
| SUL AMERICA SA                                  | 178.69           | 178.69            | 561              | 15,946       | 保険                      |
| HYPERA SA                                       | 350              | 365               | 916              | 26,036       | 医薬品                     |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO                       | 2,181.16         | 1,987.16          | 6,180            | 175,637      | 資本市場                    |
| MAGAZINE LUIZA SA                               | -                | 75                | 1,198            | 34,065       | 複合小売り                   |
| QUALICORP SA                                    | 220              | -                 | -                | -            | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA                       | 408              | 408               | 1,793            | 50,984       | 銀行                      |
| CIELO SA  | 1,293.07         | 1,113.07          | 990              | 28,153       | 情報技術サービス                |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES                     | 740              | 689               | 1,918            | 54,514       | 保険                      |
| ITAUSA - INVESTIMENTOS ITAU SA-RCT              | 76.42            | -                 | -                | -            | 銀行                      |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA | 445              | 373               | 742              | 21,095       | 食品・生活必需品小売り             |
| AMBEV SA  | 4,941.95         | 4,481.95          | 7,641            | 217,177      | 飲料                      |
| KLABIN SA                                       | 643              | 648               | 1,071            | 30,460       | 容器・包装                   |
| RUMO SA   | 1,082            | 1,080             | 1,901            | 54,051       | 陸運・鉄道                   |
| IRB BRASIL RESSEGUROS S/A                       | -                | 137               | 1,301            | 36,988       | 保険                      |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 52,917.21<br>54銘柄 | 51,338.8<br>52銘柄 | 138,540<br>- | 3,937,324<br><6.4%>     |
| <b>(チェコ)</b>                                    | 百株               | 百株                | 千チェコ・コルナ         | 千円           |                         |
| KOMERCNI BANKA AS                               | 71               | 71.13             | 6,440            | 31,753       | 銀行                      |
| O2 CZECH REPUBLIC AS                            | 56.77            | -                 | -                | -            | 各種電気通信サービス              |
| CEZ   | 179.78           | 150.14            | 8,092            | 39,896       | 電力                      |
| MONETA MONEY BANK AS                            | 572.58           | 551.83            | 4,403            | 21,709       | 銀行                      |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 880.13<br>4銘柄     | 773.1<br>3銘柄     | 18,936<br>-  | 93,359<br><0.2%>        |
| <b>(韓国)</b>                                     | 百株               | 百株                | 千韓国・ウォン          | 千円           |                         |
| CHEIL WORLDWIDE INC                             | 70.97            | 75.51             | 189,152          | 18,707       | メディア                    |
| HANMI SCIENCE CO LTD                            | 11.64            | 11.87             | 89,499           | 8,851        | 医薬品                     |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD                    | 41               | 31.24             | 261,478          | 25,860       | 自動車                     |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC                  | 32.87            | 29.4              | 873,180          | 86,357       | 保険                      |
| DB INSURANCE CO LTD                             | 50.6             | 48.71             | 336,586          | 33,288       | 保険                      |
| WOONGJIN COWAY CO LTD                           | 52.8             | 50.7              | 475,059          | 46,983       | 家庭用耐久財                  |
| KT&G CORP                                       | 123.85           | 113.07            | 1,158,967        | 114,621      | タバコ                     |
| S-1 CORPORATION                                 | 21.26            | 14.44             | 144,111          | 14,252       | 商業サービス・用品               |
| KOREA GAS CORP                                  | 29.97            | 24.69             | 113,327          | 11,208       | ガス                      |
| CJ CORP   | 15.47            | 16.95             | 216,960          | 21,457       | コンビニ・コンビニ               |
| KAKAO CORP                                      | 48.77            | 48.62             | 571,285          | 56,500       | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| CJ ENM CO LTD                                   | -                | 9.87              | 218,916          | 21,650       | インターネット販売・通信販売          |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE                    | -                | 26.34             | 78,493           | 7,762        | 機械                      |
| SK TELECOM CO LTD                               | 20.3             | 18.59             | 460,102          | 45,504       | 無線通信サービス                |
| DAELIM INDUSTRIAL CO                            | 29.87            | 26.49             | 258,277          | 25,543       | 建設・土木                   |
| MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD                       | 406.12           | 403.22            | 324,188          | 32,062       | 資本市場                    |
| NCSOFT CORPORATION                              | 18.7             | 16.88             | 844,000          | 83,471       | 娯楽                      |
| LG UPLUS CORP                                   | -                | 96.56             | 141,460          | 13,990       | 各種電気通信サービス              |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD | 40.5             | -                 | -                | -            | 電気設備                    |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT                  | 135.4            | 135.4             | 69,189           | 6,842        | 建設・土木                   |
| POSCO INTERNATIONAL CORP                        | 36               | 36                | 65,340           | 6,462        | 商社・流通業                  |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD                  | 10.15            | 8.96              | 1,278,592        | 126,452      | パーソナル用品                 |
| LG CHEM LTD                                     | 49.4             | 43.91             | 1,629,061        | 161,114      | 化学                      |
| LG CHEM LTD                                     | 6.41             | 7.26              | 152,460          | 15,078       | 化学                      |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD                  | 1.77             | 2.01              | 168,237          | 16,638       | パーソナル用品                 |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD                  | 450.23           | 407.81            | 1,857,574        | 183,714      | 銀行                      |
| HDC HOLDINGS CO LTD                             | 59.1             | -                 | -                | -            | 建設・土木                   |
| S-OIL CORP                                      | 43.83            | 43.83             | 416,823          | 41,223       | 石油・ガス・消耗燃料              |



| 銘柄  | 期首(前期末) |          | 当期         |           | 業種等                  |
|---|---------|----------|------------|-----------|----------------------|
|   | 株数      | 株数       | 評価額        |           |                      |
|   |         |          | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |                      |
| (韓国)                                      | 百株      | 百株       | 千韓国・ウォン    | 千円        |                      |
| HANWHA CHEMICAL CORPORATION               | 77.71   | 82.89    | 187,331    | 18,527    | 化学                   |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD                 | 66      | 59.97    | 224,887    | 22,241    | 資本市場                 |
| POSCO CHEMICAL CO LTD                     | -       | 21.26    | 131,812    | 13,036    | 建設資材                 |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION                | 16.65   | 16.77    | 481,299    | 47,600    | 化学                   |
| HOTEL SHILLA CO LTD                       | 29.55   | 28.26    | 289,665    | 28,647    | 専門小売り                |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES                  | 36.2    | 38.44    | 472,812    | 46,761    | 機械                   |
| HYUNDAI MOBIS                             | 71.83   | 64.84    | 1,488,078  | 147,170   | 自動車部品                |
| SK HYNIX INC                              | 612.13  | 554.2    | 4,444,684  | 439,579   | 半導体・半導体製造装置          |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | 79.26   | 74.08    | 393,364    | 38,903    | 建設・土木                |
| HYUNDAI MOTOR CO                          | 19.97   | 19.54    | 147,527    | 14,590    | 自動車                  |
| HYUNDAI MOTOR CO                          | 163.75  | 135.32   | 1,772,692  | 175,319   | 自動車                  |
| HYUNDAI STEEL CO                          | 80.09   | 71.94    | 348,189    | 34,435    | 金属・鉱業                |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA                  | 250.79  | 226.06   | 331,177    | 32,753    | 銀行                   |
| KCC CORP                                  | 6.7     | 5.54     | 193,069    | 19,094    | 建設関連製品               |
| KIA MOTORS CORP                           | 280.9   | 251.7    | 1,064,691  | 105,297   | 自動車                  |
| KOREA ZINC CO LTD                         | 8.27    | 8.38     | 388,832    | 38,455    | 金属・鉱業                |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP                 | 274.52  | 247.64   | 715,679    | 70,780    | 電力                   |
| HANWHA CORP                               | 37.85   | 37.85    | 119,795    | 11,847    | コングロマリット             |
| KOREAN AIR CO LTD                         | 53.01   | 43.87    | 157,493    | 15,576    | 旅客航空輸送業              |
| OCI COMPANY LTD                           | 18.29   | 18.29    | 175,401    | 17,347    | 化学                   |
| CJ LOGISTICS                              | 8.6     | 8.6      | 140,610    | 13,906    | 陸運・鉄道                |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD               | 19.3    | 15.09    | 143,204    | 14,162    | 化学                   |
| KT CORP                                   | 20.48   | 20.48    | 55,910     | 5,529     | 各種電気通信サービス           |
| HLB INC                                   | -       | 29.94    | 254,190    | 25,139    | レジャー用品               |
| LG ELECTRONICS INC                        | 113.15  | 102.93   | 781,238    | 77,264    | 家庭用耐久財               |
| LOTTE CORP                                | 33.66   | 28.1     | 145,277    | 14,367    | コングロマリット             |
| HANSSEM CO LTD                            | 11      | -        | -          | -         | 家庭用耐久財               |
| LG CORP                                   | 102.15  | 92.19    | 690,503    | 68,290    | コングロマリット             |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD         | 170.37  | 133.62   | 194,417    | 19,227    | 資本市場                 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCTION             | 54.9    | 60.04    | 240,160    | 23,751    | 建設・土木                |
| NAVER CORP                                | 29.52   | 133.74   | 1,598,193  | 158,061   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD           | 11.87   | 12.49    | 123,651    | 12,229    | 複合小売り                |
| DONGSUH CO INC                            | 27.98   | -        | -          | -         | 食品・生活必需品小売り          |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD          | 40.61   | 42.91    | 310,668    | 30,725    | 資本市場                 |
| OTTOGI CORP                               | 1.12    | 1.12     | 82,208     | 8,130     | 食品                   |
| AMOREPACIFIC GROUP                        | 28.91   | 27.61    | 225,573    | 22,309    | パーソナル用品              |
| KANGWON LAND INC                          | 120.47  | 106.55   | 346,287    | 34,247    | ホテル・レストラン・レジャー       |
| POSCO                                     | 78.3    | 74.46    | 2,021,589  | 199,935   | 金属・鉱業                |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD                | -       | 144.49   | 239,130    | 23,650    | 建設・土木                |
| SAMSUNG SDI CO LTD                        | 58.31   | 52.65    | 1,213,582  | 120,023   | 電子装置・機器・部品           |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD          | 60.07   | 54.55    | 640,962    | 63,391    | 電子装置・機器・部品           |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD                | 101.45  | 4,532.55 | 21,325,647 | 2,109,106 | コンピュータ・周辺機器          |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD           | 299.01  | 391.72   | 341,971    | 33,820    | 機械                   |
| HANWHA AEROSPACE CO LTD                   | 31.41   | -        | -          | -         | 航空宇宙・防衛              |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD                   | 18.33   | 782.05   | 2,967,879  | 293,523   | コンピュータ・周辺機器          |
| SHINSEGAE CO LTD                          | 8.27    | 6.46     | 203,490    | 20,125    | 複合小売り                |
| HYOSUNG CORP                              | 21.65   | -        | -          | -         | コングロマリット             |
| YUHAN CORP                                | 10.37   | 9.51     | 237,750    | 23,513    | 医薬品                  |
| HANON SYSTEMS                             | 190.93  | 171.56   | 213,592    | 21,124    | 自動車部品                |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD    | 64.8    | 56.67    | 219,879    | 21,746    | 保険                   |
| GS HOLDINGS CORP                          | 52.69   | 47.51    | 253,228    | 25,044    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| LG DISPLAY CO LTD                         | 250.72  | 228.49   | 495,823    | 49,036    | 電子装置・機器・部品           |
| SK NETWORKS CO LTD                        | 148.1   | -        | -          | -         | 商社・流通業               |
| CELLTRION INC                             | 85.57   | 79.64    | 1,660,494  | 164,222   | バイオテクノロジー            |
| VIROMED CO LTD                            | -       | 11.9     | 317,135    | 31,364    | バイオテクノロジー            |
| HANA FINANCIAL GROUP                      | 313.14  | 289.14   | 1,113,189  | 110,094   | 銀行                   |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD                     | 20.57   | 18       | 255,600    | 25,278    | 航空貨物・物流サービス          |

| 銘柄   | 期首(前期末)  |           | 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 |                         |
|  |          |           | 株数         | 株数        |       |        |                         |
| <b>(韓国)</b>  | 百株       | 百株        | 千韓国・ウォン    | 千円        |       |        |                         |
| CELLTRION PHARM INC                                    | —        | 14.57     | 84,360     | 8,343     |       |        | 医薬品                     |
| LOTTE SHOPPING CO                                      | 12.27    | 10.03     | 183,047    | 18,103    |       |        | 複合小売り                   |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD                          | 74.58    | 67.76     | 581,380    | 57,498    |       |        | 保険                      |
| AMOREPACIFIC CORP                                      | 34.95    | 31.23     | 724,536    | 71,656    |       |        | パーソナル用品                 |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF                                 | 7.52     | 8.48      | 109,392    | 10,818    |       |        | パーソナル用品                 |
| SAMSUNG CARD CO  | 28.77    | 28.77     | 101,701    | 10,058    |       |        | 消費者金融                   |
| SK INNOVATION CO LTD                                   | 67.27    | 61.75     | 1,185,600  | 117,255   |       |        | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CJ CHEILJEDANG CORP                                    | 8.7      | 8.58      | 274,989    | 27,196    |       |        | 食品                      |
| STX PAN OCEAN CO LTD                                   | 183.95   | 183.95    | 80,570     | 7,968     |       |        | 海運業                     |
| KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD               | 18.25    | —         | —          | —         |       |        | 商業サービス・用品               |
| LG INNOTEK CO LTD                                      | 14.4     | 14.4      | 186,480    | 18,442    |       |        | 電子装置・機器・部品              |
| SK HOLDINGS CO LTD                                     | 34.4     | 30.8      | 828,520    | 81,940    |       |        | コンプロマリット                |
| KB FINANCIAL GROUP INC                                 | 419.35   | 380.76    | 1,757,207  | 173,787   |       |        | 銀行                      |
| MEDY-TOX INC   | 4.64     | 4.21      | 256,894    | 25,406    |       |        | バイオテクノロジー               |
| HYUNDAI WIA CORP                                       | 14.54    | —         | —          | —         |       |        | 自動車部品                   |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD                         | 68.72    | 66.02     | 243,283    | 24,060    |       |        | 航空宇宙・防衛                 |
| BNK FINANCIAL GROUP INC                                | 300.24   | 249.23    | 181,439    | 17,944    |       |        | 銀行                      |
| HANMI PHARM CO LTD                                     | 6.9      | 6.53      | 281,116    | 27,802    |       |        | 医薬品                     |
| HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD                           | 264.3    | 284.68    | 114,441    | 11,318    |       |        | 保険                      |
| FILA KOREA LTD   | —        | 43.1      | 335,318    | 33,162    |       |        | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| CJ E&M CORP  | 19.5     | —         | —          | —         |       |        | メディア                    |
| E-MART CO LTD  | 22.47    | 18.78     | 333,345    | 32,967    |       |        | 食品・生活必需品小売り             |
| DGB FINANCIAL GROUP INC                                | 185.75   | 163.21    | 140,197    | 13,865    |       |        | 銀行                      |
| GS RETAIL CO LTD                                       | 24.82    | 24.82     | 101,141    | 10,002    |       |        | 食品・生活必需品小売り             |
| HANKOOK TIRE CO LTD NEW                                | 75.17    | 65.9      | 265,906    | 26,298    |       |        | 自動車部品                   |
| HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION  | —        | 24.82     | 116,778    | 11,549    |       |        | 建設・土木                   |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD               | 9.78     | 8.63      | 299,029    | 29,574    |       |        | 機械                      |
| BGF RETAIL CO LTD                                      | 8.54     | 6.31      | 146,392    | 14,478    |       |        | 食品・生活必需品小売り             |
| ORION CORP REPUBLIC OF KOREA                           | 23.81    | 20.71     | 203,579    | 20,133    |       |        | 食品                      |
| ORANGE LIFE INSURANCE LTD                              | 37.35    | 27.63     | 96,290     | 9,523     |       |        | 保険                      |
| NETMARBLE CORP   | 27.66    | 22.91     | 310,430    | 30,701    |       |        | 娯楽                      |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD-RTS                    | 123.01   | —         | —          | —         |       |        | 機械                      |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC                              | —        | 443.48    | 627,524    | 62,062    |       |        | 銀行                      |
| SAMSUNG SDS CO LTD                                     | 36.75    | 33.52     | 787,720    | 77,905    |       |        | 情報技術サービス                |
| WOORI BANK   | 508.29   | —         | —          | —         |       |        | 銀行                      |
| SAMSUNG C&T CORP                                       | 80.72    | 73.94     | 835,522    | 82,633    |       |        | コンプロマリット                |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD                               | 17.59    | 15.63     | 576,747    | 57,040    |       |        | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| PEARL ABBYSS CORP                                      | —        | 5.34      | 100,071    | 9,897     |       |        | 娯楽                      |
| DOOSAN BOBCAT INC                                      | 46.79    | 36.36     | 113,806    | 11,255    |       |        | 機械                      |
| SILLAJEN INC   | 53.78    | 53.19     | 344,671    | 34,087    |       |        | バイオテクノロジー               |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD                            | 34.9     | 44.6      | 317,106    | 31,361    |       |        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| 小計   | 株数       | 株数        | 金額         | 金額        |       |        |                         |
|  | 9,498.66 | 14,106.56 | 78,200,380 | 7,734,017 |       |        |                         |
|  | 114銘柄    | 114銘柄     | —          | <12.6%>   |       |        |                         |
| <b>(中国)</b>  | 百株       | 百株        | 千円         | 千円        |       |        |                         |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD                     | —        | 96        | 255        | 4,278     |       |        | 電気設備                    |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD              | —        | 263       | 180        | 3,019     |       |        | コンピュータ・周辺機器             |
| IFLYTEK CO LTD   | —        | 64        | 223        | 3,749     |       |        | ソフトウェア                  |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD                             | —        | 23        | 209        | 3,515     |       |        | 医薬品                     |
| JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD              | —        | 25        | 300        | 5,032     |       |        | 飲料                      |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD                                 | —        | 72        | 746        | 12,504    |       |        | 飲料                      |
| SUNING.COM CO LTD                                      | —        | 295       | 411        | 6,902     |       |        | 専門小売り                   |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD                            | —        | 799       | 318        | 5,343     |       |        | 電子装置・機器・部品              |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD | —        | 123       | 279        | 4,689     |       |        | 不動産管理・開発                |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI                 | —        | 57        | 327        | 5,489     |       |        | 家庭用耐久財                  |
| MIDEA GROUP CO LTD                                     | —        | 80        | 424        | 7,106     |       |        | 家庭用耐久財                  |
| HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD           | —        | 120       | 415        | 6,956     |       |        | 電子装置・機器・部品              |
| PING AN BANK CO LTD                                    | —        | 272       | 390        | 6,541     |       |        | 銀行                      |

| 銘柄  | 期首(前期末) |       | 当期    |        | 業種等                     |
|---|---------|-------|-------|--------|-------------------------|
|   | 株数      | 株数    | 評価額   |        |                         |
|   |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |                         |
| (中国)  | 百株      | 百株    | 千円    | 千円     |                         |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD                 | —       | 790   | 440   | 7,374  | 資本市場                    |
| CHINA VANKE CO LTD                            | —       | 137   | 424   | 7,113  | 不動産管理・開発                |
| WEICHAI POWER CO LTD                          | —       | 299   | 417   | 6,995  | 機械                      |
| GF SECURITIES CO LTD                          | —       | 227   | 378   | 6,345  | 資本市場                    |
| BYD CO LTD                                    | —       | 75    | 468   | 7,843  | 自動車                     |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD                       | —       | 209   | 266   | 4,473  | 銀行                      |
| PETROCHINA CO LTD                             | —       | 328   | 251   | 4,221  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD     | —       | 755   | 453   | 7,604  | 銀行                      |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD                | —       | 825   | 320   | 5,364  | 銀行                      |
| BANK OF CHINA LTD                             | —       | 745   | 300   | 5,031  | 銀行                      |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP               | —       | 513   | 301   | 5,055  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD                   | —       | 315   | 1,128 | 18,916 | 銀行                      |
| PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD       | —       | 195   | 1,647 | 27,609 | 保険                      |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD                        | —       | 274   | 557   | 9,336  | 銀行                      |
| SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD       | —       | 367   | 437   | 7,325  | 銀行                      |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD               | —       | 733.2 | 486   | 8,159  | 銀行                      |
| SAIC MOTOR CORP LTD                           | —       | 109   | 329   | 5,520  | 自動車                     |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD                        | —       | 18    | 1,713 | 28,719 | 飲料                      |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD                 | —       | 792   | 512   | 8,588  | 銀行                      |
| CITIC SECURITIES CO LTD                       | —       | 316   | 769   | 12,901 | 資本市場                    |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD          | —       | 109   | 408   | 6,850  | 保険                      |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD                    | —       | 265   | 444   | 7,452  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| DAQIN RAILWAY CO LTD                          | —       | 301   | 255   | 4,288  | 陸運・鉄道                   |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD                  | —       | 608   | 266   | 4,463  | 銀行                      |
| CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD | —       | 616   | 407   | 6,834  | 建設・土木                   |
| HAITONG SECURITIES CO LTD                     | —       | 360   | 520   | 8,718  | 資本市場                    |
| HUAXIA BANK CO LTD                            | —       | 232   | 201   | 3,382  | 銀行                      |
| INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD   | —       | 104   | 320   | 5,365  | 食品                      |
| BANK OF BEIJING CO LTD                        | —       | 428   | 277   | 4,648  | 銀行                      |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD                   | —       | 292   | 223   | 3,748  | 金属・鉱業                   |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD                     | —       | 165   | 702   | 11,775 | 建設資材                    |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD             | —       | 228   | 414   | 6,943  | 資本市場                    |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD   | —       | 204   | 289   | 4,851  | 不動産管理・開発                |
| CRRC CORP LTD                                 | —       | 847   | 794   | 13,315 | 機械                      |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD               | —       | 102   | 658   | 11,031 | 医薬品                     |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD           | —       | 274   | 323   | 5,414  | 建設・土木                   |
| HUATAI SECURITIES CO LTD                      | —       | 236   | 514   | 8,626  | 資本市場                    |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD                    | —       | 211   | 276   | 4,636  | 機械                      |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD    | —       | 110   | 330   | 5,530  | 医薬品                     |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD                     | —       | 310   | 242   | 4,068  | 資本市場                    |
| CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD   | —       | 39    | 297   | 4,979  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| AVIC CAPITAL CO LTD                           | —       | 498   | 322   | 5,408  | 各種金融サービス                |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD               | —       | 1,512 | 559   | 9,376  | 建設・土木                   |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD          | —       | 954   | 578   | 9,689  | 建設・土木                   |
| SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD                | —       | 237   | 224   | 3,757  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD       | —       | 99    | 209   | 3,515  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AECC AVIATION POWER CO LTD                    | —       | 95    | 250   | 4,200  | 航空宇宙・防衛                 |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD          | —       | 160   | 249   | 4,183  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD                  | —       | 532   | 383   | 6,419  | 資本市場                    |
| BEIJING TONGRENTANG CO LTD                    | —       | 64    | 209   | 3,517  | 医薬品                     |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD                   | —       | 80    | 241   | 4,043  | 金属・鉱業                   |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD                    | —       | 240   | 218   | 3,660  | 食品・生活必需品小売り             |
| AISINO CORP                                   | —       | 64    | 180   | 3,022  | ソフトウェア                  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD                | —       | 665   | 586   | 9,830  | 旅客航空輸送業                 |
| ZHANGZHOU PIENZHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD    | —       | 18    | 212   | 3,562  | 医薬品                     |
| HENG TONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD               | —       | 81    | 178   | 2,987  | 通信機器                    |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD           | —       | 513   | 323   | 5,416  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |

| 銘柄                                 | 期首(前期末)          |                   | 当期                |         | 業種等                     |
|------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|---------|-------------------------|
|                                    | 株数               | 株数                | 評価額               |         |                         |
|                                    |                  |                   | 外貨建金額             | 邦貨換算金額  |                         |
| (中国)                               | 百株               | 百株                | 千円                | 千円      |                         |
| BANK OF JIANGSU CO LTD             | —                | 324               | 242               | 4,067   | 銀行                      |
| ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA     | —                | 248               | 291               | 4,879   | 資本市場                    |
| EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD       | —                | 240               | 319               | 5,357   | 資本市場                    |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 22,976.2<br>73銘柄  | 30,039            | 503,453 | <0.8%>                  |
| (マレーシア)                            | 百株               | 百株                | 千円                | 千円      |                         |
| AMMB HOLDINGS BHD                  | 1,902            | 1,345             | 597               | 16,153  | 銀行                      |
| GENTING PLANTATIONS BHD            | 434              | 375               | 395               | 10,691  | 食品                      |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD            | 4,847            | 4,651             | 2,348             | 63,533  | 銀行                      |
| DIGI.COM BHD                       | 3,591            | 2,887             | 1,351             | 36,547  | 無線通信サービス                |
| MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD     | 878.2            | 1,014.2           | 690               | 18,682  | 運送インフラ                  |
| RHB BANK BHD                       | 680.8            | 777.8             | 450               | 12,181  | 銀行                      |
| HAP SENG CONSOLIDATED BHD          | 700              | 632               | 625               | 16,907  | コンピュータリット               |
| TOP GLOVE CORP BHD                 | —                | 1,338             | 608               | 16,467  | ヘルスケア機器・用品              |
| GAMUDA BHD                         | 1,946            | 1,946             | 599               | 16,212  | 建設・土木                   |
| GENTING BHD                        | 2,482            | 2,117             | 1,428             | 38,653  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| YTL CORP BHD                       | 5,191.1          | 2,837.1           | 320               | 8,672   | 総合公益事業                  |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD     | 202.56           | 202.56            | 384               | 10,410  | 銀行                      |
| HONG LEONG BANK BHD                | 630.08           | 624.08            | 1,248             | 33,762  | 銀行                      |
| IJM CORP BHD                       | 3,455.6          | 2,303.6           | 511               | 13,833  | 建設・土木                   |
| IOI CORP BHD                       | 2,402.13         | 1,872.13          | 842               | 22,788  | 食品                      |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD            | 555              | 445               | 1,099             | 29,732  | 食品                      |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD        | —                | 128               | 444               | 12,028  | 飲料                      |
| MALAYAN BANKING BHD                | 4,437.75         | 3,662.75          | 3,296             | 89,169  | 銀行                      |
| ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD         | 861              | 884               | 353               | 9,564   | 銀行                      |
| MISC BHD                           | 1,400.8          | 902.8             | 604               | 16,361  | 海運業                     |
| NESTLE MALAYSIA BHD                | 58               | 48                | 701               | 18,969  | 食品                      |
| PPB GROUP BHD                      | 478              | 475.6             | 893               | 24,160  | 食品                      |
| PETRONAS DAGANGAN BHD              | 314              | 196               | 488               | 13,222  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PETRONAS GAS BHD                   | 732              | 604               | 1,071             | 28,983  | ガス                      |
| GENTING MALAYSIA BHD               | 3,019            | 2,986             | 919               | 24,877  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD       | 147              | 147               | 528               | 14,306  | タバコ                     |
| TELEKOM MALAYSIA BHD               | 1,325            | 1,034             | 313               | 8,474   | 各種電気通信サービス              |
| SP SETIA BHD                       | 1,785            | 1,367             | 307               | 8,319   | 不動産管理・開発                |
| TENAGA NASIONAL BHD                | 3,566.5          | 3,046.5           | 3,674             | 99,383  | 電力                      |
| UMW HOLDINGS BHD                   | 390              | —                 | —                 | —       | 自動車                     |
| QL RESOURCES BHD                   | —                | 538               | 370               | 10,012  | 食品                      |
| DIALOG GROUP BHD                   | 3,298.44         | 3,205.44          | 1,000             | 27,052  | エネルギー設備・サービス            |
| PUBLIC BANK BHD(LOCAL)             | 3,038.3          | 2,762.3           | 6,242             | 168,867 | 銀行                      |
| YTL POWER INTERNATIONAL BHD        | 1,487.8          | —                 | —                 | —       | 総合公益事業                  |
| AIRASIA GROUP BHD                  | 1,479            | 1,479             | 366               | 9,921   | 旅客航空輸送業                 |
| SIME DARBY BERHAD                  | 2,327            | 2,296             | 514               | 13,911  | コンピュータリット               |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD             | 1,454            | 1,171             | 553               | 14,982  | ヘルスケア機器・用品              |
| AXIATA GROUP BERHAD                | 2,697            | 2,746             | 1,134             | 30,677  | 無線通信サービス                |
| MAXIS BHD                          | 1,886            | 2,384             | 1,318             | 35,661  | 無線通信サービス                |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD       | 2,362            | 2,331             | 2,079             | 56,243  | 化学                      |
| SAPURA ENERGY BHD                  | 3,192            | —                 | —                 | —       | エネルギー設備・サービス            |
| ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD        | 1,405            | —                 | —                 | —       | メディア                    |
| IHH HEALTHCARE BHD                 | 2,117            | 2,137             | 1,181             | 31,966  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| FGV HOLDINGS BHD                   | 1,264            | —                 | —                 | —       | 食品                      |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD             | 1,300            | 1,092             | 406               | 10,988  | 運送インフラ                  |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD | 1,531            | 1,240             | 559               | 15,127  | 金属・鉱業                   |
| SIME DARBY PROPERTY BHD            | 2,327            | 2,327             | 255               | 6,923   | 不動産管理・開発                |
| SIME DARBY PLANTATION BHD          | 2,628            | 2,161             | 1,104             | 29,870  | 食品                      |
| IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD       | 1,745.48         | 1,745.48          | 228               | 6,185   | 不動産管理・開発                |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 85,950.54<br>46銘柄 | 70,464.34<br>44銘柄 | 44,415  | 1,201,450<br><2.0%>     |

| 銘柄                                  | 期首(前期末)  |          | 当期         |           | 業種等                     |
|-------------------------------------|----------|----------|------------|-----------|-------------------------|
|                                     | 株数       | 株数       | 評価額        |           |                         |
|                                     |          |          | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |                         |
| (南アフリカ)                             | 百株       | 百株       | 千南アフリカ・ランド | 千円        |                         |
| BIDVEST GROUP LTD                   | 358.98   | 334.72   | 7,312      | 58,644    | コングロマリット                |
| CLICKS GROUP LTD                    | -        | 224.23   | 4,127      | 33,101    | 食品・生活必需品小売り             |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD         | 443.26   | 453.11   | 3,274      | 26,258    | 専門小売り                   |
| DISCOVERY LTD                       | 352.4    | 358.24   | 5,261      | 42,194    | 保険                      |
| REDEFINE PROPERTIES LTD             | 5,100    | 5,458.11 | 5,436      | 43,598    | エクイティ不動産投資信託 (REITs)    |
| GOLD FIELDS LTD                     | 972.28   | 699.36   | 3,746      | 30,046    | 金属・鉱業                   |
| REMGRO LTD                          | 563.29   | 506.21   | 9,895      | 79,365    | 各種金融サービス                |
| THE FOSCHINI GROUP LTD              | 220      | 198.73   | 3,606      | 28,927    | 専門小売り                   |
| MMI HOLDINGS LTD                    | 1,114.71 | 808.77   | 1,429      | 11,461    | 保険                      |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD          | 3,222.27 | 2,898.26 | 7,144      | 57,296    | エクイティ不動産投資信託 (REITs)    |
| EXXARO RESOURCES LTD                | 253.4    | 248.46   | 4,186      | 33,576    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD           | 38.5     | 37.04    | 5,218      | 41,855    | 銀行                      |
| LIBERTY HOLDINGS LTD                | 151.37   | 114.38   | 1,189      | 9,540     | 保険                      |
| MTN GROUP LTD                       | 1,784.39 | 1,626.78 | 16,677     | 133,755   | 無線通信サービス                |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD               | 477.74   | 405.22   | 7,308      | 58,614    | 金属・鉱業                   |
| TELKOM SA SOC LTD                   | 315.88   | 220.8    | 1,851      | 14,848    | 各種電気通信サービス              |
| FIRSTRAND LTD                       | 3,533.55 | 3,195.17 | 21,554     | 172,868   | 各種金融サービス                |
| PSG GROUP LTD                       | 155.46   | 149.38   | 4,075      | 32,682    | 各種金融サービス                |
| NASPERS LTD                         | 460.1    | 416.43   | 150,750    | 1,209,016 | インターネット販売・通信販売          |
| CORONATION FUND MANAGERS LTD        | 267      | -        | -          | -         | 資本市場                    |
| NEDBANK GROUP LTD                   | 220.7    | 387.61   | 10,486     | 84,097    | 銀行                      |
| NETCARE LTD                         | 1,067.07 | 1,054.65 | 2,539      | 20,367    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PICK'N PAY STORES LTD               | 433.75   | 312.55   | 2,306      | 18,496    | 食品・生活必需品小売り             |
| RMB HOLDINGS LTD                    | 706.97   | 611.74   | 5,040      | 40,426    | 各種金融サービス                |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD         | 62       | 50.42    | 3,781      | 30,327    | 金属・鉱業                   |
| SAPPI LTD                           | 562.31   | 538.82   | 3,544      | 28,430    | 紙製品・林産品                 |
| SASOL LTD                           | 584.19   | 537.28   | 25,489     | 204,422   | 化学                      |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD               | 469.66   | 433.8    | 7,755      | 62,195    | 食品・生活必需品小売り             |
| MR PRICE GROUP LTD                  | 259.11   | 234.11   | 4,891      | 39,233    | 専門小売り                   |
| BRAIT SE                            | 370.6    | -        | -          | -         | 資本市場                    |
| STANDARD BANK GROUP LTD             | 1,355.46 | 1,235.96 | 24,756     | 198,545   | 銀行                      |
| SPAR GROUP LTD/THE                  | 218.08   | 200.38   | 4,117      | 33,024    | 食品・生活必需品小売り             |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD             | 991.54   | 880.09   | 4,121      | 33,054    | 複合小売り                   |
| IMPERIAL HOLDINGS LTD               | 167.74   | -        | -          | -         | 販売                      |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD       | 411.88   | 345.76   | 3,664      | 29,388    | 医薬品                     |
| ABSA GROUP LTD                      | 758.62   | 698.64   | 11,385     | 91,313    | 銀行                      |
| TIGER BRANDS LTD                    | 162.62   | 159.65   | 4,240      | 34,009    | 食品                      |
| SANLAM LTD                          | 1,486.83 | 1,713.29 | 13,603     | 109,100   | 保険                      |
| INVESTEC LTD                        | 293.12   | 295.37   | 2,779      | 22,291    | 資本市場                    |
| KUMBA IRON ORE LTD                  | 53.27    | 53.27    | 2,410      | 19,330    | 金属・鉱業                   |
| PIONEER FOODS LTD                   | 155      | -        | -          | -         | 食品                      |
| MONDI LTD                           | 115.2    | 108.66   | 3,383      | 27,138    | 紙製品・林産品                 |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD  | 1,358.45 | 1,371.82 | 3,841      | 30,805    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| RMI HOLDINGS                        | 638.4    | 555.7    | 1,992      | 15,977    | 保険                      |
| VODACOM GROUP PTY LTD               | 640.73   | 626.12   | 7,500      | 60,152    | 無線通信サービス                |
| SIBANYE GOLD LTD                    | 1,720    | -        | -          | -         | 金属・鉱業                   |
| NEPI ROCKCASTLE PLC                 | 375.46   | 329.83   | 3,928      | 31,510    | 不動産管理・開発                |
| OLD MUTUAL LTD                      | -        | 4,758.87 | 11,107     | 89,079    | 保険                      |
| REINET INVESTMENTS SCA              | -        | 139.93   | 3,208      | 25,732    | 資本市場                    |
| MULTICHOICE GROUP LTD               | -        | 407.24   | 5,161      | 41,397    | メディア                    |
| FORTRESS REIT LTD-A                 | 1,029.5  | 1,029.5  | 1,975      | 15,844    | エクイティ不動産投資信託 (REITs)    |
| FORTRESS REIT LTD-B                 | 953.02   | -        | -          | -         | 総合公益事業                  |
| STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV | 2,678.66 | -        | -          | -         | 家庭用耐久財                  |
| BID CORP LTD                        | 356.89   | 323.21   | 9,772      | 78,373    | 食品・生活必需品小売り             |
| 小計                                  | 株数・金額    | 株数       | 452,832    | 3,631,720 |                         |
|                                     | 銘柄数<比率>  | 銘柄       | -          | <5.9%>    |                         |

| 銘柄  | 期首(前期末)                   |                            | 当期         |           | 業種等                     |
|---|---------------------------|----------------------------|------------|-----------|-------------------------|
|   | 株数                        | 株数                         | 評価額        |           |                         |
|   |                           |                            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |                         |
| (タイ)  | 百株                        | 百株                         | 千タイ・パーツ    | 千円        |                         |
| BANGKOK BANK PCL                            | 277                       | 220                        | 4,862      | 17,114    | 銀行                      |
| BERLI JUCKER PCL NVDR                       | 1,355                     | 1,236                      | 6,365      | 22,406    | 食品・生活必需品小売り             |
| KRUNG THAI BANK PCL NVDR                    | 3,480                     | 3,480                      | 6,716      | 23,641    | 銀行                      |
| ROBINSON PCL-NVDR                           | 643                       | 388                        | 2,250      | 7,921     | 複合小売り                   |
| SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR               | 1,927                     | 1,739                      | 22,520     | 79,270    | 銀行                      |
| TRUE CORP PCL NVDR                          | 10,307.55                 | 10,747.55                  | 5,588      | 19,672    | 各種電気通信サービス              |
| KASIKORNBANK PCL NVDR                       | 712                       | 621                        | 11,892     | 41,860    | 銀行                      |
| TMB BANK PCL -NVDR                          | 10,100                    | 10,100                     | 2,100      | 7,394     | 銀行                      |
| IRPC PCL NVDR                               | 10,655                    | 10,609                     | 6,047      | 21,285    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR                | 2,559                     | 1,720                      | 2,769      | 9,747     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR             | 131                       | 131                        | 3,812      | 13,418    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| CHAROEN POKPHAND FOODS PCL                  | 2,932                     | 3,115                      | 7,943      | 27,960    | 食品                      |
| ADVANCED INFO SERVICE PCL                   | 1,113                     | 1,019                      | 19,615     | 69,047    | 無線通信サービス                |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR                | 3,587.2                   | 3,805.2                    | 5,860      | 20,627    | 専門小売り                   |
| DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR             | 442                       | 442                        | 3,458      | 12,174    | 電子装置・機器・部品              |
| PTT PCL                                     | 1,094                     | 9,960                      | 48,306     | 170,037   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR                   | 2,613                     | 1,626                      | 3,040      | 10,702    | 食品                      |
| LAND AND HOUSES PCL NVDR                    | -                         | 2,639                      | 2,850      | 10,032    | 不動産管理・開発                |
| SIAM CEMENT PCL NVDR                        | 116.5                     | 338.5                      | 15,638     | 55,048    | 建設資材                    |
| KCE ELECTRONICS PCL-NVDR                    | 249                       | -                          | -          | -         | 電子装置・機器・部品              |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR               | 4,556                     | 4,064                      | 27,838     | 97,991    | 運送インフラ                  |
| SIAM CEMENT PCL FOREIGN                     | 295                       | -                          | -          | -         | 建設資材                    |
| KASIKORNBANK PCL - FOREIGN                  | 1,231                     | 1,076                      | 20,605     | 72,531    | 銀行                      |
| CENTRAL PATTANA PCL NVDR                    | 1,390                     | 1,192                      | 9,089      | 31,993    | 不動産管理・開発                |
| BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR         | 4,114                     | 3,813                      | 9,627      | 33,889    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR                | 389                       | 324                        | 5,783      | 20,357    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR                | 2,368.1                   | 2,276.1                    | 8,535      | 30,044    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| THAI OIL PCL NVDR                           | 1,189                     | 983                        | 7,077      | 24,913    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| GLOW ENERGY PCL NVDR                        | 540                       | 540                        | 4,927      | 17,344    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| CP ALL PCL NVDR                             | 5,231                     | 4,812                      | 37,172     | 130,847   | 食品・生活必需品小売り             |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL                      | 5,448                     | 5,313                      | 6,163      | 21,694    | 陸運・鉄道                   |
| PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR       | 1,343.45                  | 1,329.45                   | 17,415     | 61,303    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INDORAMA VENTURES PCL NVDR                  | 1,740.22                  | 1,709.22                   | 8,289      | 29,179    | 化学                      |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR                | 2,395.08                  | 2,172.08                   | 15,258     | 53,711    | 化学                      |
| ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR                    | 1,180                     | 1,180                      | 6,254      | 22,014    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR         | 7,407                     | 7,678                      | 7,908      | 27,837    | 運送インフラ                  |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR            | -                         | 342                        | 3,420      | 12,038    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR                  | -                         | 594                        | 3,059      | 10,768    | 消費者金融                   |
| 小計  | 株数 95,110.1<br>銘柄数 <2.2%> | 株数 103,334.1<br>銘柄数 <2.2%> | 380,063    | 1,337,823 |                         |
| (ポーランド)                                     | 百株                        | 百株                         | 千ポーランド・ズロチ | 千円        |                         |
| BANK MILLENNIUM SA                          | 526.47                    | 497.82                     | 476        | 14,111    | 銀行                      |
| MBANK                                       | 15.95                     | 13.83                      | 609        | 18,065    | 銀行                      |
| BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA                | 25.96                     | 25.96                      | 168        | 4,998     | 銀行                      |
| KGHM POLSKA MIEDZ SA                        | 141.9                     | 142.94                     | 1,532      | 45,387    | 金属・鉱業                   |
| BANK PEKAO SA                               | 157.27                    | 158.87                     | 1,827      | 54,115    | 銀行                      |
| ORANGE POLSKA SA                            | 586                       | 586                        | 288        | 8,557     | 各種電気通信サービス              |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN                | 317.67                    | 286.43                     | 2,947      | 87,300    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| LPP SA                                      | 1.3                       | 1.31                       | 1,120      | 33,195    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| SANTANDER BANK POLSKA SA                    | 38.88                     | 35.15                      | 1,411      | 41,812    | 銀行                      |
| CD PROJEKT RED SA                           | 75.17                     | 60.15                      | 1,209      | 35,811    | 娯楽                      |
| POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA | 997.25                    | 845.54                     | 3,355      | 99,378    | 銀行                      |
| CCC SA                                      | 33.09                     | 27.63                      | 645        | 19,134    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| GRUPA LOTOS SA                              | 94.8                      | 93.85                      | 808        | 23,934    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA  | 1,671.92                  | 1,650.76                   | 1,020      | 30,217    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CYFROWY POLSAT SA                           | 228.1                     | 234.95                     | 611        | 18,107    | メディア                    |
| GRUPA AZOTY SA                              | 38.53                     | -                          | -          | -         | 化学                      |

| 銘柄                               | 期首(前期末)            |                    | 当期               |                      | 業種等            |
|----------------------------------|--------------------|--------------------|------------------|----------------------|----------------|
|                                  | 株数                 | 株数                 | 評価額              |                      |                |
|                                  |                    |                    | 外貨建金額            | 邦貨換算金額               |                |
| (ポーランド)                          | 百株                 | 百株                 | 千ポーランド・ズロチ       | 千円                   |                |
| POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA     | 811                | 705.29             | 689              | 20,426               | 電力             |
| TAURON POLSKA ENERGIA SA         | 893.18             | —                  | —                | —                    | 電力             |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA | 651.15             | 538.42             | 2,304            | 68,257               | 保険             |
| JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA    | 61.7               | 53.8               | 323              | 9,585                | 金属・鉱業          |
| ALIOR BANK SA                    | 94.05              | 90.07              | 539              | 15,980               | 銀行             |
| DINO POLSKA SA                   | 60.68              | 47.09              | 582              | 17,239               | 食品・生活必需品小売り    |
| PLAY COMMUNICATIONS SA           | 152.28             | —                  | —                | —                    | 無線通信サービス       |
| 小計                               | 株数<br>7,674.3      | 株数<br>6,095.86     | 外貨建金額<br>22,471  | 邦貨換算金額<br>665,616    |                |
|                                  | 銘柄数<br>23銘柄        | 銘柄数<br>20銘柄        |                  | <1.1%>               |                |
| (ハンガリー)                          | 百株                 | 百株                 | 千ハンガリー・フォリント     | 千円                   |                |
| RICHTER GEDEON NYRT              | 148.3              | 131.04             | 75,937           | 30,086               | 医薬品            |
| MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT   | 337.62             | 349.34             | 114,793          | 45,481               | 石油・ガス・消耗燃料     |
| OTP BANK NYRT                    | 255.55             | 214.83             | 281,856          | 111,671              | 銀行             |
| 小計                               | 株数<br>741.47       | 株数<br>695.21       | 外貨建金額<br>472,587 | 邦貨換算金額<br>187,239    |                |
|                                  | 銘柄数<br>3銘柄         | 銘柄数<br>3銘柄         |                  | <0.3%>               |                |
| (ユーロ・ギリシャ)                       | 百株                 | 百株                 | 千ユーロ             | 千円                   |                |
| PIRAEUS BANK S.A                 | 250                | —                  | —                | —                    | 銀行             |
| ALPHA BANK A.E.                  | 1,540.71           | 1,257.32           | 182              | 23,030               | 銀行             |
| NATIONAL BANK OF GREECE          | 6,600.69           | —                  | —                | —                    | 銀行             |
| TITAN CEMENT CO. S.A.            | 52.17              | 40.89              | 77               | 9,838                | 建設資材           |
| HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA     | 254.9              | 220.51             | 270              | 34,170               | 各種電気通信サービス     |
| FF GROUP                         | 31.3               | 31.3               | 7                | 950                  | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| EUROBANK ERGASIAS                | 1,941              | —                  | —                | —                    | 銀行             |
| MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN   | —                  | 58.47              | 124              | 15,739               | 石油・ガス・消耗燃料     |
| OPAP SA                          | 200                | 198.46             | 185              | 23,498               | ホテル・レストラン・レジャー |
| JUMBO SA                         | 104.2              | 115.02             | 185              | 23,498               | 専門小売り          |
| 小計                               | 株数<br>10,974.97    | 株数<br>1,921.97     | 外貨建金額<br>1,033   | 邦貨換算金額<br>130,726    |                |
|                                  | 銘柄数<br>9銘柄         | 銘柄数<br>7銘柄         |                  | <0.2%>               |                |
| 合計                               | 株数<br>2,382,094.46 | 株数<br>2,324,818.12 | 外貨建金額<br>—       | 邦貨換算金額<br>58,119,723 |                |
|                                  | 銘柄数<br>837銘柄       | 銘柄数<br>963銘柄       |                  | <94.4%>              |                |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注4) 銘柄コード等の変更があった銘柄や普通株と優先株は、別銘柄として掲載しております。

## (2) 外国新株予約権証券

| 銘柄                          | 期首(前期末)    |               | 当期         |               | 業種等 |
|-----------------------------|------------|---------------|------------|---------------|-----|
|                             | 証券数        | 証券数           | 評価額        |               |     |
|                             |            |               | 外貨建金額      | 邦貨換算金額        |     |
| (タイ)                        | 証券         | 証券            | 千タイ・パーツ    | 千円            |     |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | —          | 59,033        | 67         | 238           |     |
| 合計                          | 証券数<br>—   | 証券数<br>59,033 | 外貨建金額<br>— | 邦貨換算金額<br>238 |     |
|                             | 銘柄数<br>—銘柄 | 銘柄数<br>1銘柄    |            | <0.0%>        |     |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

### (3) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄   | 期首(前期末) |                                   | 当期  |                                   | 期末                                    |
|--|---------|-----------------------------------|-----|-----------------------------------|---------------------------------------|
|  | □       | 数                                 | □   | 数                                 | 外貨建金額<br>邦貨換算金額                       |
| (トルコ)<br>EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM   |         | 千口<br>231.071                     |     | 千口<br>-                           | 千トルコ・リラ<br>-                          |
| 小計   | □       | 数<br>231.071                      | □   | 数<br>-                            | 金額<br>-                               |
|  | 銘       | 柄                                 | 数<比 | 率>                                | 1銘柄<0.0%>                             |
| (メキシコ)<br>FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D<br>CEMEX SAB DE CV<br>FIBRA UNO ADMINISTRACION SA |         | 千口<br>203.9<br>1,546.875<br>322.6 |     | 千口<br>184.4<br>1,485.375<br>326.1 | 千メキシコ・ペソ<br>33,477<br>13,724<br>8,951 |
| 小計   | □       | 数<br>2,073.375                    | □   | 数<br>1,995.875                    | 金額<br>56,154                          |
|  | 銘       | 柄                                 | 数<比 | 率>                                | 3銘柄<0.6%>                             |
| (南アフリカ)<br>HYPROP INVESTMENTS LTD<br>FORTRESS REIT LTD-B<br>RESILIENT REIT LTD               |         | 千口<br>29.707<br>-<br>28.6         |     | 千口<br>22.174<br>57.784<br>28.6    | 千南アフリカ・ランド<br>1,646<br>606<br>1,605   |
| 小計   | □       | 数<br>58.307                       | □   | 数<br>108.558                      | 金額<br>3,858                           |
|  | 銘       | 柄                                 | 数<比 | 率>                                | 2銘柄<0.1%>                             |
| 合計   | □       | 数<br>2,362.753                    | □   | 数<br>2,104.433                    | 金額<br>365,061                         |
|  | 銘       | 柄                                 | 数<比 | 率>                                | 6銘柄<0.7%>                             |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

### (4) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別                 | 当期 |              | 期末       |
|----|-------------------|----|--------------|----------|
|    |                   | 買  | 建            | 建        |
| 外国 | MINI MSCI EMG MKT |    | 百万円<br>2,724 | 百万円<br>- |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を期末の仲値により、邦貨換算したものです。

### ■投資信託財産の構成

2019年4月18日現在

| 項目            | 当期         |    | 期末    |
|---------------|------------|----|-------|
|               | 評価         | 額  | 比率    |
| 株             |            | 千円 | %     |
| 株             | 58,119,723 |    | 94.2  |
| 新株予約権証券       | 238        |    | 0.0   |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 365,061    |    | 0.6   |
| コール・ローン等、その他  | 3,232,502  |    | 5.2   |
| 投資信託財産総額      | 61,717,526 |    | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、61,510,889千円、99.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.04円、1香港・ドル=14.28円、1台湾・ドル=3.63円、1イギリス・ポンド=146.09円、1トルコ・リラ=19.44円、1メキシコ・ペソ=5.95円、1フィリピン・ペソ=2.17円、100チリ・ペソ=16.93円、100コロンビア・ペソ=3.55円、1カタール・リアル=30.69円、1インド・ルピー=1.63円、1パキスタン・ルピー=0.80円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.55円、1ブラジル・レアル=28.42円、1チェコ・コルナ=4.93円、100韓国・ウォン=9.89円、1オフショア・人民元=16.76円、1マレーシア・リンギット=27.05円、1南アフリカ・ランド=8.02円、1タイ・バーツ=3.52円、1ポーランド・ズロチ=29.62円、100ハンガリー・フォリント=39.62円、1ユーロ=126.50円です。



■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年4月18日)現在

| 項 目                        | 当 期 末           |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産                    | 61,997,526,658円 |
| コ ー ル ・ 口 ー ン 等            | 1,860,304,809   |
| 株 式(評価額)                   | 58,119,723,394  |
| 新 株 予 約 権 証 券(評価額)         | 238,966         |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)       | 280,855,976     |
| 投 資 証 券(評価額)               | 84,206,023      |
| 未 収 入 金                    | 395,867,286     |
| 未 収 配 当 金                  | 106,206,557     |
| 差 入 委 託 証 拠 金              | 1,150,123,647   |
| (B) 負 債                    | 462,215,896     |
| 未 払 金                      | 300,572,896     |
| 未 払 解 約 金                  | 161,643,000     |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)       | 61,535,310,762  |
| 元 本                        | 50,190,897,430  |
| 次 期 繰 越 損 益 金              | 11,344,413,332  |
| (D) 受 益 権 総 口 数            | 50,190,897,430口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 12,260円         |

|  |                 |                                   |                 |
|--|-----------------|-----------------------------------|-----------------|
| (注1) 期首元本額                             | 54,278,179,845円 | たわらノーロード 最適化バランス (積極型)            | 1,087,195円      |
| 追加設定元本額                                | 37,610,929,316円 | マネックス資産設計ファンド エボリューション            | 453,215,866円    |
| 一部解約元本額                                | 41,698,211,731円 | DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)       | 322,361,801円    |
| (注2) 期末における元本の内訳                       |                 | DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)       | 287,554,676円    |
| DIAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>              | 4,469,397,794円  | DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)       | 570,061,430円    |
| DIAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ) | 497,639,634円    | 投資のソムリエ                           | 7,790,159,816円  |
| MITO ラップ型ファンド (安定型)                    | 3,316,467円      | クルーズコントロール                        | 1,134,187,407円  |
| MITO ラップ型ファンド (中立型)                    | 11,116,546円     | 投資のソムリエ<DC年金>                     | 794,559,986円    |
| MITO ラップ型ファンド (積極型)                    | 13,466,899円     | DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>           | 247,104,657円    |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)                  | 29,486,742円     | クルーズコントロール<DC年金>                  | 794,812円        |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)                  | 30,019,978円     | DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)              | 18,102,848円     |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)                  | 17,894,922円     | DIAMコア資産設計ファンド (積極型)              | 56,295,543円     |
| たわらノーロード 新興国株式                         | 4,693,236,793円  | 投資のソムリエ<DC年金> リスク抑制型              | 186,431,702円    |
| たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>                  | 1,745,232,327円  | ダイナミック・ナビゲーション                    | 1,713,505円      |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)                 | 295,037,515円    | リスク抑制世界8資産バランスファンド                | 2,843,208,568円  |
| たわらノーロード バランス (堅実型)                    | 1,803,077円      | ワールドアセットバランス (基本コース)              | 1,641,892,969円  |
| たわらノーロード バランス (標準型)                    | 7,560,261円      | ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)           | 6,277,274,398円  |
| たわらノーロード バランス (積極型)                    | 15,098,973円     | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)           | 2,640,706円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)           | 175,580円        | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)           | 2,310,127円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)           | 10,838,161円     | リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)           | 1,309,203円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)         | 32,241,674円     | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)           | 4,477,478円      |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)           | 22,721,778円     | リスクコントロール世界資産分散ファンド               | 274,183,673円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)           | 56,609,773円     | 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>              | 7,252,317円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)                 | 127,493円        | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)           | 596,693円        |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)               | 509,106円        | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)           | 596,693円        |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)                 | 376,542円        | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)           | 596,693円        |
|  |                 | エマージング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用)    | 2,882,007,336円  |
|  |                 | DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 5,109,239,057円  |
|  |                 | DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) | 7,325,772,240円  |
|  |                 | 期末元本合計                            | 50,190,897,430円 |

## ■損益の状況

当期 自2018年4月19日 至2019年4月18日

| 項     | 目                      | 当 期            |
|-------|------------------------|----------------|
| (A) 配 | 当 等 収 益                | 1,399,686,680円 |
| 受     | 取 配 当 金                | 1,365,680,284  |
| 受     | 取 利 息                  | 24,098,969     |
| そ     | の 他 収 益                | 10,186,857     |
| 支     | 払 利 息                  | △279,430       |
| (B) 有 | 価 証 券 売 買 損 益          | △1,501,450,165 |
| 売     | 買 益                    | 5,926,629,433  |
| 売     | 買 損                    | △7,428,079,598 |
| (C) 先 | 物 取 引 等 取 引 損 益        | △375,977,187   |
| 取     | 引 益                    | 674,386,014    |
| 取     | 引 損                    | △1,050,363,201 |
| (D) そ | の 他 費 用                | △81,267,514    |
| (E) 当 | 期 損 益 金(A + B + C + D) | △559,008,186   |
| (F) 前 | 期 繰 越 損 益 金            | 12,165,560,917 |
| (G) 解 | 約 差 損 益 金              | △6,180,451,083 |
| (H) 追 | 加 信 託 差 損 益 金          | 5,918,311,684  |
| (I) 合 | 計(E + F + G + H)       | 11,344,413,332 |
| 次     | 期 繰 越 損 益 金(I)         | 11,344,413,332 |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

# エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 運用報告書

第11期 (決算日 2019年4月18日)

(計算期間 2018年4月19日～2019年4月18日)

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第11期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。

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 2008年3月6日から無期限です。   |
| 運用方針   | 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 新興国の公社債を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限 | 外貨建資産への投資には、制限を設けません。<br>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。                                      |

### ■最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額   |       | JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス<br>(円換算ベース・為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |       | 債券組入率 | 債券先物率 | 純資産総額   |
|------------------|--------|-------|--|-------|-------|-------|---------|
|                  | 円      | 騰落率   | ポイント   | 騰落率   |       |       |         |
| 7期 (2015年4月20日)  | 18,383 | 26.0% | 84,996.05  | 21.0% | 96.5% | -     | 51,976  |
| 8期 (2016年4月18日)  | 17,120 | △6.9  | 81,716.02  | △3.9  | 96.5% | -     | 51,487  |
| 9期 (2017年4月18日)  | 17,917 | 4.7   | 88,609.40  | 8.4   | 96.8% | -     | 80,269  |
| 10期 (2018年4月18日) | 17,815 | △0.6  | 87,698.99  | △1.0  | 96.4% | -     | 111,615 |
| 11期 (2019年4月18日) | 19,206 | 7.8   | 93,647.60  | 6.8   | 97.5% | -     | 108,066 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

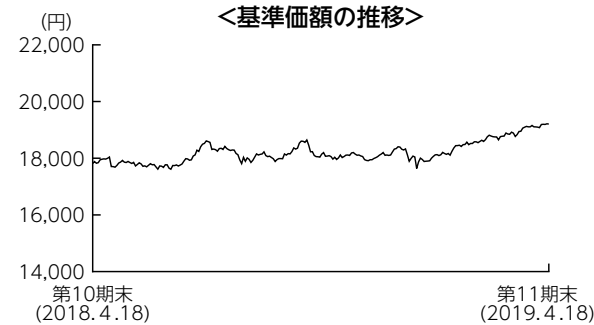
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                    | 基 準 価 額     |        | J Pモルガン・エマージング・<br>マーケット・ボンド・<br>インデックス・プラス<br>(円換算ベース・<br>為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |        | 債券組入<br>比 | 債券先物<br>率 |
|--------------------------|-------------|--------|---|--------|-----------|-----------|
|                          |             | 騰 落 率  |   | 騰 落 率  |           |           |
| (期 首)<br>2018 年 4 月 18 日 | 円<br>17,815 | %<br>- | ポイント<br>87,698.99   | %<br>- | %<br>96.4 | %<br>-    |
| 4 月 末                    | 17,968      | 0.9    | 88,312.05   | 0.7    | 96.7      | -         |
| 5 月 末                    | 17,729      | △0.5   | 86,655.48   | △1.2   | 96.7      | -         |
| 6 月 末                    | 17,896      | 0.5    | 86,804.46   | △1.0   | 96.0      | -         |
| 7 月 末                    | 18,309      | 2.8    | 88,872.32   | 1.3    | 96.6      | -         |
| 8 月 末                    | 18,092      | 1.6    | 86,318.34   | △1.6   | 96.3      | -         |
| 9 月 末                    | 18,532      | 4.0    | 90,536.26   | 3.2    | 95.8      | -         |
| 10 月 末                   | 18,112      | 1.7    | 88,388.61   | 0.8    | 96.4      | -         |
| 11 月 末                   | 18,107      | 1.6    | 88,280.96   | 0.7    | 96.4      | -         |
| 12 月 末                   | 18,043      | 1.3    | 87,735.63   | 0.0    | 91.5      | -         |
| 2019 年 1 月 末             | 18,109      | 1.7    | 89,669.33   | 2.2    | 97.8      | -         |
| 2 月 末                    | 18,656      | 4.7    | 92,243.65   | 5.2    | 95.8      | -         |
| 3 月 末                    | 19,062      | 7.0    | 93,010.99   | 6.1    | 96.6      | -         |
| (期 末)<br>2019 年 4 月 18 日 | 19,206      | 7.8    | 93,647.60   | 6.8    | 97.5      | -         |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年4月19日から2019年4月18日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は19,206円となり、前期末比で7.8%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

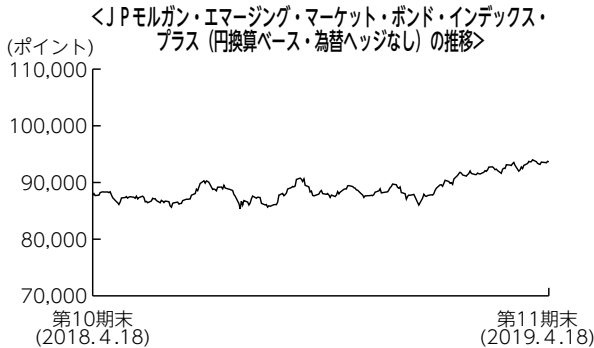
当期の新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）したものの、債券の利息収入や、為替市場で円安米ドル高が進行したことなどを主な要因として、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

当期の新興国債券の利回りは上昇しました。

ベースとなる米国の長期金利は、良好な米雇用統計等を背景に上昇する局面もありましたが、その後FOMC（米連邦公開市場委員会）において2019年内の利上げを見送る姿勢が示されたことなどを背景にやや低下（価格は上昇）して期末を迎えました。

新興国債券の対米国債スプレッド（利回り格差）は、貿易摩擦への懸念などから拡大しつつ推移しましたが、期末にかけて原油価格の反発などからやや縮小し、通期で見るとやや拡大となりました。



為替市場では、期初から2018年12月にかけては、良好な米経済指標や米国の長期金利がやや上昇基調で推移したことなどを背景に、円安ドル高が進みました。12月後半からは、米国の長期金利の低下により日米金利差が縮まったことや、世界的な景気減速懸念を背景としたリスク回避的な動きなどを要因として、円買いが進みました。その後、米中貿易協議の進展への期待感などを背景に円安方向へ推移し、通期で見ると円安ドル高が進みました。

## ポートフォリオについて

ベンチマークである J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

### 【運用状況】

#### ○国別構成比 期首（前期末）

| 国         | ファンド   | ベンチマーク | 差     |        |
|-----------|--------|--------|-------|--------|
| 中南米       | アルゼンチン | 0.0%   | 11.5% | △11.5% |
|           | ブラジル   | 9.8%   | 8.0%  | 1.8%   |
|           | メキシコ   | 12.8%  | 11.0% | 1.9%   |
|           | パナマ    | 4.8%   | 3.1%  | 1.8%   |
|           | ペルー    | 4.2%   | 2.5%  | 1.8%   |
|           | ベネズエラ  | 0.0%   | 2.7%  | △2.7%  |
|           | コロンビア  | 8.7%   | 6.8%  | 1.8%   |
| 計         | 40.4%  | 45.5%  | △5.1% |        |
| 欧州        | ハンガリー  | 4.6%   | 4.0%  | 0.6%   |
|           | ロシア    | 10.9%  | 9.1%  | 1.8%   |
|           | トルコ    | 13.9%  | 12.2% | 1.7%   |
|           | ウクライナ  | 0.0%   | 4.5%  | △4.5%  |
|           | クロアチア  | 3.0%   | 2.5%  | 0.5%   |
|           | ルーマニア  | 2.0%   | 1.9%  | 0.1%   |
| 計         | 34.5%  | 34.2%  | 0.3%  |        |
| アジア・オセアニア | インドネシア | 10.1%  | 9.4%  | 0.7%   |
|           | フィリピン  | 7.1%   | 6.9%  | 0.3%   |
| 計         | 17.2%  | 16.2%  | 1.0%  |        |
| アフリカ      | 南アフリカ  | 4.3%   | 4.0%  | 0.3%   |
|           | 計      | 4.3%   | 4.0%  | 0.3%   |
| 現金など      | 3.6%   | -      | -     |        |
| 合計        | 100.0% | 100.0% | -     |        |

#### 期末

| 国         | ファンド   | ベンチマーク | 差     |        |
|-----------|--------|--------|-------|--------|
| 中南米       | アルゼンチン | 0.0%   | 10.6% | △10.6% |
|           | ブラジル   | 11.0%  | 8.6%  | 2.4%   |
|           | メキシコ   | 15.3%  | 12.2% | 3.1%   |
|           | パナマ    | 5.6%   | 3.2%  | 2.4%   |
|           | ペルー    | 5.1%   | 2.5%  | 2.6%   |
|           | ベネズエラ  | 0.0%   | 2.5%  | △2.5%  |
|           | コロンビア  | 9.4%   | 7.0%  | 2.4%   |
| 計         | 46.4%  | 46.8%  | △0.3% |        |
| 欧州        | ハンガリー  | 5.7%   | 3.3%  | 2.3%   |
|           | ロシア    | 10.8%  | 8.4%  | 2.4%   |
|           | トルコ    | 0.0%   | 11.6% | △11.6% |
|           | ウクライナ  | 0.0%   | 4.0%  | △4.0%  |
|           | クロアチア  | 4.3%   | 1.9%  | 2.3%   |
|           | ルーマニア  | 4.6%   | 2.1%  | 2.5%   |
| 計         | 25.4%  | 31.4%  | △6.0% |        |
| アジア・オセアニア | インドネシア | 12.4%  | 10.9% | 1.5%   |
|           | フィリピン  | 8.3%   | 7.0%  | 1.3%   |
| 計         | 20.7%  | 17.9%  | 2.8%  |        |
| アフリカ      | 南アフリカ  | 5.0%   | 3.9%  | 1.0%   |
|           | 計      | 5.0%   | 3.9%  | 1.0%   |
| 現金など      | 2.5%   | -      | -     |        |
| 合計        | 100.0% | 100.0% | -     |        |



(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) ベンチマークは、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスです。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で6.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを1.0%上回りました。これは、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目       | 当 期 |         |
|-----------|-----|---------|
|           | 金 額 | 比 率     |
| (a) その他費用 | 2円  | 0.012%  |
| （保管費用）    | (2) | (0.012) |
| （その他）     | (0) | (0.000) |
| 合 計       | 2   | 0.012   |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（18,213円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については13ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況（2018年4月19日から2019年4月18日まで）

### 公社債

|    |         |         | 買 付 額     | 売 付 額                |
|----|---------|---------|-----------|----------------------|
| 外国 | ア メ リ カ | 国 債 証 券 | 千アメリカ・ドル  | 千アメリカ・ドル             |
|    |         |         | 1,062,466 | 1,100,312<br>(2,459) |

(注1) 金額は受渡代金です（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。

## ■ 利害関係人との取引状況等（2018年4月19日から2019年4月18日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

## ■組入資産の明細

### 公社債

#### (A) 債券種類別開示

##### 外国（外貨建）公社債

| 区 分     | 当 期 末    |          |             |      |                 |           |      |      |
|---------|----------|----------|-------------|------|-----------------|-----------|------|------|
|         | 額 面 金 額  | 評 価 額    |             | 組入比率 | うちＢＢ格<br>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年末満 |
|         | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円          | %    | %               | %         | %    | %    |
| ア メ リ カ | 876,100  | 940,532  | 105,377,278 | 97.5 | 11.0            | 68.9      | 21.6 | 6.9  |
| 合 計     | —        | —        | 105,377,278 | 97.5 | 11.0            | 68.9      | 21.6 | 6.9  |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

#### (B) 個別銘柄開示

##### 外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄                                 | 当 期 末 |        |          |           |             |            |  |  |
|-------------------------------------|-------|--------|----------|-----------|-------------|------------|--|--|
|                                     | 種 類   | 利 率    | 額 面 金 額  | 評 価 額     |             | 償還年月日      |  |  |
|                                     |       |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |  |
|                                     |       | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |  |  |
| (アメリカ)                              |       | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |  |  |
| UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 | 国債証券  | 6.0500 | 11,900   | 13,506    | 1,513,281   | 2040/01/11 |  |  |
| BRAZIL 5.625 01/07/41               | 国債証券  | 5.6250 | 9,100    | 9,031     | 1,011,917   | 2041/01/07 |  |  |
| UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46  | 国債証券  | 4.6000 | 10,000   | 9,530     | 1,067,741   | 2046/01/23 |  |  |
| BRAZIL 4.25 01/07/25                | 国債証券  | 4.2500 | 13,100   | 13,214    | 1,480,566   | 2025/01/07 |  |  |
| PANAMA 7.125 01/29/26               | 国債証券  | 7.1250 | 4,800    | 5,830     | 653,288     | 2026/01/29 |  |  |
| PHILIPPINES 7.75 01/14/31           | 国債証券  | 7.7500 | 6,100    | 8,515     | 954,026     | 2031/01/14 |  |  |
| ROMANIA 6.125 01/22/44              | 国債証券  | 6.1250 | 5,400    | 6,134     | 687,364     | 2044/01/22 |  |  |
| UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 | 国債証券  | 5.5500 | 10,400   | 11,312    | 1,267,475   | 2045/01/21 |  |  |
| SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24         | 国債証券  | 4.6650 | 6,100    | 6,194     | 694,016     | 2024/01/17 |  |  |
| PHILIPPINES 6.375 01/15/32          | 国債証券  | 6.3750 | 3,600    | 4,609     | 516,449     | 2032/01/15 |  |  |
| COLOMBIA 6.125 01/18/41             | 国債証券  | 6.1250 | 9,000    | 10,561    | 1,183,320   | 2041/01/18 |  |  |
| INDONESIA 5.25 01/17/42             | 国債証券  | 5.2500 | 7,300    | 7,870     | 881,793     | 2042/01/17 |  |  |
| INDONESIA 6.75 01/15/44             | 国債証券  | 6.7500 | 6,500    | 8,325     | 932,769     | 2044/01/15 |  |  |
| BRAZIL 5.0 01/27/45                 | 国債証券  | 5.0000 | 11,800   | 10,656    | 1,193,989   | 2045/01/27 |  |  |
| UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47 | 国債証券  | 4.3500 | 7,000    | 6,462     | 724,086     | 2047/01/15 |  |  |
| PHILIPPINES 4.0 01/15/21            | 国債証券  | 4.0000 | 7,400    | 7,529     | 843,555     | 2021/01/15 |  |  |
| INDONESIA 5.125 01/15/45            | 国債証券  | 5.1250 | 6,400    | 6,810     | 763,062     | 2045/01/15 |  |  |
| INDONESIA 5.25 01/08/47             | 国債証券  | 5.2500 | 3,400    | 3,687     | 413,098     | 2047/01/08 |  |  |
| INDONESIA 4.35 01/11/48             | 国債証券  | 4.3500 | 4,400    | 4,317     | 483,683     | 2048/01/11 |  |  |
| BRAZIL 8.25 01/20/34                | 国債証券  | 8.2500 | 5,200    | 6,573     | 736,474     | 2034/01/20 |  |  |
| PANAMA 6.7 01/26/36                 | 国債証券  | 6.7000 | 9,900    | 12,781    | 1,432,082   | 2036/01/26 |  |  |
| BRAZIL 7.125 01/20/37               | 国債証券  | 7.1250 | 8,300    | 9,731     | 1,090,345   | 2037/01/20 |  |  |
| INDONESIA 7.75 01/17/38             | 国債証券  | 7.7500 | 6,500    | 8,915     | 998,946     | 2038/01/17 |  |  |
| PHILIPPINES 3.95 01/20/40           | 国債証券  | 3.9500 | 6,800    | 7,059     | 790,945     | 2040/01/20 |  |  |
| INDONESIA 5.95 01/08/46             | 国債証券  | 5.9500 | 4,200    | 4,937     | 553,246     | 2046/01/08 |  |  |
| BRAZIL 4.875 01/22/21               | 国債証券  | 4.8750 | 13,400   | 13,842    | 1,550,880   | 2021/01/22 |  |  |
| UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25  | 国債証券  | 3.6000 | 9,200    | 9,158     | 1,026,129   | 2025/01/30 |  |  |
| PHILIPPINES 5.0 01/13/37            | 国債証券  | 5.0000 | 4,800    | 5,617     | 629,377     | 2037/01/13 |  |  |
| INDONESIA 4.125 01/15/25            | 国債証券  | 4.1250 | 11,800   | 12,094    | 1,355,044   | 2025/01/15 |  |  |
| INDONESIA 4.35 01/08/27             | 国債証券  | 4.3500 | 5,000    | 5,166     | 578,832     | 2027/01/08 |  |  |
| ROMANIA 4.875 01/22/24              | 国債証券  | 4.8750 | 6,600    | 7,008     | 785,266     | 2024/01/22 |  |  |
| COLOMBIA 4.5 01/28/26               | 国債証券  | 4.5000 | 5,000    | 5,249     | 588,137     | 2026/01/28 |  |  |
| CROATIA 6.0 01/26/24                | 国債証券  | 6.0000 | 7,400    | 8,262     | 925,677     | 2024/01/26 |  |  |



| 銘柄                                   | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額  | 期 間       |             | 償 還 年 月 日  |
|--------------------------------------|------|--------|----------|-----------|-------------|------------|
|                                      |      |        |          | 評 価 額     |             |            |
|                                      |      |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| (アメリカ)                               |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |
| UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 | 国債証券 | 4.1250 | 8,000    | 8,124     | 910,302     | 2026/01/21 |
| INDONESIA 5.875 01/15/24             | 国債証券 | 5.8750 | 6,200    | 6,833     | 765,668     | 2024/01/15 |
| INDONESIA 4.75 01/08/26              | 国債証券 | 4.7500 | 6,800    | 7,195     | 806,197     | 2026/01/08 |
| PHILIPPINES 4.2 01/21/24             | 国債証券 | 4.2000 | 5,800    | 6,112     | 684,890     | 2024/01/21 |
| BRAZIL 2.625 01/05/23                | 国債証券 | 2.6250 | 7,800    | 7,546     | 845,518     | 2023/01/05 |
| BRAZIL 4.625 01/13/28                | 国債証券 | 4.6250 | 10,800   | 10,802    | 1,210,346   | 2028/01/13 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28  | 国債証券 | 3.7500 | 9,200    | 9,022     | 1,010,936   | 2028/01/11 |
| INDONESIA 3.5 01/11/28               | 国債証券 | 3.5000 | 3,200    | 3,108     | 348,259     | 2028/01/11 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21   | 国債証券 | 3.5000 | 6,400    | 6,472     | 725,216     | 2021/01/21 |
| INDONESIA 2.95 01/11/23              | 国債証券 | 2.9500 | 3,800    | 3,766     | 421,962     | 2023/01/11 |
| BRAZIL 8.75 02/04/25                 | 国債証券 | 8.7500 | 4,800    | 5,944     | 665,974     | 2025/02/04 |
| PHILIPPINES 3.7 02/02/42             | 国債証券 | 3.7000 | 6,400    | 6,362     | 712,811     | 2042/02/02 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48   | 国債証券 | 4.6000 | 8,400    | 8,027     | 899,368     | 2048/02/10 |
| PHILIPPINES 9.5 02/02/30             | 国債証券 | 9.5000 | 6,400    | 9,794     | 1,097,346   | 2030/02/02 |
| COLOMBIA 5.625 02/26/44              | 国債証券 | 5.6250 | 9,000    | 10,029    | 1,123,686   | 2044/02/26 |
| ROMANIA 6.75 02/07/22                | 国債証券 | 6.7500 | 13,500   | 14,739    | 1,651,421   | 2022/02/07 |
| BRAZIL 5.625 02/21/47                | 国債証券 | 5.6250 | 9,600    | 9,380     | 1,050,985   | 2047/02/21 |
| COLOMBIA 4.0 02/26/24                | 国債証券 | 4.0000 | 9,100    | 9,348     | 1,047,357   | 2024/02/26 |
| HUNGARY 5.375 02/21/23               | 国債証券 | 5.3750 | 9,600    | 10,337    | 1,158,231   | 2023/02/21 |
| PHILIPPINES 3.0 02/01/28             | 国債証券 | 3.0000 | 6,000    | 5,875     | 658,270     | 2028/02/01 |
| PANAMA 3.875 03/17/28                | 国債証券 | 3.8750 | 6,100    | 6,279     | 703,516     | 2028/03/17 |
| RUSSIAN FEDERATION 03/31/30          | 国債証券 | 7.5000 | 12,300   | 13,714    | 1,536,572   | 2030/03/31 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44  | 国債証券 | 4.7500 | 15,400   | 14,976    | 1,677,967   | 2044/03/08 |
| RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29    | 国債証券 | 4.3750 | 5,400    | 5,398     | 604,810     | 2029/03/21 |
| PHILIPPINES 5.5 03/30/26             | 国債証券 | 5.5000 | 3,600    | 4,122     | 461,832     | 2026/03/30 |
| PERU 6.55 03/14/37                   | 国債証券 | 6.5500 | 6,000    | 8,003     | 896,700     | 2037/03/14 |
| HUNGARY 7.625 03/29/41               | 国債証券 | 7.6250 | 5,400    | 8,021     | 898,775     | 2041/03/29 |
| PHILIPPINES 3.7 03/01/41             | 国債証券 | 3.7000 | 6,600    | 6,577     | 736,957     | 2041/03/01 |
| HUNGARY 5.375 03/25/24               | 国債証券 | 5.3750 | 8,600    | 9,407     | 1,054,020   | 2024/03/25 |
| PANAMA 3.75 03/16/25                 | 国債証券 | 3.7500 | 8,200    | 8,400     | 941,236     | 2025/03/16 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 | 国債証券 | 3.6250 | 8,900    | 9,042     | 1,013,110   | 2022/03/15 |
| HUNGARY 6.375 03/29/21               | 国債証券 | 6.3750 | 15,000   | 15,967    | 1,788,948   | 2021/03/29 |
| CROATIA 6.375 03/24/21               | 国債証券 | 6.3750 | 9,400    | 9,912     | 1,110,574   | 2021/03/24 |
| COLOMBIA 2.625 03/15/23              | 国債証券 | 2.6250 | 4,700    | 4,588     | 514,086     | 2023/03/15 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27  | 国債証券 | 4.1500 | 12,400   | 12,524    | 1,403,188   | 2027/03/28 |
| PANAMA 4.5 04/16/50                  | 国債証券 | 4.5000 | 8,300    | 8,550     | 957,978     | 2050/04/16 |
| PANAMA 9.375 04/01/29                | 国債証券 | 9.3750 | 4,900    | 7,109     | 796,598     | 2029/04/01 |
| RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42    | 国債証券 | 5.6250 | 10,800   | 11,837    | 1,326,267   | 2042/04/04 |
| INDONESIA 4.625 04/15/43             | 国債証券 | 4.6250 | 5,400    | 5,455     | 611,199     | 2043/04/15 |
| RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22      | 国債証券 | 4.5000 | 9,800    | 10,111    | 1,132,908   | 2022/04/04 |
| INDONESIA 3.75 04/25/22              | 国債証券 | 3.7500 | 8,000    | 8,115     | 909,262     | 2022/04/25 |
| COLOMBIA 3.875 04/25/27              | 国債証券 | 3.8750 | 9,600    | 9,652     | 1,081,478   | 2027/04/25 |
| CROATIA 5.5 04/04/23                 | 国債証券 | 5.5000 | 9,400    | 10,147    | 1,136,871   | 2023/04/04 |
| INDONESIA 3.375 04/15/23             | 国債証券 | 3.3750 | 4,700    | 4,714     | 528,178     | 2023/04/15 |
| INDONESIA 4.1 04/24/28               | 国債証券 | 4.1000 | 5,000    | 5,067     | 567,751     | 2028/04/24 |
| BRAZIL 6.0 04/07/26                  | 国債証券 | 6.0000 | 8,800    | 9,684     | 1,085,050   | 2026/04/07 |
| SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26          | 国債証券 | 4.8750 | 4,400    | 4,395     | 492,502     | 2026/04/14 |
| COLOMBIA 8.125 05/21/24              | 国債証券 | 8.1250 | 2,900    | 3,495     | 391,588     | 2024/05/21 |
| SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22          | 国債証券 | 5.8750 | 4,000    | 4,226     | 473,512     | 2022/05/30 |
| PANAMA 4.5 05/15/47                  | 国債証券 | 4.5000 | 5,000    | 5,197     | 582,327     | 2047/05/15 |
| INDONESIA 4.875 05/05/21             | 国債証券 | 4.8750 | 10,100   | 10,455    | 1,171,425   | 2021/05/05 |
| RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26     | 国債証券 | 4.7500 | 10,400   | 10,743    | 1,203,668   | 2026/05/27 |
| SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30          | 国債証券 | 5.8750 | 5,400    | 5,575     | 624,709     | 2030/06/22 |

| 銘柄                                    | 種 類  | 利 率    | 額 面 金 額  | 期 間       |             | 償 還 年 月 日  |
|---------------------------------------|------|--------|----------|-----------|-------------|------------|
|                                       |      |        |          | 評 価 額     |             |            |
|                                       |      |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
| (アメリカ)                                |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |
| COLOMBIA 5.0 06/15/45                 | 国債証券 | 5.0000 | 17,000   | 17,637    | 1,976,105   | 2045/06/15 |
| ROMANIA 5.125 06/15/48                | 国債証券 | 5.1250 | 6,600    | 6,495     | 727,802     | 2048/06/15 |
| SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48             | 国債証券 | 6.3000 | 2,000    | 2,041     | 228,696     | 2048/06/22 |
| RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47      | 国債証券 | 5.2500 | 25,000   | 25,485    | 2,855,339   | 2047/06/23 |
| RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27      | 国債証券 | 4.2500 | 9,400    | 9,383     | 1,051,354   | 2027/06/23 |
| PERU 7.35 07/21/25                    | 国債証券 | 7.3500 | 12,300   | 15,274    | 1,711,314   | 2025/07/21 |
| SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44           | 国債証券 | 5.3750 | 3,800    | 3,556     | 398,525     | 2044/07/24 |
| COLOMBIA 4.375 07/12/21               | 国債証券 | 4.3750 | 10,200   | 10,493    | 1,175,663   | 2021/07/12 |
| CROATIA 6.625 07/14/20                | 国債証券 | 6.6250 | 12,500   | 13,023    | 1,459,124   | 2020/07/14 |
| INDONESIA 3.85 07/18/27               | 国債証券 | 3.8500 | 2,600    | 2,601     | 291,423     | 2027/07/18 |
| PERU 4.125 08/25/27                   | 国債証券 | 4.1250 | 7,300    | 7,869     | 881,695     | 2027/08/25 |
| ROMANIA 4.375 08/22/23                | 国債証券 | 4.3750 | 10,000   | 10,360    | 1,160,734   | 2023/08/22 |
| SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25           | 国債証券 | 5.8750 | 7,200    | 7,650     | 857,106     | 2025/09/16 |
| COLOMBIA 7.375 09/18/37               | 国債証券 | 7.3750 | 7,400    | 9,597     | 1,075,337   | 2037/09/18 |
| UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34   | 国債証券 | 6.7500 | 6,200    | 7,599     | 851,430     | 2034/09/27 |
| SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47            | 国債証券 | 5.6500 | 4,200    | 4,015     | 449,853     | 2047/09/27 |
| RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43     | 国債証券 | 5.8750 | 4,200    | 4,737     | 530,772     | 2043/09/16 |
| RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23     | 国債証券 | 4.8750 | 12,400   | 13,049    | 1,462,109   | 2023/09/16 |
| UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 | 国債証券 | 5.7500 | 8,800    | 8,943     | 1,001,973   | 2110/10/12 |
| PHILIPPINES 6.375 10/23/34            | 国債証券 | 6.3750 | 6,000    | 7,913     | 886,624     | 2034/10/23 |
| SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28             | 国債証券 | 4.3000 | 7,200    | 6,789     | 760,658     | 2028/10/12 |
| SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46             | 国債証券 | 5.0000 | 3,800    | 3,404     | 381,465     | 2046/10/12 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23    | 国債証券 | 4.0000 | 12,500   | 12,859    | 1,440,722   | 2023/10/02 |
| PERU 5.625 11/18/50                   | 国債証券 | 5.6250 | 14,000   | 17,922    | 2,008,023   | 2050/11/18 |
| HUNGARY 5.75 11/22/23                 | 国債証券 | 5.7500 | 10,000   | 11,033    | 1,236,215   | 2023/11/22 |
| 合 計                                   | -    | -      | 876,100  | 940,532   | 105,377,278 | -          |

## ■投資信託財産の構成

2019年4月18日現在

| 項 目                     | 当 期               | 末         |
|-------------------------|-------------------|-----------|
|                         | 評 価 額             | 比 率       |
| 公 社 債                   | 千円<br>105,377,278 | %<br>97.4 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,776,376         | 2.6       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 108,153,654       | 100.0     |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、108,062,033千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.04円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年4月18日)現在

| 項 目                | 当 期 末            |
|--------------------|------------------|
| (A) 資 産            | 108,198,466,795円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等    | 1,718,186,219    |
| 公 社 債(評価額)         | 105,377,278,778  |
| 未 収 入 金            | 44,849,600       |
| 未 収 入 息            | 952,624,823      |
| 前 払 費 用            | 105,527,375      |
| (B) 負 債            | 131,855,000      |
| 未 払 金              | 44,812,000       |
| 未 払 解 約 金          | 87,043,000       |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 108,066,611,795  |
| 元 本                | 56,267,402,909   |
| 次 期 繰 越 損 益 金      | 51,799,208,886   |
| (D) 受 益 権 総 口 数    | 56,267,402,909口  |
| 1万円当たり基準価額(C/D)    | 19,206円          |

(注1) 期首元本額 62,651,486,172円  
追加設定元本額 70,077,059,976円  
一部解約元本額 76,461,143,239円

(注2) 期末における元本の内訳

|   |                 |
|---|-----------------|
| DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>              | 244,903,365円    |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)                    | 186,943,193円    |
| たわらノーロード バランス (堅実型)                       | 9,275,929円      |
| たわらノーロード バランス (標準型)                       | 28,575,707円     |
| たわらノーロード バランス (積極型)                       | 14,342,881円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型)                    | 225,683円        |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)                    | 622,010円        |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)                  | 1,082,769円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)                    | 380,746円        |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)                    | 493,728円        |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション                    | 65,812,114円     |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10)                | 196,851,738円    |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20)                | 178,790,603円    |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30)                | 351,300,641円    |
| 投資のソムリエ                                   | 8,673,899,294円  |
| グループコントロール                                | 720,989,640円    |
| 投資のソムリエ<DC年金>                             | 866,443,655円    |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>                   | 150,180,507円    |
| グループコントロール<DC年金>                          | 505,453円        |
| DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)                      | 4,605,473円      |
| DIAMコア資産設計ファンド (積極型)                      | 14,319,990円     |
| 投資のソムリエ<DC年金>+リスク抑制型                      | 329,284,222円    |
| ダイナミック・ナビゲーション                            | 523,034円        |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                        | 5,014,673,512円  |
| ワールドアセットバランス (基本コース)                      | 1,007,730,855円  |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)                   | 3,896,242,405円  |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)                   | 3,585,101円      |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)                   | 3,128,078円      |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)                   | 2,356,956円      |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)                   | 6,074,397円      |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                       | 698,429,996円    |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                      | 4,591,616円      |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)                   | 795,968円        |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)                   | 795,968円        |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)                   | 795,968円        |
| エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)                | 16,237,347,272円 |
| エマージング債券バンプアップファンドVA (適格機関投資家専用)          | 1,660,368,468円  |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)         | 3,096,334,797円  |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)         | 4,451,022,211円  |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 3,910,785,285円  |
| P-Oneマルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)            | 4,231,991,681円  |
| 期末元本合計                                    | 56,267,402,909円 |

## ■損益の状況

当期 自2018年4月19日 至2019年4月18日

| 項 目                  | 当 期             |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | 5,154,885,774円  |
| 受 取 利 息              | 5,155,605,545   |
| 支 払 利 息              | △719,771        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | 2,842,026,651   |
| 売 買 益                | 8,983,662,591   |
| 売 買 損                | △6,141,635,940  |
| (C) そ の 他 費 用        | △12,198,340     |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 7,984,714,085   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 48,963,587,466  |
| (F) 解 約 差 損 益 金      | △62,063,267,689 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 56,914,175,024  |
| (H) 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 51,799,208,886  |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。  
(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

# J-R E I T インデックスファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第13期 (決算日 2019年6月6日)

(計算期間 2018年6月7日~2019年6月6日)

J-R E I T インデックスファンド・マザーファンドの第13期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。

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 2006年8月4日から無期限です。  |
| 運用方針   | 東証R E I T指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。                     |
| 主要投資対象 | 東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資は行いません。<br>外貨建資産への投資は行いません。<br>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。   |

### ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額   |      | 東証R E I T指数                |      | 投資証券<br>組入比率 | 不動産<br>投信先物<br>指数比率 | 純資産<br>総額 |
|----------------|--------|------|----------------------------|------|--------------|---------------------|-----------|
|                | 円      | 騰落率  | (配当込み)<br>ポイント<br>(ベンチマーク) | 騰落率  |              |                     |           |
| 9期(2015年6月8日)  | 17,124 | 21.8 | 3,194.43                   | 22.0 | 98.9         | -                   | 29,321    |
| 10期(2016年6月6日) | 18,293 | 6.8  | 3,414.59                   | 6.9  | 99.1         | -                   | 23,383    |
| 11期(2017年6月6日) | 17,626 | △3.6 | 3,285.51                   | △3.8 | 98.3         | 1.5                 | 29,280    |
| 12期(2018年6月6日) | 18,181 | 3.1  | 3,386.35                   | 3.1  | 97.8         | 1.7                 | 35,462    |
| 13期(2019年6月6日) | 20,819 | 14.5 | 3,880.89                   | 14.6 | 97.4         | 2.0                 | 33,154    |

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 東証R E I T指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(㈱東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証R E I T指数の商標に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません(以下同じ)。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

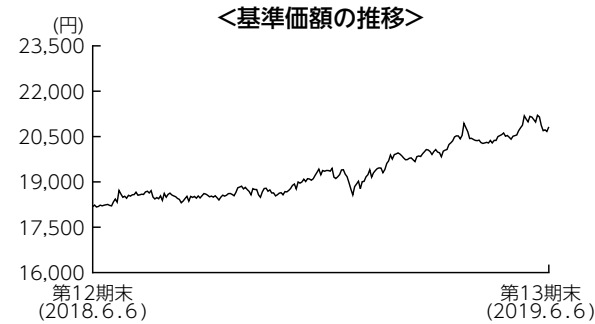
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                   | 基 準 価 額 |       | 東 証 R E I T 指 数<br>(配当込み)<br>(ベンチマーク) |       | 投 資 証 券<br>組 入 比 率 | 不 動 産<br>投 信 指 数<br>先 物 比 率 |
|-------------------------|---------|-------|---------------------------------------|-------|--------------------|-----------------------------|
|                         | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率                                 | 騰 落 率 |                    |                             |
| (期 首)<br>2018 年 6 月 6 日 | 円       | %     | ポイント                                  | %     | %                  | %                           |
|                         | 18,181  | —     | 3,386.35                              | —     | 97.8               | 1.7                         |
| 6 月 末                   | 18,525  | 1.9   | 3,450.92                              | 1.9   | 97.9               | 1.7                         |
| 7 月 末                   | 18,619  | 2.4   | 3,468.88                              | 2.4   | 97.9               | 1.6                         |
| 8 月 末                   | 18,559  | 2.1   | 3,457.71                              | 2.1   | 97.8               | 1.6                         |
| 9 月 末                   | 18,857  | 3.7   | 3,513.39                              | 3.8   | 98.0               | 1.6                         |
| 10 月 末                  | 18,572  | 2.2   | 3,459.73                              | 2.2   | 97.1               | 2.0                         |
| 11 月 末                  | 19,377  | 6.6   | 3,610.49                              | 6.6   | 97.3               | 2.0                         |
| 12 月 末                  | 19,022  | 4.6   | 3,543.83                              | 4.7   | 97.7               | 1.9                         |
| 2019 年 1 月 末            | 19,902  | 9.5   | 3,709.11                              | 9.5   | 97.6               | 1.9                         |
| 2 月 末                   | 20,003  | 10.0  | 3,728.00                              | 10.1  | 97.8               | 1.9                         |
| 3 月 末                   | 20,659  | 13.6  | 3,851.10                              | 13.7  | 97.4               | 2.0                         |
| 4 月 末                   | 20,510  | 12.8  | 3,822.76                              | 12.9  | 97.4               | 2.0                         |
| 5 月 末                   | 20,865  | 14.8  | 3,889.57                              | 14.9  | 97.4               | 2.1                         |
| (期 末)<br>2019 年 6 月 6 日 | 20,819  | 14.5  | 3,880.89                              | 14.6  | 97.4               | 2.0                         |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年6月7日から2019年6月6日まで）

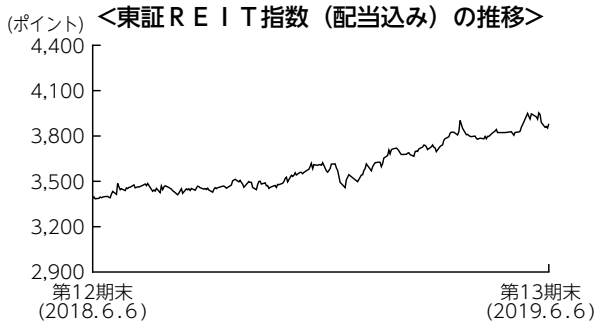


### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は20,819円となり、前期末比で14.5%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米中貿易摩擦問題の悪化や、世界景気の先行き不透明感が拡大する中で内需ディフェンシブ株の一角として株式投資家からの資金流入が見られたこと、資産入れ替えに伴う物件売却による含み益の還元や良好なオフィス市況が続いたことなどからJ-R E I T市場は堅調に推移し、基準価額は上昇しました。



### 投資環境

J-R E I T市場は米中貿易摩擦問題の悪化による世界景気の先行き不透明感の拡大から株式市場が調整色を強める中、2018年の年末にかけて急落する局面もありましたが、内需ディフェンシブ株の一角として株式投資家からの資金流入を支えに底堅い展開が続きました。積極的な資産入れ替え方針などによる投資主価値の向上への期待がJ-R E I T市場を支えました。用途別では、東京都心を中心に賃料上昇の加速が好感されたオフィスリートや住宅リートが強い展開となりました。

### ポートフォリオについて

リートの実質組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持するよう努めました。

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で14.6%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.1%下回りました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させましたので、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

### 今後の運用方針

引き続き、リートの実質組入比率を高め、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持するよう努めます。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目                                 | 当 期              |                              |
|-------------------------------------|------------------|------------------------------|
|                                     | 金 額              | 比 率                          |
| (a) 売買委託手数料<br>(先物・オプション)<br>(投資証券) | 0円<br>(0)<br>(0) | 0.002%<br>(0.001)<br>(0.002) |
| (b) その他費用<br>(その他)                  | 0<br>(0)         | 0.000<br>(0.000)             |
| 合 計                                 | 0                | 0.002                        |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(19,315円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については13ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (2018年6月7日から2019年6月6日まで)

### (1) 投資証券

|                         | 買 |        | 付 |           | 売 |        | 付 |           |
|-------------------------|---|--------|---|-----------|---|--------|---|-----------|
|                         | □ | 数      | 金 | 額         | □ | 数      | 金 | 額         |
|                         |   | 千口     |   | 千円        |   | 千口     |   | 千円        |
| <b>国内</b>               |   |        |   |           |   |        |   |           |
| エスコンジャパンリート投資法人         |   | 0.453  |   | 46,610    |   | 0.105  |   | 10,726    |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| サンケイリアルエステート投資法人        |   | 0.42   |   | 46,708    |   | 0.085  |   | 9,423     |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| 日本アコモデーションファンド投資法人      |   | 1.391  |   | 754,893   |   | 1.678  |   | 906,646   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| MCUBS MidCity投資法人       |   | 4.71   |   | 430,896   |   | 5.634  |   | 511,654   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| 森ヒルズリート投資法人             |   | 5.068  |   | 725,640   |   | 5.747  |   | 820,286   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| 産業ファンド投資法人              |   | 5.087  |   | 610,692   |   | 5.864  |   | 691,702   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| アドバンス・レジデンス投資法人         |   | 4.195  |   | 1,269,257 |   | 4.827  |   | 1,455,790 |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 |   | 2.891  |   | 503,716   |   | 2.958  |   | 515,373   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人      |   | 2.343  |   | 1,106,192 |   | 2.486  |   | 1,170,075 |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| GLP投資法人                 |   | 11.687 |   | 1,349,433 |   | 12.112 |   | 1,391,934 |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人      |   | 1.753  |   | 492,769   |   | 1.959  |   | 549,839   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| 日本プロロジスリート投資法人          |   | 5.605  |   | 1,304,769 |   | 6.724  |   | 1,553,801 |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| 星野リゾート・リート投資法人          |   | 0.638  |   | 347,485   |   | 0.794  |   | 431,757   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| Oneリート投資法人              |   | 0.727  |   | 189,664   |   | 0.698  |   | 182,879   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| イオンリート投資法人              |   | 4.527  |   | 577,287   |   | 5.084  |   | 643,391   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| ヒューリックリート投資法人           |   | 3.686  |   | 634,103   |   | 3.832  |   | 658,106   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| 日本リート投資法人               |   | 1.51   |   | 569,076   |   | 1.558  |   | 595,021   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人   |   | 25.362 |   | 413,479   |   | 29.75  |   | 482,466   |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |
| 日本ヘルスケア投資法人             |   | 0.194  |   | 33,447    |   | 0.245  |   | 42,198    |
|                         |   | (-)    |   | (-)       |   | (-)    |   | (-)       |

|                       | 買 付 額            |                  | 売 付 額           |                  |
|-----------------------|------------------|------------------|-----------------|------------------|
|                       | □ 数<br>千□        | 金 額<br>千円        | □ 数<br>千□       | 金 額<br>千円        |
| 積水ハウス・リート投資法人         | 10.88<br>(-)     | 816,731<br>(-)   | 12.78505<br>(-) | 955,482<br>(-)   |
| トーセイ・リート投資法人          | 0.872<br>(-)     | 98,683<br>(-)    | 0.903<br>(-)    | 102,485<br>(-)   |
| ケネディクス商業リート投資法人       | 1.531<br>(-)     | 388,310<br>(-)   | 1.834<br>(-)    | 463,791<br>(-)   |
| ヘルスケア&メディカル投資法人       | 0.979<br>(-)     | 113,387<br>(-)   | 0.792<br>(-)    | 89,753<br>(-)    |
| サムティ・レジデンシャル投資法人      | 0.925<br>(-)     | 87,638<br>(-)    | 0.985<br>(-)    | 92,271<br>(-)    |
| 野村不動産マスターファンド投資法人     | 12.795<br>(-)    | 1,991,751<br>(-) | 14.828<br>(-)   | 2,287,536<br>(-) |
| いちごホテルリート投資法人         | 0.795<br>(-)     | 107,721<br>(-)   | 0.868<br>(-)    | 117,299<br>(-)   |
| ラサールロジポート投資法人         | 3.398<br>(-)     | 377,212<br>(-)   | 3.804<br>(-)    | 413,302<br>(-)   |
| スターアジア不動産投資法人         | 1.572<br>(-)     | 169,393<br>(-)   | 1.517<br>(-)    | 161,151<br>(-)   |
| マリモ地方創生リート投資法人        | 0.373<br>(-)     | 41,552<br>(-)    | 0.422<br>(-)    | 46,668<br>(-)    |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人   | 1.088<br>(-)     | 366,513<br>(-)   | 1.07<br>(-)     | 357,633<br>(-)   |
| 大江戸温泉リート投資法人          | 0.677<br>(-)     | 57,303<br>(-)    | 0.843<br>(-)    | 71,784<br>(-)    |
| さくら総合リート投資法人          | 0.914<br>(-)     | 80,405<br>(-)    | 1.203<br>(-)    | 105,471<br>(-)   |
| 投資法人みらい               | 2.189<br>(2.811) | 293,230<br>(-)   | 1.966<br>(-)    | 237,514<br>(-)   |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人      | 1.038<br>(-)     | 144,685<br>(-)   | 1.163<br>(-)    | 159,389<br>(-)   |
| 三菱地所物流リート投資法人         | 0.488<br>(-)     | 124,478<br>(-)   | 0.523<br>(-)    | 132,034<br>(-)   |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | 0.419<br>(-)     | 45,504<br>(-)    | 0.505<br>(-)    | 54,693<br>(-)    |
| ザイマックス・リート投資法人        | 0.382<br>(-)     | 44,576<br>(-)    | 0.461<br>(-)    | 53,135<br>(-)    |
| タカラレーベン不動産投資法人        | 1.175<br>(-)     | 107,458<br>(-)   | 0.667<br>(-)    | 60,371<br>(-)    |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人  | 1.022<br>(-)     | 96,114<br>(-)    | 0.497<br>(-)    | 45,956<br>(-)    |
| 日本ビルファンド投資法人          | 4.049<br>(-)     | 2,800,052<br>(-) | 4.883<br>(-)    | 3,337,385<br>(-) |
| ジャパンリアルエステイト投資法人      | 4.181<br>(-)     | 2,586,008<br>(-) | 5.021<br>(-)    | 3,065,959<br>(-) |
| 日本リテールファンド投資法人        | 7.9<br>(-)       | 1,698,123<br>(-) | 9.521<br>(-)    | 2,030,412<br>(-) |
| オリックス不動産投資法人          | 8.333<br>(-)     | 1,531,673<br>(-) | 10.014<br>(-)   | 1,831,472<br>(-) |
| 日本プライムリアルティ投資法人       | 2.649<br>(-)     | 1,136,301<br>(-) | 3.187<br>(-)    | 1,353,309<br>(-) |
| プレミア投資法人              | 4.093<br>(-)     | 515,233<br>(-)   | 4.71<br>(-)     | 591,243<br>(-)   |
| 東急リアル・エステート投資法人       | 2.801<br>(-)     | 462,193<br>(-)   | 3.378<br>(-)    | 554,209<br>(-)   |
| グローバル・ワン不動産投資法人       | 2.895<br>(-)     | 351,407<br>(-)   | 3.25<br>(-)     | 391,392<br>(-)   |
| ユナイテッド・アーバン投資法人       | 9.222<br>(-)     | 1,616,588<br>(-) | 11.122<br>(-)   | 1,943,050<br>(-) |



|                   | 買 付 額         |                  | 売 付 額         |                  |
|-------------------|---------------|------------------|---------------|------------------|
|                   | □ 数           | 金 額              | □ 数           | 金 額              |
|                   | 千□            | 千円               | 千□            | 千円               |
| 森トラスト総合リート投資法人    | 2.99<br>(-)   | 498,302<br>(-)   | 3.606<br>(-)  | 595,059<br>(-)   |
| インヴィンシブル投資法人      | 17.323<br>(-) | 862,032<br>(-)   | 17.286<br>(-) | 849,994<br>(-)   |
| フロンティア不動産投資法人     | 1.42<br>(-)   | 636,625<br>(-)   | 1.713<br>(-)  | 765,194<br>(-)   |
| 平和不動産リート投資法人      | 2.606<br>(-)  | 307,549<br>(-)   | 3.142<br>(-)  | 369,026<br>(-)   |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 2.745<br>(-)  | 629,236<br>(-)   | 3.362<br>(-)  | 765,770<br>(-)   |
| 福岡リート投資法人         | 2.161<br>(-)  | 370,629<br>(-)   | 2.606<br>(-)  | 444,427<br>(-)   |
| ケネディクス・オフィス投資法人   | 1.291<br>(-)  | 933,876<br>(-)   | 1.554<br>(-)  | 1,129,668<br>(-) |
| いちごオフィスリート投資法人    | 3.626<br>(-)  | 349,372<br>(-)   | 4.105<br>(-)  | 395,886<br>(-)   |
| 大和証券オフィス投資法人      | 1.017<br>(-)  | 730,364<br>(-)   | 1.151<br>(-)  | 823,307<br>(-)   |
| 阪急阪神リート投資法人       | 1.946<br>(-)  | 280,257<br>(-)   | 2.276<br>(-)  | 325,626<br>(-)   |
| スターツプロシード投資法人     | 0.655<br>(-)  | 112,392<br>(-)   | 0.797<br>(-)  | 136,046<br>(-)   |
| 大和ハウスリート投資法人      | 5.795<br>(-)  | 1,478,853<br>(-) | 6.193<br>(-)  | 1,574,835<br>(-) |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 13.868<br>(-) | 1,152,299<br>(-) | 15.226<br>(-) | 1,265,659<br>(-) |
| 日本賃貸住宅投資法人        | 4.705<br>(-)  | 410,819<br>(-)   | 5.674<br>(-)  | 497,080<br>(-)   |
| ジャパンエクセレント投資法人    | 3.746<br>(-)  | 572,105<br>(-)   | 4.518<br>(-)  | 688,913<br>(-)   |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## (2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別          | 買 建   |       | 売 建   |       |
|----------------|-------|-------|-------|-------|
|                | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
|                | 百万円   | 百万円   | 百万円   | 百万円   |
| 国内 不動産投信指数先物取引 | 1,874 | 1,893 | -     | -     |

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2018年6月7日から2019年6月6日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期<br>区 分 | 当             |                    |          | 期             |                    |          |
|--------------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
|              | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 投 資 証 券      | 百万円<br>38,981 | 百万円<br>567         | %<br>1.5 | 百万円<br>44,355 | 百万円<br>500         | %<br>1.1 |

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類     | 当 | 期            |
|---------|---|--------------|
|         | 買 | 付 額          |
| 投 資 証 券 |   | 百万円<br>1,690 |

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目                         | 当 | 期     |
|-----------------------------|---|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)       |   | 743千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) |   | 8千円   |
| (B) / (A)                   |   | 1.1%  |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

## ■組入資産の明細

### (1) 国内投資証券

| 銘                       | 柄 | 期首(前期末)  |        | 当 期       |       | 末   |     |
|-------------------------|---|----------|--------|-----------|-------|-----|-----|
|                         |   | □ 数      | □ 数    | □ 数       | 評 価 額 | 比 率 | 率   |
| <b>不動産ファンド</b>          |   | 千□       | 千□     | 千円        |       |     | %   |
| エスコンジャパンリート投資法人         |   | －        | 0.348  | 36,226    |       |     | 0.1 |
| サンケイリアルエステート投資法人        |   | －        | 0.335  | 36,850    |       |     | 0.1 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人      |   | 1.414    | 1.127  | 652,533   |       |     | 2.0 |
| MCUBS MidCity投資法人       |   | 4.747    | 3.823  | 396,827   |       |     | 1.2 |
| 森ヒルズリート投資法人             |   | 4.57     | 3.891  | 589,875   |       |     | 1.8 |
| 産業ファンド投資法人              |   | 4.941    | 4.164  | 537,156   |       |     | 1.6 |
| アドバンス・レジデンス投資法人         |   | 3.939    | 3.307  | 1,035,091 |       |     | 3.1 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 |   | 2.164    | 2.097  | 379,557   |       |     | 1.1 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人      |   | 1.925    | 1.782  | 840,213   |       |     | 2.5 |
| GLP投資法人                 |   | 8.832    | 8.407  | 991,185   |       |     | 3.0 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人      |   | 1.613    | 1.407  | 415,065   |       |     | 1.3 |
| 日本プロロジスリート投資法人          |   | 5.67     | 4.551  | 1,048,095 |       |     | 3.2 |
| 星野リゾート・リート投資法人          |   | 0.672    | 0.516  | 278,124   |       |     | 0.8 |
| Oneリート投資法人              |   | 0.465    | 0.494  | 136,986   |       |     | 0.4 |
| イオンリート投資法人              |   | 4.04     | 3.483  | 465,328   |       |     | 1.4 |
| ヒューリックリート投資法人           |   | 2.889    | 2.743  | 497,305   |       |     | 1.5 |
| 日本リート投資法人               |   | 1.143    | 1.095  | 459,900   |       |     | 1.4 |
| インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人   |   | 25.067   | 20.679 | 360,848   |       |     | 1.1 |
| 日本ヘルスケア投資法人             |   | 0.206    | 0.155  | 26,892    |       |     | 0.1 |
| 積水ハウス・リート投資法人           |   | 10.65905 | 8.754  | 682,812   |       |     | 2.1 |
| トーセイ・リート投資法人            |   | 0.684    | 0.653  | 76,139    |       |     | 0.2 |
| ケネディクス商業リート投資法人         |   | 1.547    | 1.244  | 333,018   |       |     | 1.0 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人         |   | 0.524    | 0.711  | 84,466    |       |     | 0.3 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人        |   | 0.739    | 0.679  | 72,381    |       |     | 0.2 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人       |   | 12.59    | 10.557 | 1,755,629 |       |     | 5.3 |
| いちごホテルリート投資法人           |   | 0.666    | 0.593  | 73,354    |       |     | 0.2 |
| ラサールロジポート投資法人           |   | 3.209    | 2.803  | 346,170   |       |     | 1.0 |
| スターアジア不動産投資法人           |   | 0.998    | 1.053  | 120,042   |       |     | 0.4 |
| マリモ地方創生リート投資法人          |   | 0.341    | 0.292  | 34,718    |       |     | 0.1 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人     |   | 0.805    | 0.823  | 285,581   |       |     | 0.9 |
| 大江戸温泉リート投資法人            |   | 0.714    | 0.548  | 45,812    |       |     | 0.1 |
| さくら総合リート投資法人            |   | 1.023    | 0.734  | 67,601    |       |     | 0.2 |
| 投資法人みらい                 |   | 0.621    | 3.655  | 179,460   |       |     | 0.5 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人        |   | 0.921    | 0.796  | 110,962   |       |     | 0.3 |
| 三菱地所物流リート投資法人           |   | 0.394    | 0.359  | 97,109    |       |     | 0.3 |
| CREロジスティクスファンド投資法人      |   | 0.426    | 0.34   | 40,052    |       |     | 0.1 |

| 銘                    | 柄             | 期首(前期末) 当 期 末  |                |            |      |
|----------------------|---------------|----------------|----------------|------------|------|
|                      |               | □ 数            | □ 数            | 評 価 額      | 比 率  |
| <b>不動産ファンド</b>       |               | 千□             | 千□             | 千円         | %    |
| ザイマックス・リート投資法人       |               | 0.392          | 0.313          | 38,655     | 0.1  |
| タカラレーベン不動産投資法人       |               | —              | 0.508          | 48,971     | 0.1  |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 |               | —              | 0.525          | 52,920     | 0.2  |
| 日本ビルファンド投資法人         |               | 4.12           | 3.286          | 2,474,358  | 7.5  |
| ジャパンリアルエステイト投資法人     |               | 4.233          | 3.393          | 2,225,808  | 6.7  |
| 日本リテールファンド投資法人       |               | 8.033          | 6.412          | 1,391,404  | 4.2  |
| オリックス不動産投資法人         |               | 8.441          | 6.76           | 1,320,904  | 4.0  |
| 日本プライムリアルティ投資法人      |               | 2.686          | 2.148          | 997,746    | 3.0  |
| プレミア投資法人             |               | 3.843          | 3.226          | 440,349    | 1.3  |
| 東急リアル・エステート投資法人      |               | 2.852          | 2.275          | 415,642    | 1.3  |
| グローバル・ワン不動産投資法人      |               | 2.702          | 2.347          | 305,110    | 0.9  |
| ユナイテッド・アーバン投資法人      |               | 9.383          | 7.483          | 1,325,239  | 4.0  |
| 森トラスト総合リート投資法人       |               | 3.041          | 2.425          | 421,950    | 1.3  |
| インヴィンシブル投資法人         |               | 11.668         | 11.705         | 685,913    | 2.1  |
| フロンティア不動産投資法人        |               | 1.447          | 1.154          | 537,764    | 1.6  |
| 平和不動産リート投資法人         |               | 2.649          | 2.113          | 263,068    | 0.8  |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人    |               | 2.834          | 2.217          | 542,499    | 1.6  |
| 福岡リート投資法人            |               | 2.2            | 1.755          | 303,439    | 0.9  |
| ケネディクス・オフィス投資法人      |               | 1.313          | 1.05           | 782,250    | 2.4  |
| いちごオフィスリート投資法人       |               | 3.294          | 2.815          | 284,033    | 0.9  |
| 大和証券オフィス投資法人         |               | 0.917          | 0.783          | 585,684    | 1.8  |
| 阪急阪神リート投資法人          |               | 1.857          | 1.527          | 224,621    | 0.7  |
| スターツプロシード投資法人        |               | 0.67           | 0.528          | 91,291     | 0.3  |
| 大和ハウスリート投資法人         |               | 4.95           | 4.552          | 1,167,588  | 3.5  |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人     |               | 12.279         | 10.921         | 954,495    | 2.9  |
| 日本賃貸住宅投資法人           |               | 4.785          | 3.816          | 321,307    | 1.0  |
| ジャパンエクセレント投資法人       |               | 3.81           | 3.038          | 483,649    | 1.5  |
| 合 計                  | □ 数 ・ 金 額     | 215.55705      | 188.073        | 32,276,037 | —    |
|                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 59銘柄 < 97.8% > | 63銘柄 < 97.4% > | —          | 97.4 |

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注2) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注3) MCUBS MidCity投資法人、インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、ラサールロジポート投資法人、福岡リート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、いちごオフィスリート投資法人、いちごホテルリート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人、平和不動産リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、投資法人みらい、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、Oneリート投資法人につきましては、委託会社の利害関係人(みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券、みずほリートマネジメント)が運用会社または一般事務受託会社となっています。(当該投資法人の直近の資産運用報告書より記載)

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 |             | 当 期        |       | 末        |
|-----|-------------|------------|-------|----------|
|     |             | 買 建 額      | 売 建 額 | 額        |
| 国内  | 東 証 R E I T | 百万円<br>671 |       | 百万円<br>- |

## ■投資信託財産の構成

2019年6月6日現在

| 項 目                     | 当 期              |     | 末         |
|-------------------------|------------------|-----|-----------|
|                         | 評 価 額            | 比 率 |           |
| 投 資 証 券                 | 千円<br>32,276,037 |     | %<br>89.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 3,773,644        |     | 10.5      |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 36,049,681       |     | 100.0     |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年6月6日)現在

| 項 目                         | 当 期 末                  |
|-----------------------------|------------------------|
| <b>(A) 資 産</b>              | <b>36,049,681,856円</b> |
| コ ー ル ・ 口 ー ン 等             | 2,402,172,999          |
| 投 資 証 券(評価額)                | 32,276,037,250         |
| 未 収 入 金                     | 1,176,594,192          |
| 未 収 配 当 金                   | 205,231,915            |
| 差 入 委 託 証 拠 金               | △10,354,500            |
| <b>(B) 負 債</b>              | <b>2,895,673,600</b>   |
| 未 払 金                       | 1,697,639,600          |
| 未 払 解 約 金                   | 1,198,034,000          |
| <b>(C) 純 資 産 総 額(A - B)</b> | <b>33,154,008,256</b>  |
| 元 本                         | 15,925,100,033         |
| 次 期 繰 越 損 益 金               | 17,228,908,223         |
| <b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>      | <b>15,925,100,033口</b> |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)    | 20,819円                |

(注1) 期首元本額 19,505,563,952円  
 追加設定元本額 21,469,701,210円  
 一部解約元本額 25,050,165,129円

(注2) 期末における元本の内訳

|                                 |                |
|---------------------------------|----------------|
| M I T O ラップ型ファンド (安定型)          | 398,750円       |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型)          | 989,759円       |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型)          | 1,626,471円     |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)           | 3,677,841円     |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)           | 2,590,882円     |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)           | 1,933,107円     |
| たわらノーロード 国内リート                  | 2,507,699,434円 |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>           | 623,786,868円   |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)          | 190,244,865円   |
| たわらノーロード バランス (堅実型)             | 2,593,857円     |
| たわらノーロード バランス (標準型)             | 51,331,561円    |
| たわらノーロード バランス (積極型)             | 62,512,810円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)    | 19,941,955円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)  | 64,317,037円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)    | 41,446,372円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)    | 94,016,367円    |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)          | 759,631円       |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)        | 1,838,794円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)          | 1,187,199円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)          | 2,990,117円     |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)           | 11,988,138円    |
| マネックス資産設計ファンド (育成型)             | 327,794,537円   |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション          | 3,869,053円     |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) | 110,530,283円   |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) | 101,236,265円   |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) | 198,350,779円   |
| 投資のソムリエ                         | 2,675,884,350円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>                   | 274,057,268円   |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>      | 85,884,495円    |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型             | 115,327,181円   |
| ダイナミック・ナビゲーション                  | 415,557円       |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド              | 1,642,988,733円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)         | 1,216,024円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)         | 1,044,635円     |

|   |                 |
|---|-----------------|
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)                           | 859,105円        |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)                           | 1,759,124円      |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                               | 259,998,854円    |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                              | 9,352,299円      |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)                           | 243,859円        |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)                           | 243,859円        |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)                           | 243,859円        |
| Jリートインデックスファンド (DC)                               | 13,039,056円     |
| D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定) |                 |
|   | 88,900,881円     |
| D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定) |                 |
|   | 803,441,710円    |
| D I A M J - R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け)         |                 |
|   | 4,507,558,117円  |
| 日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)      |                 |
|   | 261,962,505円    |
| D I A Mグローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け)                   | 15,360,153円     |
| D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)      |                 |
|   | 735,665,677円    |
| 期末元本合計  | 15,925,100,033円 |

## ■損益の状況

当期 自2018年6月7日 至2019年6月6日

| 項   | 目              | 当               | 期 |
|-----|----------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益          | 1,341,887,419   | 円 |
|     | 受取配当金          | 1,342,747,089   |   |
|     | その他の収益         | 148             |   |
|     | 支払利息           | △859,818        |   |
| (B) | 有価証券売買損益       | 2,969,521,242   |   |
|     | 売買益            | 3,330,702,386   |   |
|     | 売買損            | △361,181,144    |   |
| (C) | 先物取引等取引損益      | 87,382,152      |   |
|     | 取引益            | 87,382,152      |   |
| (D) | その他費用          | △922            |   |
| (E) | 当期損益金(A+B+C+D) | 4,398,789,891   |   |
| (F) | 前期繰越損益金        | 15,957,115,897  |   |
| (G) | 解約差損益金         | △23,507,060,955 |   |
| (H) | 追加信託差損益金       | 20,380,063,390  |   |
| (I) | 計(E+F+G+H)     | 17,228,908,223  |   |
|     | 次期繰越損益金(I)     | 17,228,908,223  |   |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

# 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第12期（決算日 2019年6月24日）

（対象期間 2018年6月23日～2019年6月24日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第12期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。

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 2007年4月11日から無期限です。  |
| 運用方針   | S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。                                       |
| 主な組入制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>株式への直接投資は行いません。  |

## ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |      | S & P 先進国 REIT インデックス<br>（除く日本、円換算ベース、<br>配当込み、為替ヘッジなし）<br>（ベンチマーク） |      | 投資信託<br>受益証券、<br>投資証券<br>組入比率 | 純資産額<br>総     |
|-----------------|--------|------|---|------|-------------------------------|---------------|
|                 | 円      | 騰落率  | ポイント  | 騰落率  |                               |               |
| 8期(2015年6月22日)  | 11,550 | 27.0 | 113,473.63  | 27.7 | 99.5                          | 百万円<br>26,943 |
| 9期(2016年6月22日)  | 10,906 | △5.6 | 108,051.29  | △4.8 | 99.6                          | 32,918        |
| 10期(2017年6月22日) | 11,770 | 7.9  | 117,262.55  | 8.5  | 99.7                          | 43,023        |
| 11期(2018年6月22日) | 11,979 | 1.8  | 120,101.82  | 2.4  | 99.3                          | 53,148        |
| 12期(2019年6月24日) | 13,060 | 9.0  | 131,885.51  | 9.8  | 99.2                          | 47,410        |

（注1）ベンチマークはS & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注2）S & P 先進国 REIT インデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスズLLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S & P、それらの各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、これらのいずれの関係者も、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 インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

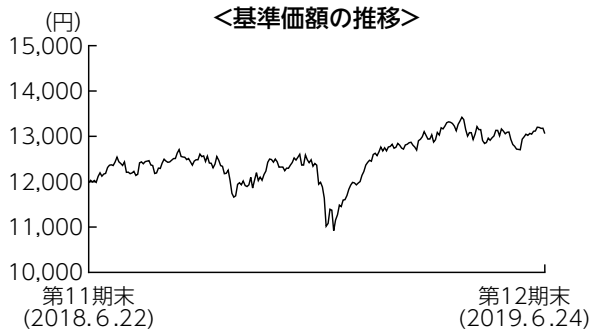


## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                    | 基 準 価 額 |        | S & P 先進国 REIT<br>インデックス<br>(除く日本、円換算ベース、<br>配当込み、為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) | 期 騰 落 中<br>騰 落 率 | 投 資 信 託<br>受 益 証 券、<br>投 資 証 券<br>組 入 比 率 |
|--------------------------|---------|--------|--|------------------|---|
|                          | 円       | 騰 落 率  |  |                  |   |
| (期 首)<br>2018 年 6 月 22 日 | 11,979  | %<br>- | ポイント<br>120,101.82   | %<br>-           | %<br>99.3                                 |
| 6 月 末                    | 12,118  | 1.2    | 121,653.84   | 1.3              | 99.2                                      |
| 7 月 末                    | 12,163  | 1.5    | 122,169.90   | 1.7              | 99.5                                      |
| 8 月 末                    | 12,556  | 4.8    | 126,198.03   | 5.1              | 98.8                                      |
| 9 月 末                    | 12,385  | 3.4    | 124,660.21   | 3.8              | 99.3                                      |
| 10 月 末                   | 12,199  | 1.8    | 122,854.06   | 2.3              | 99.2                                      |
| 11 月 末                   | 12,478  | 4.2    | 125,696.31   | 4.7              | 99.4                                      |
| 12 月 末                   | 11,371  | △5.1   | 114,497.86   | △4.7             | 95.2                                      |
| 2019 年 1 月 末             | 12,425  | 3.7    | 125,279.31   | 4.3              | 99.5                                      |
| 2 月 末                    | 12,719  | 6.2    | 128,472.03   | 7.0              | 99.5                                      |
| 3 月 末                    | 13,189  | 10.1   | 133,215.20   | 10.9             | 99.0                                      |
| 4 月 末                    | 13,149  | 9.8    | 132,848.94   | 10.6             | 99.6                                      |
| 5 月 末                    | 12,780  | 6.7    | 129,142.44   | 7.5              | 99.6                                      |
| (期 末)<br>2019 年 6 月 24 日 | 13,060  | 9.0    | 131,885.51   | 9.8              | 99.2                                      |

(注) 騰落率は期首比です。

## ■当期の運用経過（2018年6月23日から2019年6月24日まで）

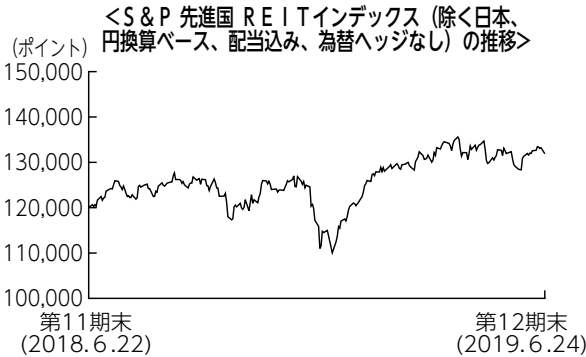


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は13,060円となり、前期末に比べ9.0%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

当ファンドで組入れている全ての通貨に対して円高となったことはマイナスに寄与したものの、世界的に金利の低下観測が広がった結果、米国やオーストラリアなど多くのリート市場が上昇し、基準価額は上昇しました。



### 投資環境

米国リート市場は、米中通商問題の深刻化や米国長期金利の上昇局面には下落する場面もありましたが、期を通じては長期金利の低下傾向やF R B（米連邦準備理事会）の金融引き締め姿勢からの転換を背景に上昇しました。欧州リート市場では、政治的な不透明感が高まったフランスや英国などが下落しました。オーストラリアリート市場は、オーストラリア長期金利の低下基調を背景に力強く上昇しました。

為替市場では、2018年の年末にかけて、米中通商問題や世界経済の減速懸念などから安全資産とされる

円が買われ、円高が進む展開となりました。2019年1月に米中通商問題の進展期待などから米ドルが買われ、米ドル高円安方向へと反転したものの、4月後半以降は米国の金利低下観測などから米ドル安円高となりました。ユーロは欧州経済の減速や、イタリアの財政悪化に対する懸念などから弱含む展開となり、ユーロ安円高となりました。豪ドルに対しても円高が進みました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークであるS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致させたポートフォリオを構築しました。

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で9.8%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8%下回りました。ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

### 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目         | 当 期  |         |
|-------------|------|---------|
|             | 金 額  | 比 率     |
| (a) 売買委託手数料 | 3円   | 0.025%  |
| (株 式)       | ( 0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券)  | ( 1) | (0.004) |
| (投 資 証 券)   | ( 3) | (0.020) |
| (b) 有価証券取引税 | 7    | 0.059   |
| (株 式)       | ( 0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券)  | ( 0) | (0.003) |
| (投 資 証 券)   | ( 7) | (0.056) |
| (c) その他費用   | 13   | 0.108   |
| (保 管 費 用)   | ( 7) | (0.055) |
| (そ の 他)     | ( 7) | (0.052) |
| 合 計         | 24   | 0.191   |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(12,500円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については13ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (2018年6月23日から2019年6月24日まで)

### (1) 株 式

|    |         | 買 付      |          | 売 付    |          |
|----|---------|----------|----------|--------|----------|
|    |         | 株 数      | 金 額      | 株 数    | 金 額      |
| 外国 |         | 百株       | 千アメリカ・ドル | 百株     | 千アメリカ・ドル |
|    | ア メ リ カ | (939.19) | (1,331)  | 939.19 | 1,846    |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、増資割当、株式転換・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。

### (2) 投資信託受益証券、投資証券

|                              | 買 付      |          | 売 付     |          |
|------------------------------|----------|----------|---------|----------|
|                              | □ 数      | 金 額      | □ 数     | 金 額      |
| アメリカ                         | 千□       | 千アメリカ・ドル | 千□      | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 51.516   | 6,602    | 54.92   | 7,017    |
|                              | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| ALEXANDER'S INC.             | 1.909    | 644      | 2.109   | 721      |
|                              | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 69.446   | 8,705    | 79.741  | 9,892    |
|                              | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| CEDAR REALTY TRUST INC       | 28.857   | 111      | 34.991  | 131      |
|                              | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC    | 94.892   | 3,345    | 106.311 | 3,648    |
|                              | (2.152)  | (73)     | (-)     | (-)      |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A   | 73.746   | 3,391    | 86.508  | 3,935    |
|                              | (△1.902) | (-)      | (-)     | (-)      |
| AGREE REALTY CORP            | 15.822   | 958      | 15.848  | 934      |
|                              | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| BRT APARTMENTS CORP          | 6.485    | 75       | 3.672   | 43       |
|                              | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| SL GREEN                     | 38.987   | 3,601    | 46.27   | 4,211    |
|                              | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |

|                                | 買 付 額                |                 | 売 付 額          |               |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------|---------------|
|                                | □ 数                  | 金 額             | □ 数            | 金 額           |
| <b>アメリカ</b>                    | 千□                   | 千アメリカ・ドル        | 千□             | 千アメリカ・ドル      |
| EPR PROPERTIES                 | 36.696<br>(-)        | 2,589<br>(-)    | 37.75<br>(-)   | 2,650<br>(-)  |
| PROLOGIS INC                   | 270.614<br>(38.097)  | 18,158<br>(-)   | 312.238<br>(-) | 20,970<br>(-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC      | 62.176<br>(-)        | 11,494<br>(-)   | 71.282<br>(-)  | 13,104<br>(-) |
| LEXINGTON REALTY TRUST         | 90.68<br>(-)         | 789<br>(-)      | 105.782<br>(-) | 901<br>(-)    |
| CAMDEN PROPERTY TRUST          | 43.075<br>(-)        | 4,047<br>(-)    | 47.892<br>(-)  | 4,480<br>(-)  |
| CBL & ASSOCIATES               | 85.442<br>(-)        | 213<br>(-)      | 110.449<br>(-) | 266<br>(-)    |
| MACK CALI                      | 43.703<br>(-)        | 916<br>(-)      | 50.278<br>(-)  | 1,058<br>(-)  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 72.133<br>(-)        | 3,530<br>(-)    | 80.15<br>(-)   | 3,844<br>(-)  |
| COUSINS PROPERTIES INC         | 192.222<br>(△95.762) | 1,693<br>(-)    | 222.783<br>(-) | 1,959<br>(-)  |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES       | 20.928<br>(△33.49)   | 710<br>(-)      | 33.896<br>(-)  | 1,130<br>(-)  |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES      | 10.337<br>(-)        | 217<br>(-)      | 11.376<br>(-)  | 238<br>(-)    |
| SITE CENTERS CORP              | 62.071<br>(-)        | 804<br>(-)      | 76.856<br>(-)  | 999<br>(-)    |
| ISTAR INC                      | 1.455<br>(-)         | 15<br>(-)       | 29.85<br>(-)   | 333<br>(-)    |
| DUKE REALTY TRUST              | 162.249<br>(-)       | 4,622<br>(-)    | 185.327<br>(-) | 5,270<br>(-)  |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST      | 15.635<br>(-)        | 85<br>(-)       | 29.663<br>(-)  | 177<br>(-)    |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC       | 29.876<br>(-)        | 7,700<br>(-)    | 34.406<br>(-)  | 8,829<br>(-)  |
| EQUITY RESIDENTIAL             | 165.741<br>(-)       | 11,471<br>(-)   | 190.111<br>(-) | 13,025<br>(-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST      | 33.211<br>(-)        | 4,234<br>(-)    | 37.721<br>(-)  | 4,748<br>(-)  |
| FIRST INDUSTRIAL RT            | 57.032<br>(-)        | 1,828<br>(-)    | 65.302<br>(-)  | 2,086<br>(-)  |
| GGP INC                        | 29.411<br>(-)        | 616<br>(△1,331) | 296.261<br>(-) | 1,052<br>(-)  |
| HCP INC                        | 216.819<br>(-)       | 6,247<br>(-)    | 245.408<br>(-) | 6,834<br>(-)  |
| EQUITY COMMONWEALTH            | 54.381<br>(-)        | 1,702<br>(-)    | 62.791<br>(-)  | 1,938<br>(-)  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC    | 55.449<br>(-)        | 1,677<br>(-)    | 64.426<br>(-)  | 1,897<br>(-)  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC       | 49.393<br>(-)        | 2,198<br>(-)    | 56.792<br>(-)  | 2,548<br>(-)  |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST   | 70.873<br>(-)        | 1,886<br>(-)    | 82.804<br>(-)  | 2,191<br>(-)  |
| WELLTOWER INC                  | 172.408<br>(-)       | 12,327<br>(-)   | 192.047<br>(-) | 13,223<br>(-) |
| EAST GROUP                     | 16.855<br>(-)        | 1,691<br>(-)    | 18.78<br>(-)   | 1,871<br>(-)  |
| KIMCO REALTY                   | 194.856<br>(-)       | 3,226<br>(-)    | 225.334<br>(-) | 3,685<br>(-)  |

|                             | 買 付 額     |          | 売 付 額   |          |
|-----------------------------|-----------|----------|---------|----------|
|                             | □ 数       | 金 額      | □ 数     | 金 額      |
| アメリカ                        | 千□        | 千アメリカ・ドル | 千□      | 千アメリカ・ドル |
| KILROY REALTY CORP          | 46.475    | 3,288    | 52.409  | 3,726    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| LTC PROPERTIES INC          | 18.779    | 833      | 21.004  | 924      |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| SENIOR HOUSING PPTYS TRUST  | 101.848   | 1,394    | 119.626 | 1,621    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 38.01     | 555      | 36.722  | 546      |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| LIBERTY PROPERTY TRUST      | 68.047    | 3,035    | 78.212  | 3,451    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| BRANDYWINE REALTY TRUST     | 77.488    | 1,146    | 89.924  | 1,334    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| IRON MOUNTAIN INC           | 129.031   | 4,352    | 146.371 | 4,796    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| THE MACERICH COMPANY        | 49.035    | 2,362    | 57.847  | 2,788    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 40.885    | 4,165    | 46.185  | 4,651    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| ACADIA REALTY TRUST         | 34.42     | 950      | 40.229  | 1,106    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| HOST HOTELS & RESORTS INC   | 339.44    | 6,423    | 389.543 | 7,504    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| MID AMERICA                 | 51.864    | 5,292    | 59.502  | 6,047    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST    | 11.412    | 202      | 13.291  | 254      |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| NATIONAL HEALTH INVS INC    | 19.319    | 1,500    | 21.953  | 1,651    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 18.845    | 234      | 30.513  | 257      |
|                             | (△33.797) | (-)      | (-)     | (-)      |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC  | 5.087     | 135      | 7.385   | 195      |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 32.609    | 273      | 44.52   | 363      |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| GETTY REALTY CORP           | 14.456    | 425      | 15.166  | 445      |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| PS BUSINESS PARKS           | 8.613     | 1,201    | 10.055  | 1,372    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| RPT REALTY                  | 34.058    | 446      | 40.201  | 524      |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| REALTY INCOME CORP          | 135.852   | 8,640    | 147.998 | 9,179    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| REGENCY CENTERS CORP        | 83.618    | 5,314    | 86.319  | 5,453    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| UDR INC                     | 126.173   | 5,190    | 141.55  | 5,776    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 41.911    | 1,109    | 46.256  | 1,253    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| CORECIVIC INC               | 47.876    | 1,033    | 56.529  | 1,230    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| SAUL CENTERS INC            | 5.197     | 272      | 5.818   | 310      |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| SIMON PROPERTY GROUP INC    | 138.155   | 24,451   | 160.362 | 28,042   |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |
| LIFE STORAGE INC            | 19.507    | 1,864    | 22.845  | 2,155    |
|                             | (-)       | (-)      | (-)     | (-)      |

|                                     | 買 付 額             |               | 売 付 額          |               |
|-------------------------------------|-------------------|---------------|----------------|---------------|
|                                     | □ 数               | 金 額           | □ 数            | 金 額           |
| <b>アメリカ</b>                         | 千□                | 千アメリカ・ドル      | 千□             | 千アメリカ・ドル      |
| PUBLIC STORAGE                      | 67.783<br>(-)     | 14,402<br>(-) | 78.32<br>(-)   | 16,545<br>(-) |
| SUN COMMUNITIES INC                 | 41.357<br>(-)     | 4,411<br>(-)  | 44.529<br>(-)  | 4,721<br>(-)  |
| TAUBMAN CENTERS INC                 | 27.742<br>(-)     | 1,457<br>(-)  | 32.194<br>(-)  | 1,694<br>(-)  |
| TANGER FACTORY OUTLET               | 39.061<br>(-)     | 847<br>(-)    | 46.467<br>(-)  | 992<br>(-)    |
| UMH PROPERTIES INC                  | 12.627<br>(-)     | 168<br>(-)    | 14.076<br>(-)  | 193<br>(-)    |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP           | 9.842<br>(-)      | 195<br>(-)    | 11.279<br>(-)  | 218<br>(-)    |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME        | 4.471<br>(-)      | 312<br>(-)    | 5.022<br>(-)   | 360<br>(-)    |
| VENTAS INC                          | 160.455<br>(-)    | 9,696<br>(-)  | 184.264<br>(-) | 10,839<br>(-) |
| VORNADO REALTY TRUST                | 79.398<br>(-)     | 5,462<br>(-)  | 91.041<br>(-)  | 6,222<br>(-)  |
| WASHINGTON REIT                     | 34.047<br>(-)     | 919<br>(-)    | 39.493<br>(-)  | 1,099<br>(-)  |
| GEO GROUP INC                       | 55.736<br>(-)     | 1,262<br>(-)  | 65.134<br>(-)  | 1,472<br>(-)  |
| WEINGARTEN REALTY INVST             | 53.776<br>(-)     | 1,539<br>(-)  | 62.494<br>(-)  | 1,781<br>(-)  |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES         | 60.197<br>(-)     | 2,596<br>(-)  | 68.994<br>(-)  | 2,953<br>(-)  |
| KITE REALTY GROUP TRUST             | 36.187<br>(-)     | 580<br>(-)    | 40.688<br>(-)  | 645<br>(-)    |
| EXTRA SPACE STORAGE INC             | 56.934<br>(-)     | 5,390<br>(-)  | 65.076<br>(-)  | 6,129<br>(-)  |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C        | 32.657<br>(-)     | 238<br>(-)    | 36.853<br>(-)  | 277<br>(-)    |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC        | 92.764<br>(-)     | 1,363<br>(-)  | 108.365<br>(-) | 1,607<br>(-)  |
| CUBESMART                           | 83.044<br>(-)     | 2,522<br>(-)  | 93.599<br>(-)  | 2,820<br>(-)  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC            | 91.946<br>(-)     | 10,374<br>(-) | 105.056<br>(-) | 11,808<br>(-) |
| EDUCATION REALTY TRUST INC          | 7.995<br>(-)      | 331<br>(-)    | 40.156<br>(-)  | 1,665<br>(-)  |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO          | 92.217<br>(-)     | 970<br>(-)    | 103.416<br>(-) | 1,104<br>(-)  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST            | 163.601<br>(-)    | 2,711<br>(-)  | 181.805<br>(-) | 2,889<br>(-)  |
| DOUGLAS EMMETT INC                  | 72.261<br>(-)     | 2,707<br>(-)  | 81.928<br>(-)  | 3,092<br>(-)  |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC            | 3.449<br>(△37.35) | 227<br>(-)    | 5.841<br>(-)   | 386<br>(-)    |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 48.701<br>(-)     | 862<br>(-)    | 54.561<br>(-)  | 967<br>(-)    |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC    | 54.775<br>(-)     | 1,047<br>(-)  | 65.251<br>(-)  | 1,246<br>(-)  |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC         | 45.395<br>(-)     | 526<br>(-)    | 50.84<br>(-)   | 611<br>(-)    |
| TERRENO REALTY CORP                 | 26.463<br>(-)     | 1,042<br>(-)  | 28.614<br>(-)  | 1,112<br>(-)  |

|                                     | 買 付 額                 |               | 売 付 額          |              |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------|----------------|--------------|
|                                     | □ 数                   | 金 額           | □ 数            | 金 額          |
| <b>アメリカ</b>                         | 千□                    | 千アメリカ・ドル      | 千□             | 千アメリカ・ドル     |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC           | 18.468<br>(-)         | 756<br>(-)    | 22.929<br>(-)  | 918<br>(-)   |
| RLJ LODGING TRUST                   | 69.766<br>(-)         | 1,344<br>(-)  | 82.493<br>(-)  | 1,603<br>(-) |
| AMERICOLD REALTY TRUST              | 87.163<br>(-)         | 2,590<br>(-)  | 42.141<br>(-)  | 1,190<br>(-) |
| CORESITE REALTY CORP                | 16.562<br>(-)         | 1,712<br>(-)  | 18.189<br>(-)  | 1,878<br>(-) |
| VEREIT INC                          | 433.716<br>(-)        | 3,384<br>(-)  | 499.279<br>(-) | 3,806<br>(-) |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST            | 27.449<br>(-)         | 800<br>(-)    | 31.85<br>(-)   | 941<br>(-)   |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST             | 35.91<br>(30.81)      | 1,132<br>(-)  | 50.164<br>(-)  | 1,641<br>(-) |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST      | 25.099<br>(△14.934)   | 435<br>(275)  | 34.446<br>(-)  | 460<br>(-)   |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 19.218<br>(-)         | 315<br>(-)    | 18.992<br>(-)  | 308<br>(-)   |
| CHATHAM LODGING TRUST               | 18.943<br>(-)         | 379<br>(-)    | 21.062<br>(-)  | 421<br>(-)   |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC          | 76.051<br>(-)         | 1,533<br>(-)  | 89.1<br>(-)    | 1,790<br>(-) |
| WHITESTONE REIT                     | 11.785<br>(-)         | 159<br>(-)    | 14.266<br>(-)  | 187<br>(-)   |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC       | 67.412<br>(-)         | 2,143<br>(-)  | 78.979<br>(-)  | 2,526<br>(-) |
| STAG INDUSTRIAL INC                 | 49.711<br>(-)         | 1,368<br>(-)  | 46.981<br>(-)  | 1,269<br>(-) |
| SELECT INCOME REIT                  | 17.842<br>(△30.041)   | 358<br>(△275) | 15.153<br>(-)  | 303<br>(-)   |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC    | 82.921<br>(-)         | 1,006<br>(-)  | 100.523<br>(-) | 1,201<br>(-) |
| CYRUSONE INC                        | 47.651<br>(-)         | 2,745<br>(-)  | 51.267<br>(-)  | 2,962<br>(-) |
| WP CAREY INC                        | 88.533<br>(-)         | 6,276<br>(-)  | 73.747<br>(-)  | 5,184<br>(-) |
| ALEXANDER & BALDWIN INC             | 6.716<br>(-)          | 159<br>(-)    | 35.458<br>(-)  | 806<br>(-)   |
| GLADSTONE LAND CORP                 | 4.885<br>(-)          | 61<br>(-)     | 6.282<br>(-)   | 75<br>(-)    |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC     | 88.972<br>(-)         | 2,415<br>(-)  | 103.593<br>(-) | 2,774<br>(-) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES        | 23.653<br>(-)         | 1,864<br>(-)  | 27.331<br>(-)  | 2,167<br>(-) |
| WHEELER REIT INC                    | 3.005<br>(-)          | 14<br>(-)     | 5.966<br>(-)   | 23<br>(-)    |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP         | 31.774<br>(-)         | 356<br>(-)    | 13.019<br>(-)  | 132<br>(-)   |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC       | 2.17<br>(-)           | 33<br>(-)     | 21.357<br>(-)  | 310<br>(-)   |
| GRAMERCY PROPERTY TRSUT             | 10.242<br>(-)         | 280<br>(-)    | 78.4<br>(-)    | 2,154<br>(-) |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC           | 102.812<br>(△114.402) | 1,395<br>(-)  | 138.549<br>(-) | 1,607<br>(-) |
| PHYSICIANS REALTY TRUST             | 74.371<br>(-)         | 1,277<br>(-)  | 86.48<br>(-)   | 1,455<br>(-) |

|                                       | 買 付 額              |              | 売 付 額          |              |
|---------------------------------------|--------------------|--------------|----------------|--------------|
|                                       | □ 数                | 金 額          | □ 数            | 金 額          |
| <b>アメリカ</b>                           | 千□                 | 千アメリカ・ドル     | 千□             | 千アメリカ・ドル     |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC         | 46.596<br>(-)      | 1,566<br>(-) | 44.125<br>(-)  | 1,465<br>(-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT                 | 116.839<br>(-)     | 2,536<br>(-) | 134.902<br>(-) | 2,907<br>(-) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC         | 31.335<br>(-)      | 318<br>(-)   | 34.041<br>(-)  | 343<br>(-)   |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC  | 6.242<br>(-)       | 334<br>(-)   | 2.548<br>(-)   | 162<br>(-)   |
| JBG SMITH PROPERTIES                  | 51.021<br>(-)      | 1,957<br>(-) | 48.676<br>(-)  | 1,864<br>(-) |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC            | 26.656<br>(-)      | 345<br>(-)   | 6.054<br>(-)   | 61<br>(-)    |
| RETAIL VALUE INC                      | 3.809<br>(6.384)   | 117<br>(4)   | 4.277<br>(-)   | 131<br>(-)   |
| INVITATION HOMES INC                  | 155.931<br>(-)     | 3,584<br>(-) | 141.784<br>(-) | 3,172<br>(-) |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC          | 7.702<br>(△9.16)   | 72<br>(△92)  | 11.685<br>(-)  | 106<br>(-)   |
| FOREST CITY REALTY TRUST INC          | 52.941<br>(-)      | 1,308<br>(-) | 166.076<br>(-) | 4,168<br>(-) |
| QTS REALTY TRUST INC                  | 22.055<br>(-)      | 925<br>(-)   | 24.285<br>(-)  | 992<br>(-)   |
| SPIRIT MTA REIT                       | 6.315<br>(-)       | 57<br>(-)    | 9.466<br>(-)   | 85<br>(-)    |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC         | 54.236<br>(-)      | 850<br>(-)   | 61.314<br>(-)  | 959<br>(-)   |
| SAFEHOLD INC                          | 6.107<br>(-)       | 111<br>(-)   | 3.363<br>(-)   | 56<br>(-)    |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 26.062<br>(-)      | 435<br>(-)   | 8.327<br>(-)   | 158<br>(-)   |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 12.934<br>(15.095) | 255<br>(-)   | 12.233<br>(-)  | 247<br>(-)   |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC           | 43.876<br>(-)      | 946<br>(-)   | 52.732<br>(-)  | 1,136<br>(-) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC     | 90.403<br>(-)      | 3,218<br>(-) | 103.396<br>(-) | 3,681<br>(-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC            | 130.176<br>(-)     | 2,165<br>(-) | 152.641<br>(-) | 2,521<br>(-) |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC          | 8.292<br>(-)       | 82<br>(-)    | 13.258<br>(-)  | 140<br>(-)   |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC          | 49.906<br>(-)      | 993<br>(-)   | 16.528<br>(-)  | 331<br>(-)   |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC  | 3.807<br>(-)       | 39<br>(-)    | 6.214<br>(-)   | 61<br>(-)    |
| FARMLAND PARTNERS INC                 | 8.074<br>(-)       | 55<br>(-)    | 12.967<br>(-)  | 77<br>(-)    |
| CITY OFFICE REIT INC                  | 11.401<br>(-)      | 130<br>(-)   | 10.54<br>(-)   | 119<br>(-)   |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC            | 78.797<br>(-)      | 477<br>(-)   | 87.457<br>(-)  | 527<br>(-)   |
| CARETRUST REIT INC                    | 41.653<br>(-)      | 862<br>(-)   | 40.995<br>(-)  | 823<br>(-)   |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC       | 18.156<br>(-)      | 101<br>(-)   | 21.104<br>(-)  | 119<br>(-)   |
| STORE CAPITAL CORP                    | 81.675<br>(-)      | 2,488<br>(-) | 83.58<br>(-)   | 2,497<br>(-) |



|                                    | 買 付 額     |            | 売 付 額   |          |
|------------------------------------|-----------|------------|---------|----------|
|                                    | □ 数       | 金 額        | □ 数     | 金 額      |
| <b>アメリカ</b>                        | 千□        | 千アメリカ・ドル   | 千□      | 千アメリカ・ドル |
| PARAMOUNT GROUP INC                | 75.42     | 1,067      | 91.771  | 1,299    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC            | 8.43      | 81         | 9.372   | 90       |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| URBAN EDGE PROPERTIES              | 52.551    | 1,037      | 53.423  | 1,045    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| INFREIT INC                        | 12.483    | 261        | 28.615  | 602      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 29.853    | 549        | 23.175  | 419      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC         | 40.549    | 823        | 46.325  | 985      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC     | 5.796     | 212        | 5.556   | 200      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST  | 24.672    | 683        | 26.347  | 716      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC     | 4.323     | 145        | 4.537   | 141      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC         | 84.215    | 1,351      | 99.901  | 1,617    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| GLOBAL NET LEASE INC               | 35.862    | 713        | 35.307  | 692      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| TIER REIT INC                      | 21.709    | 511        | 21.964  | 525      |
|                                    | (△20.073) | (-)        | (-)     | (-)      |
| QUALITY CARE PROPERTIES INC        | -         | -          | 39.836  | 826      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| MANULIFE US REIT                   | 544.2     | 449        | 599.2   | 482      |
|                                    | (-)       | (△12)      | (-)     | (-)      |
| PARK HOTELS & RESORTS INC          | 83.394    | 2,489      | 97.853  | 2,948    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| VICI PROPERTIES INC                | 207.696   | 4,456      | 80.417  | 1,709    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP       | 15.23     | 249        | 17.937  | 273      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES         | 9.588     | 378        | 10.272  | 423      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC    | 26.462    | 714        | 27.36   | 727      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| COLONY CAPITAL INC                 | 183.257   | 1,039      | 220.405 | 1,213    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| <b>カナダ</b>                         | 千□        | 千カナダ・ドル    | 千□      | 千カナダ・ドル  |
| SMARTCENTRES REIT                  | 28.769    | 917        | 32.456  | 1,016    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| CANADIAN APT PPTYS REIT            | 31.269    | 1,458      | 34.809  | 1,608    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| MORGUARD REAL ESTATE INVNT TR      | 1.872     | 23         | 11.888  | 145      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT       | 63.055    | 1,340      | 74.795  | 1,561    |
|                                    | (-)       | (△0.00021) | (-)     | (-)      |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST    | 74.559    | 1,857      | 87.619  | 2,168    |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| ALLIED PROPERTIES REIT             | 21.435    | 964        | 22.484  | 999      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |
| COMINAR REAL ESTATE INVNT TR       | 43.668    | 520        | 51.892  | 605      |
|                                    | (-)       | (-)        | (-)     | (-)      |

|  | 買 付 額            |              | 売 付 額            |              |
|--|------------------|--------------|------------------|--------------|
|  | □ 数              | 金 額          | □ 数              | 金 額          |
| <b>カナダ</b>   | 千□               | 千カナダ・ドル      | 千□               | 千カナダ・ドル      |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST                           | 14.715<br>(-)    | 343<br>(-)   | 17.361<br>(-)    | 405<br>(-)   |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT                                     | 13.732<br>(-)    | 357<br>(-)   | 13.305<br>(-)    | 347<br>(-)   |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST                                 | 9.999<br>(-)     | 433<br>(-)   | 12.044<br>(-)    | 521<br>(-)   |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                           | 33.972<br>(-)    | 363<br>(-)   | 39.625<br>(-)    | 427<br>(-)   |
| CROMBIE REAL ESTATE INV                                      | 21.802<br>(-)    | 295<br>(-)   | 22.991<br>(-)    | 304<br>(-)   |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST                                 | 21.662<br>(-)    | 275<br>(-)   | 21.914<br>(-)    | 268<br>(-)   |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28.331<br>(-)    | 316<br>(-)   | 27.451<br>(-)    | 301<br>(-)   |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT                     | 5.315<br>(-)     | 92<br>(-)    | 6.065<br>(-)     | 101<br>(-)   |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                    | 44.11<br>(-)     | 597<br>(-)   | 48.142<br>(-)    | 656<br>(-)   |
| DREAM INDUSTRIAL REIT  | 16.637<br>(-)    | 184<br>(-)   | 8.155<br>(-)     | 86<br>(-)    |
| AGELLAN COMMERCIAL REIT                                      | 1.817<br>(-)     | 24<br>(-)    | 8.847<br>(-)     | 121<br>(-)   |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT                                | 34.28<br>(-)     | 393<br>(-)   | 32.393<br>(-)    | 371<br>(-)   |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                         | 8.269<br>(-)     | 475<br>(-)   | 9.657<br>(-)     | 541<br>(-)   |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT                                   | 17.602<br>(-)    | 116<br>(-)   | 7.137<br>(-)     | 45<br>(-)    |
| CHOICE PROPERTIES REIT                                       | 60.2<br>(-)      | 758<br>(-)   | 65.242<br>(-)    | 811<br>(-)   |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                 | 7.287<br>(-)     | 139<br>(-)   | 2.25<br>(-)      | 43<br>(-)    |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                              | 20.46<br>(-)     | 258<br>(-)   | 16.695<br>(-)    | 212<br>(-)   |
| SLATE RETAIL REIT  | -<br>(-)         | -<br>(-)     | 1.333<br>(-)     | 16<br>(-)    |
| KILLAM APARTMENT REIT  | 14.397<br>(-)    | 244<br>(-)   | 12.805<br>(-)    | 214<br>(-)   |
| <b>オーストラリア</b>   | 千□               | 千オーストラリア・ドル  | 千□               | 千オーストラリア・ドル  |
| BWP TRUST  | 242.529<br>(-)   | 854<br>(-)   | 281.491<br>(-)   | 965<br>(-)   |
| MIRVAC GROUP   | 1,707.557<br>(-) | 4,235<br>(-) | 1,871.957<br>(-) | 4,516<br>(-) |
| INVESTA OFFICE FUND  | 100.574<br>(-)   | 553<br>(-)   | 312.012<br>(-)   | 1,726<br>(-) |
| CROMWELL PROPERTY GROUP                                      | 792.327<br>(-)   | 843<br>(-)   | 858.175<br>(-)   | 919<br>(-)   |
| CHARTER HALL RETAIL REIT                                     | 194.63<br>(-)    | 859<br>(-)   | 210.659<br>(-)   | 911<br>(-)   |
| GPT GROUP  | 815.73<br>(-)    | 4,457<br>(-) | 944.51<br>(-)    | 5,031<br>(-) |
| ABACUS PROPERTY GROUP  | 121.863<br>(-)   | 423<br>(-)   | 138.637<br>(-)   | 471<br>(-)   |
| CHARTER HALL EDUCATION TRUST                                 | 70.981<br>(-)    | 233<br>(-)   | 63.558<br>(-)    | 200<br>(-)   |

|                                       | 買 付 額     |             | 売 付 額     |             |
|---------------------------------------|-----------|-------------|-----------|-------------|
|                                       | □ 数       | 金 額         | □ 数       | 金 額         |
| <b>オーストラリア</b>                        | 千□        | 千オーストラリア・ドル | 千□        | 千オーストラリア・ドル |
| STOCKLAND                             | 1,134.738 | 4,452       | 1,295.009 | 4,980       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP             | 105.055   | 316         | 110.745   | 332         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| DEXUS                                 | 474.812   | 5,255       | 520.639   | 5,654       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| GOODMAN GROUP                         | 736.22    | 8,330       | 844.47    | 9,396       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| VICINITY CENTRES                      | 1,388.558 | 3,692       | 1,620.371 | 4,201       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHARTER HALL GROUP                    | 204.429   | 1,599       | 238.778   | 1,840       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA      | 120.316   | 457         | 124.733   | 473         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA          | 357.474   | 919         | 350.961   | 875         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| ARENA REIT                            | 82.031    | 206         | 83.801    | 205         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| PROPERTYLINK GROUP                    | 85.162    | 95          | 236.384   | 273         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT           | 72.038    | 317         | 66.989    | 289         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| APN INDUSTRIA REIT                    | 10.177    | 28          | 13.842    | 35          |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| NATIONAL STORAGE REIT                 | 232.204   | 400         | 212.63    | 359         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD        | 24.928    | 83          | 35.314    | 110         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| GDI PROPERTY GROUP                    | 116.482   | 150         | 164.948   | 215         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| RURAL FUNDS GROUP                     | 132.102   | 291         | 131.091   | 286         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| SCENTRE GROUP                         | 2,387.236 | 9,609       | 2,758.491 | 10,773      |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| VIVA ENERGY REIT                      | 137.23    | 321         | 164.432   | 372         |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| <b>香港</b>                             | 千□        | 千香港・ドル      | 千□        | 千香港・ドル      |
| LINK REIT                             | 954.5     | 77,547      | 1,116.5   | 88,799      |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| PROSPERITY REIT                       | 475       | 1,505       | 535       | 1,673       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   | 647       | 3,348       | 658       | 3,335       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHAMPION REIT                         | 683       | 3,963       | 863       | 4,929       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 493       | 2,629       | 512       | 2,656       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| FORTUNE REAL ESTATE (HK)              | 467       | 4,332       | 578       | 5,320       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| SPRING REIT                           | -         | -           | 351       | 1,129       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| <b>シンガポール</b>                         | 千□        | 千シンガポール・ドル  | 千□        | 千シンガポール・ドル  |
| CAPITALAND MALL TRUST                 | 1,392.6   | 3,168       | 1,527.5   | 3,427       |
|                                       | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT             | 1,307.3   | 3,540       | 1,409.9   | 3,776       |
|                                       | (-)       | (△16)       | (-)       | (-)         |

|                                       | 買 付 額          |                   | 売 付 額          |              |
|---------------------------------------|----------------|-------------------|----------------|--------------|
|                                       | □ 数            | 金 額               | □ 数            | 金 額          |
| シンガポール                                | 千□             | 千シンガポール・ドル        | 千□             | 千シンガポール・ドル   |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST           | 1,354.3<br>(-) | 2,447<br>(-)      | 1,494.6<br>(-) | 2,659<br>(-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR          | 1,106.7<br>(-) | 2,024<br>(△12)    | 1,251.1<br>(-) | 2,259<br>(-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST             | 1,159.6<br>(-) | 1,525<br>(△5)     | 1,196.1<br>(-) | 1,556<br>(-) |
| STARHILL GLOBAL REIT                  | 446.8<br>(-)   | 312<br>(△1)       | 528.1<br>(-)   | 367<br>(-)   |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST                | 579.6<br>(-)   | 646<br>(△9)       | 688.9<br>(-)   | 755<br>(-)   |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST              | 269.8<br>(-)   | 384<br>(△6)       | 296.4<br>(-)   | 418<br>(-)   |
| KEPPEL REIT                           | 836<br>(-)     | 977<br>(-)        | 979.3<br>(-)   | 1,137<br>(-) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST             | 219.6<br>(-)   | 503<br>(-)        | 237.1<br>(-)   | 531<br>(-)   |
| ESR REIT                              | 783.4<br>(-)   | 406<br>(△0.49376) | 662.5<br>(-)   | 335<br>(-)   |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS                | 284.3<br>(-)   | 436<br>(△3)       | 341<br>(-)     | 519<br>(-)   |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST         | 258.7<br>(-)   | 369<br>(△1)       | 259.9<br>(-)   | 362<br>(-)   |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST    | 311.4<br>(-)   | 356<br>(△8)       | 349.5<br>(-)   | 385<br>(-)   |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD         | 289.4<br>(-)   | 394<br>(△0.80117) | 306.8<br>(-)   | 419<br>(-)   |
| PARKWAY LIFE REIT                     | 139.3<br>(-)   | 378<br>(△3)       | 175.4<br>(-)   | 468<br>(-)   |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST    | 721.7<br>(-)   | 170<br>(△6)       | 948.2<br>(-)   | 223<br>(-)   |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST            | 555.8<br>(-)   | 1,095<br>(△1)     | 619.1<br>(-)   | 1,209<br>(-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST            | 761.3<br>(-)   | 1,308<br>(-)      | 915.9<br>(-)   | 1,553<br>(-) |
| CACHE LOGISTICS TRUST                 | 517.2<br>(-)   | 371<br>(△0.51059) | 542.2<br>(-)   | 384<br>(-)   |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT          | 98.2<br>(-)    | 40<br>(-)         | 236.8<br>(-)   | 97<br>(-)    |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 771.3<br>(-)   | 918<br>(△11)      | 942.2<br>(-)   | 1,109<br>(-) |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST            | 278.6<br>(-)   | 230<br>(△2)       | 312.3<br>(-)   | 256<br>(-)   |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST            | 284.3<br>(-)   | 179<br>(-)        | 288.3<br>(-)   | 180<br>(-)   |
| SPH REIT                              | 254.9<br>(-)   | 257<br>(-)        | 295.4<br>(-)   | 296<br>(-)   |
| OUE HOSPITALITY TRUST                 | 382.9<br>(-)   | 268<br>(-)        | 426.2<br>(-)   | 296<br>(-)   |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT         | 172.7<br>(-)   | 104<br>(△0.09142) | 192.4<br>(-)   | 112<br>(-)   |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST             | 398.4<br>(-)   | 285<br>(△4)       | 125.4<br>(-)   | 89<br>(-)    |
| KEPPEL DC REIT                        | 408.1<br>(-)   | 577<br>(-)        | 469.3<br>(-)   | 654<br>(-)   |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST  | 820.8<br>(-)   | 886<br>(△10)      | 837.9<br>(-)   | 898<br>(-)   |

|   | 買 付 額   |              | 売 付 額     |              |
|---|---------|--------------|-----------|--------------|
|   | □ 数     | 金 額          | □ 数       | 金 額          |
| <b>ニュージーランド</b>                           | 千□      | 千ニュージーランド・ドル | 千□        | 千ニュージーランド・ドル |
| PRECINCT PROPERTIES                       | 476.379 | 706          | 519.884   | 758          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST           | 131.176 | 281          | 133.251   | 280          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| GOODMAN PROPERTY TRUST                    | 479.081 | 754          | 558.658   | 868          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD                   | 610.536 | 865          | 704.745   | 990          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| ARGOSY PROPERTY LTD                       | 279.934 | 331          | 353.982   | 415          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| INVESTORE PROPERTY LTD                    | -       | -            | 88.877    | 135          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| STRIDE STAPLED GROUP                      | 132.924 | 262          | 141.986   | 273          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| <b>イギリス</b>                               | 千□      | 千イギリス・ポンド    | 千□        | 千イギリス・ポンド    |
| BRITISH LAND CO PLC                       | 454.367 | 2,653        | 536.609   | 3,171        |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| CAPITAL & REGIONAL PLC                    | 97.167  | 33           | 191.461   | 64           |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| DERWENT LONDON PLC                        | 50.122  | 1,541        | 58.014    | 1,752        |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| BIG YELLOW GROUP PLC                      | 60.671  | 569          | 69.34     | 653          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| HAMMERSON PLC                             | 358.576 | 1,389        | 422.594   | 1,668        |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| LAND SECURITIES GROUP PLC                 | 346.004 | 2,983        | 397.676   | 3,475        |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| WORKSPACE GROUP PLC                       | 61.546  | 581          | 65.953    | 622          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| INTU PROPERTIES PLC                       | 337.034 | 468          | 413.403   | 632          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| UNITE GROUP PLC                           | 118.308 | 1,039        | 138.011   | 1,204        |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC             | 346.823 | 419          | 264.264   | 299          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| SHAFTESBURY PLC                           | 103.837 | 915          | 126.292   | 1,120        |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| SEGRO PLC                                 | 504.351 | 3,270        | 549.647   | 3,507        |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC                | 116.446 | 832          | 140.521   | 995          |
|   | (-)     | (4)          | (-)       | (-)          |
| ASSURA PLC                                | 979.633 | 561          | 1,138.511 | 642          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | 210.591 | 124          | 227.094   | 132          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD                | 257.154 | 230          | 62.879    | 58           |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC                     | 146.332 | 137          | 154.385   | 145          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD           | 544.164 | 483          | 316.63    | 272          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD                    | 96.354  | 544          | 113.596   | 636          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC                 | 302.075 | 564          | 345.983   | 645          |
|   | (-)     | (-)          | (-)       | (-)          |

|                                       | 買 付 額                 |               | 売 付 額          |               |
|---------------------------------------|-----------------------|---------------|----------------|---------------|
|                                       | □ 数                   | 金 額           | □ 数            | 金 額           |
| <b>イギリス</b>                           | 千□                    | 千イギリス・ポンド     | 千□             | 千イギリス・ポンド     |
| RDI REIT PLC                          | 268.946<br>(△435.616) | 85<br>(-)     | 284.57<br>(-)  | 119<br>(-)    |
| NEWRIVER REIT PLC                     | 103.299<br>(-)        | 231<br>(-)    | 130.334<br>(-) | 308<br>(-)    |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC            | 278.488<br>(-)        | 278<br>(-)    | 124.548<br>(-) | 116<br>(-)    |
| AEW UK LONG LEASE REIT PLC            | -<br>(-)              | -<br>(-)      | 37.06<br>(-)   | 35<br>(-)     |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC  | 249.974<br>(-)        | 258<br>(-)    | 115.017<br>(-) | 116<br>(-)    |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC               | 730.342<br>(-)        | 1,046<br>(-)  | 758.831<br>(-) | 1,092<br>(-)  |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC          | 195.483<br>(-)        | 183<br>(-)    | 227.97<br>(-)  | 213<br>(-)    |
| LXI REIT PLC                          | 163.221<br>(-)        | 199<br>(-)    | 102.424<br>(-) | 127<br>(-)    |
| REGIONAL REIT LTD                     | 42.589<br>(-)         | 43<br>(-)     | 50.002<br>(-)  | 50<br>(-)     |
| <b>イスラエル</b>                          | 千□                    | 千イスラエル・シケル    | 千□             | 千イスラエル・シケル    |
| REIT 1 LTD                            | 49.236<br>(-)         | 741<br>(-)    | 55.868<br>(-)  | 848<br>(-)    |
| <b>韓国</b>                             | 千□                    | 千韓国・ウォン       | 千□             | 千韓国・ウォン       |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD             | 11.931<br>(-)         | 68,035<br>(-) | 2.615<br>(-)   | 16,416<br>(-) |
| <b>ユーロ (アイルランド)</b>                   | 千□                    | 千ユーロ          | 千□             | 千ユーロ          |
| GREEN REIT PLC                        | 236.998<br>(-)        | 359<br>(-)    | 289.749<br>(-) | 436<br>(-)    |
| HIBERNIA REIT PLC                     | 301.843<br>(-)        | 419<br>(-)    | 359.133<br>(-) | 497<br>(-)    |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 123.754<br>(-)        | 185<br>(-)    | 138.475<br>(-) | 204<br>(-)    |
| <b>ユーロ (オランダ)</b>                     | 千□                    | 千ユーロ          | 千□             | 千ユーロ          |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV          | 18.473<br>(-)         | 525<br>(-)    | 25.483<br>(-)  | 749<br>(-)    |
| VASTNED RETAIL                        | 6.129<br>(-)          | 200<br>(-)    | 6.597<br>(-)   | 217<br>(-)    |
| WERELDHAVE NV                         | 18.915<br>(-)         | 542<br>(-)    | 21.418<br>(-)  | 611<br>(-)    |
| NSI NV                                | 5.389<br>(-)          | 189<br>(-)    | 6.676<br>(-)   | 233<br>(-)    |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD             | 62.815<br>(-)         | 9,724<br>(-)  | 71.729<br>(-)  | 11,288<br>(-) |
| <b>ユーロ (ベルギー)</b>                     | 千□                    | 千ユーロ          | 千□             | 千ユーロ          |
| BEFIMMO                               | 9.827<br>(-)          | 494<br>(-)    | 11.687<br>(-)  | 582<br>(-)    |
| COFINIMMO SA                          | 10.427<br>(-)         | 1,144<br>(-)  | 11.214<br>(-)  | 1,220<br>(-)  |
| RETAIL ESTATES                        | 3.173<br>(-)          | 240<br>(-)    | 3.796<br>(-)   | 287<br>(-)    |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES          | 8.965<br>(-)          | 205<br>(-)    | 7.531<br>(-)   | 173<br>(-)    |
| WAREHOUSES DE PAUW                    | 7.777<br>(-)          | 944<br>(-)    | 8.578<br>(-)   | 1,030<br>(-)  |
| MONTEA SCA                            | 5.495<br>(-)          | 379<br>(-)    | 1.933<br>(-)   | 144<br>(-)    |

|   | 買 付 額                 |                  | 売 付 額          |              |
|---|-----------------------|------------------|----------------|--------------|
|   | □ 数                   | 金 額              | □ 数            | 金 額          |
| <b>ユーロ (ベルギー)</b>                           | 千□                    | 千ユーロ             | 千□             | 千ユーロ         |
| AEDIFICA                                    | 9.653<br>(-)          | 765<br>(-)       | 8.616<br>(-)   | 674<br>(-)   |
| COFINIMMO SA-RTS                            | -<br>(-)              | -<br>(-)         | 8.342<br>(-)   | 5<br>(-)     |
| INTERVEST OFFICES &<br>WAREHOUSES-RTS       | -<br>(6.367)          | -<br>(-)         | 6.367<br>(-)   | 1<br>(-)     |
| MONTEA CVA-RTS                              | -<br>(2.68)           | -<br>(-)         | 2.68<br>(-)    | 1<br>(-)     |
| AEDIFICA SA-RTS                             | -<br>(7.159)          | -<br>(-)         | 7.159<br>(-)   | 23<br>(-)    |
| <b>ユーロ (フランス)</b>                           | 千□                    | 千ユーロ             | 千□             | 千ユーロ         |
| GECINA SA                                   | 27.493<br>(-)         | 3,620<br>(-)     | 28.486<br>(-)  | 3,740<br>(-) |
| ICADE                                       | 18.147<br>(-)         | 1,356<br>(-)     | 20.929<br>(-)  | 1,547<br>(-) |
| ALTAREA                                     | 1.082<br>(-)          | 195<br>(-)       | 1.391<br>(-)   | 258<br>(-)   |
| KLEPIERRE                                   | 93.413<br>(-)         | 2,800<br>(-)     | 109.79<br>(-)  | 3,292<br>(-) |
| COVIVIO                                     | 24.261<br>(-)         | 2,156<br>(-)     | 27.794<br>(-)  | 2,471<br>(-) |
| MERCIALYS                                   | 18.313<br>(-)         | 228<br>(-)       | 22.454<br>(-)  | 280<br>(-)   |
| COVIVIO                                     | -<br>(2.776)          | -<br>(-)         | -<br>(-)       | -<br>(-)     |
| <b>ユーロ (ドイツ)</b>                            | 千□                    | 千ユーロ             | 千□             | 千ユーロ         |
| HAMBORNER REIT AG                           | 28.848<br>(-)         | 261<br>(-)       | 34.209<br>(-)  | 305<br>(-)   |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG                      | 69.158<br>(-)         | 888<br>(△24)     | 74.4<br>(-)    | 959<br>(-)   |
| <b>ユーロ (スペイン)</b>                           | 千□                    | 千ユーロ             | 千□             | 千ユーロ         |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI<br>SA          | 132.264<br>(-)        | 1,204<br>(-)     | 171.48<br>(-)  | 1,538<br>(-) |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI<br>SA         | 29.717<br>(-)         | 235<br>(△1)      | 44.258<br>(-)  | 357<br>(-)   |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS<br>SOCIMI SA | 4.117<br>(-)          | 75<br>(-)        | 50.296<br>(-)  | 917<br>(-)   |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA                 | 151.755<br>(-)        | 1,734<br>(△13)   | 163.968<br>(-) | 1,881<br>(-) |
| <b>ユーロ (イタリア)</b>                           | 千□                    | 千ユーロ             | 千□             | 千ユーロ         |
| BENI STABILI SPA                            | 185.952<br>(△336.763) | 139<br>(-)       | 286.949<br>(-) | 208<br>(-)   |
| IMMOBILIARE GRANDE<br>DISTRIBUZIONE         | 11.626<br>(-)         | 69<br>(△0.18159) | 15.741<br>(-)  | 97<br>(-)    |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## ■利害関係人との取引状況等 (2018年6月23日から2019年6月24日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

## ■組入資産の明細

### 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄                             | 期首(前期末) |         | 当期 |         | 期末       |           |     |
|--------------------------------|---------|---------|----|---------|----------|-----------|-----|
|                                | □       | 数       | □  | 数       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    | 比率  |
|                                |         | 千□      |    | 千□      | 千アメリカ・ドル | 千円        | %   |
| 不動産ファンド<br>(アメリカ)              |         | 千□      |    | 千□      | 千アメリカ・ドル | 千円        | %   |
| MANULIFE US REIT               |         | 511.5   |    | 456.5   | 394      | 42,417    | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT   |         | 43.436  |    | 40.032  | 5,815    | 624,738   | 1.3 |
| ALEXANDER'S INC.               |         | 1.606   |    | 1.406   | 525      | 56,433    | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC          |         | 65.092  |    | 54.797  | 7,456    | 800,947   | 1.7 |
| CEDAR REALTY TRUST INC         |         | 33.531  |    | 27.397  | 72       | 7,828     | 0.0 |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC      |         | 84.226  |    | 74.959  | 2,852    | 306,382   | 0.6 |
| APARTMENT INVNT & MGMT CO-A    |         | 66.724  |    | 52.06   | 2,663    | 286,157   | 0.6 |
| AGREE REALTY CORP              |         | 13.167  |    | 13.141  | 877      | 94,252    | 0.2 |
| BRT APARTMENTS CORP            |         | —       |    | 2.813   | 36       | 3,967     | 0.0 |
| SL GREEN                       |         | 37.248  |    | 29.965  | 2,532    | 272,056   | 0.6 |
| EPR PROPERTIES                 |         | 27.43   |    | 26.376  | 2,049    | 220,204   | 0.5 |
| PROLOGIS INC                   |         | 224.948 |    | 221.421 | 18,008   | 1,934,437 | 4.1 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC      |         | 58.29   |    | 49.184  | 10,220   | 1,097,879 | 2.3 |
| LEXINGTON REALTY TRUST         |         | 91.973  |    | 76.871  | 747      | 80,262    | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST          |         | 39.066  |    | 34.249  | 3,636    | 390,602   | 0.8 |
| CBL & ASSOCIATES               |         | 72.069  |    | 47.062  | 44       | 4,822     | 0.0 |
| MACK CALI                      |         | 38.286  |    | 31.711  | 755      | 81,208    | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC |         | 65.269  |    | 57.252  | 3,148    | 338,250   | 0.7 |
| COUSINS PROPERTIES INC         |         | 178.182 |    | 51.859  | 1,983    | 213,079   | 0.4 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES       |         | 46.458  |    | —       | —        | —         | —   |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES      |         | 12.432  |    | 11.393  | 244      | 26,263    | 0.1 |
| SITE CENTERS CORP              |         | 64.983  |    | 50.198  | 679      | 72,957    | 0.2 |
| ISTAR INC                      |         | 28.395  |    | —       | —        | —         | —   |
| DUKE REALTY TRUST              |         | 150.436 |    | 127.358 | 4,063    | 436,554   | 0.9 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST      |         | 39.727  |    | 25.699  | 79       | 8,530     | 0.0 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC       |         | 27.845  |    | 23.315  | 6,994    | 751,299   | 1.6 |
| EQUITY RESIDENTIAL             |         | 155.294 |    | 130.924 | 10,215   | 1,097,402 | 2.3 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST      |         | 30.863  |    | 26.353  | 3,526    | 378,822   | 0.8 |
| FIRST INDUSTRIAL RT            |         | 52.771  |    | 44.501  | 1,642    | 176,392   | 0.4 |
| GGP INC                        |         | 266.85  |    | —       | —        | —         | —   |
| HCP INC                        |         | 198.084 |    | 169.495 | 5,542    | 595,373   | 1.3 |
| EQUITY COMMONWEALTH            |         | 51.112  |    | 42.702  | 1,416    | 152,152   | 0.3 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC    |         | 52.993  |    | 44.016  | 1,431    | 153,808   | 0.3 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC       |         | 43.81   |    | 36.411  | 1,583    | 170,140   | 0.4 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST   |         | 69.715  |    | 57.784  | 1,437    | 154,434   | 0.3 |
| WELLTOWER INC                  |         | 156.947 |    | 137.308 | 11,485   | 1,233,806 | 2.6 |
| EAST GROUP                     |         | 14.741  |    | 12.816  | 1,494    | 160,522   | 0.3 |
| KIMCO REALTY                   |         | 179.68  |    | 149.202 | 2,819    | 302,915   | 0.6 |
| KILROY REALTY CORP             |         | 41.605  |    | 35.671  | 2,709    | 291,061   | 0.6 |
| LTC PROPERTIES INC             |         | 16.835  |    | 14.61   | 679      | 72,961    | 0.2 |
| SENIOR HOUSING PPTYS TRUST     |         | 100.809 |    | 83.031  | 678      | 72,869    | 0.2 |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A    |         | 33.032  |    | 34.32   | 474      | 50,986    | 0.1 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST         |         | 62.537  |    | 52.372  | 2,663    | 286,071   | 0.6 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST        |         | 74.331  |    | 61.895  | 930      | 99,997    | 0.2 |
| IRON MOUNTAIN INC              |         | 118.572 |    | 101.232 | 3,245    | 348,631   | 0.7 |
| THE MACERICH COMPANY           |         | 45.998  |    | 37.186  | 1,255    | 134,894   | 0.3 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES    |         | 37.342  |    | 32.042  | 3,912    | 420,262   | 0.9 |
| ACADIA REALTY TRUST            |         | 34.26   |    | 28.451  | 807      | 86,735    | 0.2 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC      |         | 312.724 |    | 262.621 | 4,771    | 512,589   | 1.1 |
| MID AMERICA                    |         | 47.941  |    | 40.303  | 4,799    | 515,582   | 1.1 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST       |         | 15.638  |    | 13.759  | 231      | 24,904    | 0.1 |
| NATIONAL HEALTH INVS INC       |         | 17.625  |    | 14.991  | 1,206    | 129,567   | 0.3 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST    |         | 50.011  |    | 4.546   | 271      | 29,138    | 0.1 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC     |         | 6.553   |    | 4.255   | 132      | 14,214    | 0.0 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST    |         | 29.416  |    | 17.505  | 108      | 11,696    | 0.0 |
| GETTY REALTY CORP              |         | 13.326  |    | 12.616  | 393      | 42,296    | 0.1 |



| 銘柄                               | 期首(前期末) |         | 当期 |         | 期末       |           |     |
|----------------------------------|---------|---------|----|---------|----------|-----------|-----|
|                                  | □       | 数       | □  | 数       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    | 比率  |
| (アメリカ)                           |         | 千口      |    | 千口      | 千アメリカ・ドル | 千円        | %   |
| PS BUSINESS PARKS                |         | 8.446   |    | 7,004   | 1,234    | 132,612   | 0.3 |
| RPT REALTY                       |         | 33.773  |    | 27.63   | 347      | 37,337    | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP               |         | 119.894 |    | 107.748 | 7,784    | 836,242   | 1.8 |
| REGENCY CENTERS CORP             |         | 62.085  |    | 59,384  | 4,128    | 443,470   | 0.9 |
| UDR INC                          |         | 113.114 |    | 97,737  | 4,464    | 479,590   | 1.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES      |         | 42.988  |    | 38,643  | 1,094    | 117,598   | 0.2 |
| CORECIVIC INC                    |         | 50.174  |    | 41,521  | 928      | 99,774    | 0.2 |
| SAUL CENTERS INC                 |         | 5.042   |    | 4,421   | 244      | 26,243    | 0.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC         |         | 130.666 |    | 108,459 | 17,797   | 1,911,757 | 4.0 |
| LIFE STORAGE INC                 |         | 19.733  |    | 16,395  | 1,591    | 170,919   | 0.4 |
| PUBLIC STORAGE                   |         | 63.208  |    | 52,671  | 12,667   | 1,360,729 | 2.9 |
| SUN COMMUNITIES INC              |         | 33.726  |    | 30,554  | 3,967    | 426,182   | 0.9 |
| TAUBMAN CENTERS INC              |         | 25.845  |    | 21,393  | 902      | 96,977    | 0.2 |
| TANGER FACTORY OUTLET            |         | 40.143  |    | 32,737  | 527      | 56,687    | 0.1 |
| UMH PROPERTIES INC               |         | 14.882  |    | 13,433  | 175      | 18,888    | 0.0 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP        |         | 12.671  |    | 11,234  | 241      | 25,921    | 0.1 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME     |         | 5.259   |    | 4,708   | 407      | 43,781    | 0.1 |
| VENTAS INC                       |         | 150.254 |    | 126,445 | 8,891    | 955,137   | 2.0 |
| VORNADO REALTY TRUST             |         | 73.134  |    | 61,491  | 4,105    | 441,040   | 0.9 |
| WASHINGTON REIT                  |         | 33.313  |    | 27,867  | 770      | 82,799    | 0.2 |
| GEO GROUP INC                    |         | 51.638  |    | 42,24   | 928      | 99,777    | 0.2 |
| WEINGARTEN REALTY INVST          |         | 50.686  |    | 41,968  | 1,190    | 127,897   | 0.3 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES      |         | 57.893  |    | 49,096  | 2,296    | 246,712   | 0.5 |
| KITE REALTY GROUP TRUST          |         | 35.532  |    | 31,031  | 482      | 51,866    | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC          |         | 53.193  |    | 45,051  | 4,853    | 521,394   | 1.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C     |         | 44.756  |    | 40.56   | 307      | 33,025    | 0.1 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC     |         | 95.603  |    | 80,002  | 1,085    | 116,618   | 0.2 |
| CUBESMART                        |         | 77.311  |    | 66,756  | 2,280    | 244,958   | 0.5 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC         |         | 86.876  |    | 73,766  | 9,084    | 975,833   | 2.1 |
| EDUCATION REALTY TRUST INC       |         | 32.161  |    | —       | —        | —         | —   |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO       |         | 85.121  |    | 73,922  | 754      | 81,074    | 0.2 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST         |         | 154.694 |    | 136.49  | 2,485    | 266,990   | 0.6 |
| DOUGLAS EMMETT INC               |         | 67.6    |    | 57,933  | 2,368    | 254,402   | 0.5 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC         |         | 39.742  |    | —       | —        | —         | —   |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C |         | 47.738  |    | 41,878  | 724      | 77,824    | 0.2 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC |         | 54.405  |    | 43,929  | 903      | 97,019    | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC      |         | 44.281  |    | 38,836  | 443      | 47,683    | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP              |         | 23.552  |    | 21,401  | 1,026    | 110,232   | 0.2 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC        |         | 17.616  |    | 13,155  | 624      | 67,108    | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST                |         | 74.135  |    | 61,408  | 1,094    | 117,614   | 0.2 |
| AMERICOLD REALTY TRUST           |         | 19.99   |    | 65,012  | 2,209    | 237,302   | 0.5 |
| CORESITE REALTY CORP             |         | 14.529  |    | 12,902  | 1,514    | 162,666   | 0.3 |
| VEREIT INC                       |         | 407.682 |    | 342,119 | 3,250    | 349,129   | 0.7 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST         |         | 25.52   |    | 21,119  | 605      | 65,063    | 0.1 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST          |         | 29.264  |    | 45.82   | 1,304    | 140,079   | 0.3 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST   |         | 42.132  |    | 17,851  | 467      | 50,220    | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES  |         | 16.134  |    | 16.36   | 244      | 26,220    | 0.1 |
| CHATHAM LODGING TRUST            |         | 19.517  |    | 17,398  | 334      | 35,882    | 0.1 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC       |         | 75.62   |    | 62,571  | 1,224    | 131,537   | 0.3 |
| WHITESTONE REIT                  |         | 17.842  |    | 15,361  | 197      | 21,203    | 0.0 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC    |         | 65.87   |    | 54,303  | 1,843    | 198,038   | 0.4 |
| STAG INDUSTRIAL INC              |         | 40.858  |    | 43,588  | 1,361    | 146,272   | 0.3 |
| SELECT INCOME REIT               |         | 27.352  |    | —       | —        | —         | —   |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC |         | 92.273  |    | 74,671  | 907      | 97,537    | 0.2 |
| CYRUSONE INC                     |         | 41.756  |    | 38.14   | 2,289    | 245,901   | 0.5 |
| WP CAREY INC                     |         | 45.338  |    | 60.124  | 5,145    | 552,720   | 1.2 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC          |         | 28.742  |    | —       | —        | —         | —   |
| GLADSTONE LAND CORP              |         | 5.526   |    | 4.129   | 47       | 5,145     | 0.0 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC  |         | 86.903  |    | 72.282  | 2,050    | 220,279   | 0.5 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES     |         | 21.716  |    | 18.038  | 1,454    | 156,193   | 0.3 |

| 銘 柄                              | 期 首(前期末)      |               | 当 期       |             | 末   |      |
|----------------------------------|---------------|---------------|-----------|-------------|-----|------|
|                                  | □ 数           | □ 数           | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 率 | 率    |
| (アメリカ)                           | 千□            | 千□            | 千アメリカ・ドル  | 千円          |     | %    |
| WHEELER REIT INC                 | 2.961         | —             | —         | —           | —   | —    |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP      | —             | 18.755        | 228       | 24,558      | 0.1 | —    |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC    | 19.187        | —             | —         | —           | —   | —    |
| GRAMERCY PROPERTY TRSUT          | 68.158        | —             | —         | —           | —   | —    |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC        | 180.298       | 30.159        | 1,354     | 145,461     | 0.3 | —    |
| PHYSICIANS REALTY TRUST          | 76.067        | 63.958        | 1,144     | 122,910     | 0.3 | —    |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC    | 34.068        | 36.539        | 1,486     | 159,709     | 0.3 | —    |
| AMERICAN HOMES 4 RENT            | 110.338       | 92.275        | 2,305     | 247,705     | 0.5 | —    |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC    | 35.997        | 33.291        | 393       | 42,305      | 0.1 | —    |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | —             | 3.694         | 434       | 46,633      | 0.1 | —    |
| JBG SMITH PROPERTIES             | 39.622        | 41.967        | 1,699     | 182,532     | 0.4 | —    |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC       | —             | 20.602        | 219       | 23,613      | 0.0 | —    |
| RETAIL VALUE INC                 | —             | 5.916         | 202       | 21,714      | 0.0 | —    |
| INVITATION HOMES INC             | 120.949       | 135.096       | 3,667     | 394,001     | 0.8 | —    |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC     | 13.143        | —             | —         | —           | —   | —    |
| FOREST CITY REALTY TRUST INC     | 113.135       | —             | —         | —           | —   | —    |
| QTS REALTY TRUST INC             | 21.476        | 19.246        | 894       | 96,134      | 0.2 | —    |
| SPIRIT MTA REIT                  | 17.097        | 13.946        | 122       | 13,108      | 0.0 | —    |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC    | 55.942        | 48,864        | 758       | 81,464      | 0.2 | —    |
| SAFEHOLD INC                     | —             | 2,744         | 78        | 8,433       | 0.0 | —    |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS | —             | 17.735        | 370       | 39,816      | 0.1 | —    |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES  | 8.484         | 24.28         | 493       | 52,971      | 0.1 | —    |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC      | 49.73         | 40.874        | 901       | 96,814      | 0.2 | —    |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | 84.705        | 71.712        | 2,889     | 310,366     | 0.7 | —    |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC       | 127.551       | 105.086       | 1,935     | 207,931     | 0.4 | —    |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC     | 13.902        | 8.936         | 87        | 9,407       | 0.0 | —    |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC     | —             | 33.378        | 653       | 70,167      | 0.1 | —    |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT | 8.916         | 6,509         | 76        | 8,166       | 0.0 | —    |
| FARMLAND PARTNERS INC            | 14.523        | 9.63          | 65        | 7,034       | 0.0 | —    |
| CITY OFFICE REIT INC             | 14.463        | 15.324        | 189       | 20,378      | 0.0 | —    |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC       | 78.952        | 70.292        | 278       | 29,901      | 0.1 | —    |
| CARETRUST REIT INC               | 32.366        | 33.024        | 814       | 87,515      | 0.2 | —    |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC  | 34.578        | 31.63         | 218       | 23,478      | 0.0 | —    |
| STORE CAPITAL CORP               | 72.549        | 70.644        | 2,471     | 265,524     | 0.6 | —    |
| PARAMOUNT GROUP INC              | 86.597        | 70.246        | 1,029     | 110,546     | 0.2 | —    |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC          | 8.278         | 7.336         | 82        | 8,896       | 0.0 | —    |
| URBAN EDGE PROPERTIES            | 44.936        | 44.064        | 790       | 84,869      | 0.2 | —    |
| INFRAREIT INC                    | 16.132        | —             | —         | —           | —   | —    |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I | 18.694        | 25.372        | 464       | 49,930      | 0.1 | —    |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC       | 45.298        | 39.522        | 828       | 88,984      | 0.2 | —    |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC   | 7.762         | 8.002         | 328       | 35,233      | 0.1 | —    |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS | 21.369        | 19.694        | 583       | 62,640      | 0.1 | —    |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC   | 6.974         | 6.76          | 266       | 28,668      | 0.1 | —    |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC       | 91.138        | 75.452        | 1,194     | 128,303     | 0.3 | —    |
| GLOBAL NET LEASE INC             | 28.621        | 29.176        | 577       | 62,086      | 0.1 | —    |
| TIER REIT INC                    | 20.328        | —             | —         | —           | —   | —    |
| QUALITY CARE PROPERTIES INC      | 39.836        | —             | —         | —           | —   | —    |
| CLIPPER REALTY INC               | 5.169         | 5.169         | 63        | 6,790       | 0.0 | —    |
| PARK HOTELS & RESORTS INC        | 85.299        | 70.84         | 1,998     | 214,667     | 0.5 | —    |
| VICI PROPERTIES INC              | —             | 127.279       | 2,900     | 311,591     | 0.7 | —    |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP     | 21.513        | 18.806        | 300       | 32,241      | 0.1 | —    |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES       | 11.004        | 10.32         | 440       | 47,369      | 0.1 | —    |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC  | 26.006        | 25.108        | 711       | 76,381      | 0.2 | —    |
| COLONY CAPITAL INC               | 208.616       | 171.468       | 886       | 95,226      | 0.2 | —    |
| 小 計                              | □ 数 9,953,908 | □ 数 7,983,341 | 319,298   | 34,299,078  | —   | —    |
| 銘 柄 数之比                          | <71.3%>       | <72.3%>       | —         | —           | —   | 72.3 |
| (カナダ)                            | 千□            | 千□            | 千カナダ・ドル   | 千円          |     | %    |
| SMARTCENTRES REIT                | 27.854        | 24.167        | 823       | 67,014      | 0.1 | —    |
| CANADIAN APT PPTYS REIT          | 29.587        | 26.047        | 1,284     | 104,556     | 0.2 | —    |
| MORGUARD REAL ESTATE INVT TR     | 10.016        | —             | —         | —           | —   | —    |

| 銘 柄                              | 期 首(前期末)  |        | 当 期       |             |         | 末 |     |
|----------------------------------|-----------|--------|-----------|-------------|---------|---|-----|
|                                  | □ 数       | 金額     | □ 数       | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  | 比 | 率   |
| <b>(カナダ)</b>                     | 千口        | 千円     | 千口        | 千カナダ・ドル     | 千円      |   | %   |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT     | 60.656    |        | 48.916    | 1,128       | 91,847  |   | 0.2 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST  | 65.342    |        | 52.282    | 1,393       | 113,401 |   | 0.2 |
| ALLIED PROPERTIES REIT           | 19.518    |        | 18.469    | 886         | 72,153  |   | 0.2 |
| COMINAR REAL ESTATE INVNT TR     | 38.546    |        | 30.322    | 376         | 30,676  |   | 0.1 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | 12.463    |        | 9.817     | 239         | 19,495  |   | 0.0 |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT         | 10.096    |        | 10.523    | 287         | 23,415  |   | 0.0 |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST     | 9.781     |        | 7.736     | 314         | 25,588  |   | 0.1 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 30.141    |        | 24.488    | 287         | 23,398  |   | 0.0 |
| CROMBIE REAL ESTATE INV          | 18.049    |        | 16.86     | 267         | 21,777  |   | 0.0 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST     | 20.114    |        | 19.862    | 280         | 22,793  |   | 0.0 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES  | 21.137    |        | 22.017    | 262         | 21,324  |   | 0.0 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT | 7.446     |        | 6.696     | 122         | 9,978   |   | 0.0 |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM | 37.235    |        | 33.203    | 465         | 37,860  |   | 0.1 |
| DREAM INDUSTRIAL REIT            | 13.888    |        | 22.37     | 270         | 22,030  |   | 0.0 |
| AGELLAN COMMERCIAL REIT          | 7.03      |        | —         | —           | —       |   | —   |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT    | 17.406    |        | 19.293    | 256         | 20,884  |   | 0.0 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | 9.917     |        | 8.529     | 531         | 43,240  |   | 0.1 |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT       | —         |        | 10.465    | 69          | 5,689   |   | 0.0 |
| CHOICE PROPERTIES REIT           | 58.346    |        | 53.304    | 747         | 60,867  |   | 0.1 |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE | —         |        | 5.037     | 96          | 7,854   |   | 0.0 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 12.724    |        | 16.489    | 239         | 19,513  |   | 0.0 |
| SLATE RETAIL REIT                | 7.739     |        | 6.406     | 80          | 6,579   |   | 0.0 |
| SLATE OFFICE REIT                | 12.079    |        | 12.079    | 72          | 5,888   |   | 0.0 |
| KILLAM APARTMENT REIT            | 15.367    |        | 16.959    | 333         | 27,122  |   | 0.1 |
| 小 計                              | □ 数       | 金額     | □ 数       | 金額          | 金額      |   | —   |
|                                  | 25銘柄      | <1.9%> | 25銘柄      | <1.9%>      | —       |   | 1.9 |
| <b>(オーストラリア)</b>                 | 千口        | 千円     | 千口        | 千オーストラリア・ドル | 千円      |   | %   |
| BWP TRUST                        | 205.883   |        | 166.921   | 645         | 48,267  |   | 0.1 |
| MIRVAC GROUP                     | 1,562.622 |        | 1,398.222 | 4,404       | 329,096 |   | 0.7 |
| INVESTA OFFICE FUND              | 211.438   |        | —         | —           | —       |   | —   |
| CROMWELL PROPERTY GROUP          | 674.83    |        | 608.982   | 761         | 56,878  |   | 0.1 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT         | 140.441   |        | 124.412   | 577         | 43,133  |   | 0.1 |
| GPT GROUP                        | 761.372   |        | 632.592   | 3,966       | 296,365 |   | 0.6 |
| ABACUS PROPERTY GROUP            | 137.44    |        | 120.666   | 520         | 38,859  |   | 0.1 |
| CHARTER HALL EDUCATION TRUST     | 88.555    |        | 95.978    | 368         | 27,538  |   | 0.1 |
| STOCKLAND                        | 1,031.289 |        | 871.018   | 3,762       | 281,156 |   | 0.6 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP        | 85.235    |        | 79.545    | 256         | 19,197  |   | 0.0 |
| DEXUS                            | 429.175   |        | 383.348   | 5,167       | 386,117 |   | 0.8 |
| GOODMAN GROUP                    | 676.39    |        | 568.14    | 8,567       | 640,167 |   | 1.4 |
| VICINITY CENTRES                 | 1,363.217 |        | 1,131.404 | 2,964       | 221,490 |   | 0.5 |
| CHARTER HALL GROUP               | 196.697   |        | 162.348   | 1,803       | 134,771 |   | 0.3 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 104.165   |        | 99.748    | 428         | 32,048  |   | 0.1 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA     | 307.102   |        | 313.615   | 802         | 59,989  |   | 0.1 |
| ARENA REIT                       | 108.676   |        | 106.906   | 306         | 22,925  |   | 0.0 |
| PROPERTYLINK GROUP               | 151.222   |        | —         | —           | —       |   | —   |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT      | 72.501    |        | 77.55     | 396         | 29,610  |   | 0.1 |
| APN INDUSTRIA REIT               | 42.579    |        | 38.914    | 114         | 8,577   |   | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT            | 223.901   |        | 243.475   | 445         | 33,292  |   | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD   | 62.65     |        | 52.264    | 183         | 13,707  |   | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP               | 208.566   |        | 160.1     | 228         | 17,106  |   | 0.0 |
| RURAL FUNDS GROUP                | 104.894   |        | 105.905   | 248         | 18,596  |   | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                    | 2,259.234 |        | 1,887.979 | 7,268       | 543,118 |   | 1.1 |
| VIVA ENERGY REIT                 | 183.737   |        | 156.535   | 425         | 31,813  |   | 0.1 |
| 小 計                              | □ 数       | 金額     | □ 数       | 金額          | 金額      |   | —   |
|                                  | 26銘柄      | <6.9%> | 24銘柄      | <7.0%>      | —       |   | 7.0 |
| <b>(香港)</b>                      | 千口        | 千円     | 千口        | 千香港・ドル      | 千円      |   | %   |
| LINK REIT                        | 910.52    |        | 748.52    | 71,932      | 989,075 |   | 2.1 |
| PROSPERITY REIT                  | 522       |        | 462       | 1,570       | 21,598  |   | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | 492       |        | 481       | 2,578       | 35,449  |   | 0.1 |
| CHAMPION REIT                    | 871.07    |        | 691.07    | 4,485       | 61,669  |   | 0.1 |

| 銘柄                               | 期首(前期末)    |            | 当期         |              |           | 末   |
|----------------------------------|------------|------------|------------|--------------|-----------|-----|
|                                  | 口数         | 金額         | 口数         | 外貨建金額        | 邦貨換算金額    | 比率  |
| (香港)                             | 千口         | 千円         | 千口         | 千香港・ドル       | 千円        | %   |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT  | 403        | 384        | 384        | 2,284        | 31,416    | 0.1 |
| FORTUNE REAL ESTATE (HK)         | 588        | 477        | 477        | 5,094        | 70,047    | 0.1 |
| SPRING REIT                      | 351        | —          | —          | —            | —         | —   |
| 小計                               | 4,137.59   | 3,243.59   | 3,243.59   | 87,945       | 1,209,256 | —   |
| 銘柄数<比率>                          | 7銘柄<2.1%>  | —          | 6銘柄<2.6%>  | —            | —         | 2.6 |
| (シンガポール)                         | 千口         | 千円         | 千口         | 千シンガポール・ドル   | 千円        | %   |
| CAPITALAND MALL TRUST            | 1,136.76   | 1,001.86   | 1,001.86   | 2,564        | 203,539   | 0.4 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT        | 1,014.36   | 911.76     | 911.76     | 2,771        | 219,966   | 0.5 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST      | 1,132.679  | 992.379    | 992.379    | 2,123        | 168,536   | 0.4 |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR     | 952.79     | 808.39     | 808.39     | 1,568        | 124,458   | 0.3 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST        | 876.22     | 839.72     | 839.72     | 1,318        | 104,625   | 0.2 |
| STARHILL GLOBAL REIT             | 550.5      | 469.2      | 469.2      | 363          | 28,857    | 0.1 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST           | 548.015    | 438.715    | 438.715    | 570          | 45,261    | 0.1 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST         | 270.88     | 244.28     | 244.28     | 385          | 30,629    | 0.1 |
| KEPPEL REIT                      | 769.7      | 626.4      | 626.4      | 789          | 62,635    | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST        | 247.6      | 230.1      | 230.1      | 584          | 46,382    | 0.1 |
| ESR REIT                         | 539.43     | 660.33     | 660.33     | 353          | 28,036    | 0.1 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS           | 314.3      | 257.6      | 257.6      | 414          | 32,913    | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST    | 234.58     | 233.38     | 233.38     | 359          | 28,522    | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 236.6      | 198.5      | 198.5      | 202          | 16,068    | 0.0 |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD    | 235.095    | 217.695    | 217.695    | 317          | 25,223    | 0.1 |
| PARKWAY LIFE REIT                | 167.7      | 131.6      | 131.6      | 402          | 31,957    | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU | 798.3      | 571.8      | 571.8      | 131          | 10,436    | 0.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST       | 524.22     | 460.92     | 460.92     | 995          | 79,009    | 0.2 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST       | 811.8      | 657.2      | 657.2      | 1,334        | 105,875   | 0.2 |
| CACHE LOGISTICS TRUST            | 435.78     | 410.78     | 410.78     | 328          | 26,079    | 0.1 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT     | 357.2      | 218.6      | 218.6      | 98           | 7,806     | 0.0 |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL  | 912.6      | 741.7      | 741.7      | 1,068        | 84,760    | 0.2 |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST       | 317.2      | 283.5      | 283.5      | 277          | 22,048    | 0.0 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST       | 359.6      | 355.6      | 355.6      | 240          | 19,048    | 0.0 |
| SPH REIT                         | 265.4      | 224.9      | 224.9      | 238          | 18,918    | 0.0 |
| OUE HOSPITALITY TRUST            | 488.62     | 445.32     | 445.32     | 316          | 25,091    | 0.1 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT    | 276.1      | 256.4      | 256.4      | 156          | 12,412    | 0.0 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST        | —          | 273        | 273        | 193          | 15,382    | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT                   | 402.2      | 341        | 341        | 552          | 43,840    | 0.1 |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL T | 572.75     | 555.65     | 555.65     | 677          | 53,797    | 0.1 |
| 小計                               | 15,748.979 | 14,058.279 | 14,058.279 | 21,700       | 1,722,122 | —   |
| 銘柄数<比率>                          | 29銘柄<3.2%> | —          | 30銘柄<3.6%> | —            | —         | 3.6 |
| (ニュージーランド)                       | 千口         | 千円         | 千口         | 千ニュージーランド・ドル | 千円        | %   |
| PRECINCT PROPERTIES              | 423.696    | 380.191    | 380.191    | 661          | 46,876    | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST  | 129.943    | 127.868    | 127.868    | 310          | 22,017    | 0.0 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST           | 441.448    | 361.871    | 361.871    | 698          | 49,489    | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD          | 606.953    | 512.744    | 512.744    | 825          | 58,496    | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD              | 356.878    | 282.83     | 282.83     | 383          | 27,156    | 0.1 |
| INVESTORE PROPERTY LTD           | 88.877     | —          | —          | —            | —         | —   |
| STRIDE STAPLED GROUP             | 149.101    | 140.039    | 140.039    | 308          | 21,830    | 0.0 |
| 小計                               | 2,196.896  | 1,805.543  | 1,805.543  | 3,187        | 225,866   | —   |
| 銘柄数<比率>                          | 7銘柄<0.4%>  | —          | 6銘柄<0.5%>  | —            | —         | 0.5 |
| (イギリス)                           | 千口         | 千円         | 千口         | 千イギリス・ポンド    | 千円        | %   |
| BRITISH LAND CO PLC              | 419.592    | 337.35     | 337.35     | 1,821        | 249,462   | 0.5 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC           | 229.731    | 135.437    | 135.437    | 18           | 2,540     | 0.0 |
| DERWENT LONDON PLC               | 46.537     | 38.645     | 38.645     | 1,218        | 166,805   | 0.4 |
| BIG YELLOW GROUP PLC             | 63.285     | 54.616     | 54.616     | 543          | 74,491    | 0.2 |
| HAMMERSON PLC                    | 333.513    | 269.495    | 269.495    | 750          | 102,816   | 0.2 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC        | 317.138    | 265.466    | 265.466    | 2,210        | 302,674   | 0.6 |
| WORKSPACE GROUP PLC              | 50.811     | 46.404     | 46.404     | 411          | 56,301    | 0.1 |
| INTU PROPERTIES PLC              | 372.244    | 295.875    | 295.875    | 224          | 30,711    | 0.1 |
| UNITE GROUP PLC                  | 111.92     | 92.217     | 92.217     | 891          | 122,114   | 0.3 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC    | 31.294     | 395.499    | 395.499    | 523          | 71,707    | 0.2 |
| SHAFTESBURY PLC                  | 103.012    | 80.557     | 80.557     | 659          | 90,292    | 0.2 |

| 銘柄                               | 期首(前期末)        |           | 当期             |         | 期末        |     |
|----------------------------------|----------------|-----------|----------------|---------|-----------|-----|
|                                  | □数             | 金額        | □数             | 金額      | 比率        | 比率  |
| (イギリス)                           | 千口             | 千円        | 千口             | 千円      |           | %   |
| SEGRO PLC                        | 425.024        | 379,728   | 2,820          | 386,255 |           | 0.8 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC       | 119.899        | 95,824    | 669            | 91,645  |           | 0.2 |
| ASSURA PLC                       | 1,013.326      | 854,448   | 541            | 74,183  |           | 0.2 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT  | 221.364        | 204,861   | 114            | 15,625  |           | 0.0 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD       | -              | 194,275   | 188            | 25,752  |           | 0.1 |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC            | 167.573        | 159.52    | 152            | 20,817  |           | 0.0 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD  | -              | 227,534   | 199            | 27,294  |           | 0.1 |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD           | 89.348         | 72,106    | 446            | 61,121  |           | 0.1 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC        | 295.326        | 251,418   | 506            | 69,409  |           | 0.1 |
| RDI REIT PLC                     | 528.881        | 77,641    | 80             | 10,972  |           | 0.0 |
| NEWRIVER REIT PLC                | 131.034        | 103,999   | 194            | 26,631  |           | 0.1 |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC       | 81.48          | 235.42    | 185            | 25,403  |           | 0.1 |
| AEW UK LONG LEASE REIT PLC       | 37.06          | -         | -              | -       |           | -   |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT | -              | 134,957   | 112            | 15,413  |           | 0.0 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC          | 626.95         | 598,461   | 921            | 126,208 |           | 0.3 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC     | 228.6          | 196,113   | 180            | 24,680  |           | 0.1 |
| LXI REIT PLC                     | 73.4           | 134,197   | 167            | 22,971  |           | 0.0 |
| REGIONAL REIT LTD                | 118.301        | 110,888   | 120            | 16,460  |           | 0.0 |
| 小計                               | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額        | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額      | 比率        | 比率  |
|                                  | 26銘柄<5.7%>     | 6,518,289 | 28銘柄<4.9%>     | 16,874  | 2,310,766 | 4.9 |
| (イスラエル)                          | 千口             | 千円        | 千口             | 千円      |           | %   |
| REIT 1 LTD                       | 70.287         | 63,655    | 1,128          | 33,530  |           | 0.1 |
| 小計                               | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額        | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額      | 比率        | 比率  |
|                                  | 1銘柄<0.1%>      | 70,287    | 1銘柄<0.1%>      | 1,128   | 33,530    | 0.1 |
| (韓国)                             | 千口             | 千円        | 千口             | 千円      |           | %   |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD        | -              | 9,316     | 63,255         | 5,870   |           | 0.0 |
| 小計                               | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額        | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額      | 比率        | 比率  |
|                                  | -銘柄<-%>        | -         | 1銘柄<0.0%>      | 63,255  | 5,870     | 0.0 |
| (ユーロ…アイルランド)                     | 千口             | 千円        | 千口             | 千円      |           | %   |
| GREEN REIT PLC                   | 293.629        | 240,878   | 422            | 51,646  |           | 0.1 |
| HIBERNIA REIT PLC                | 299.53         | 242.24    | 340            | 41,574  |           | 0.1 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI | 138.876        | 124,155   | 206            | 25,223  |           | 0.1 |
| 小計                               | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額        | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額      | 比率        | 比率  |
|                                  | 3銘柄<0.3%>      | 732,035   | 3銘柄<0.2%>      | 968     | 118,444   | 0.2 |
| (ユーロ…オランダ)                       | 千口             | 千円        | 千口             | 千円      |           | %   |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV     | 21.124         | 14,114    | 347            | 42,442  |           | 0.1 |
| VASTNED RETAIL                   | 6.794          | 6,326     | 175            | 21,420  |           | 0.0 |
| WERELDHAVE NV                    | 16.816         | 14,313    | 335            | 40,976  |           | 0.1 |
| NSI NV                           | 7.625          | 6,338     | 237            | 28,975  |           | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD        | 57.184         | 48.27     | 6,475          | 791,555 |           | 1.7 |
| 小計                               | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額        | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額      | 比率        | 比率  |
|                                  | 5銘柄<3.0%>      | 109,543   | 5銘柄<2.0%>      | 7,570   | 925,369   | 2.0 |
| (ユーロ…ベルギー)                       | 千口             | 千円        | 千口             | 千円      |           | %   |
| BEFIMMO                          | 9.8            | 7.94      | 409            | 50,082  |           | 0.1 |
| COFINIMMO SA                     | 8.205          | 7,418     | 830            | 101,558 |           | 0.2 |
| RETAIL ESTATES                   | 3.232          | 2,609     | 204            | 24,971  |           | 0.1 |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES     | 6.873          | 8,307     | 211            | 25,893  |           | 0.1 |
| WAREHOUSES DE PAUW               | 7.037          | 6,236     | 897            | 109,769 |           | 0.2 |
| MONTEA SCA                       | -              | 3,562     | 265            | 32,438  |           | 0.1 |
| AEDIFICA                         | 7.647          | 8,684     | 719            | 87,894  |           | 0.2 |
| COFINIMMO SA-RTS                 | 8.342          | -         | -              | -       |           | -   |
| 小計                               | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額        | □数・<br>銘柄数<比率> | 金額      | 比率        | 比率  |
|                                  | 7銘柄<0.7%>      | 51,136    | 7銘柄<0.9%>      | 3,539   | 432,609   | 0.9 |
| (ユーロ…フランス)                       | 千口             | 千円        | 千口             | 千円      |           | %   |
| GECINA SA                        | 20.261         | 19,268    | 2,605          | 318,439 |           | 0.7 |
| ICADE                            | 18.935         | 16,153    | 1,281          | 156,679 |           | 0.3 |
| ALTAREA                          | 1.518          | 1,209     | 217            | 26,631  |           | 0.1 |
| KLEPIERRE                        | 87.317         | 70.94     | 2,111          | 258,069 |           | 0.5 |
| COVIVIO                          | 22.663         | 21,906    | 2,018          | 246,758 |           | 0.5 |

| 銘柄                               | 柄                   | 期首(前期末) |              | 当期 |              |       | 末          |      |
|----------------------------------|---------------------|---------|--------------|----|--------------|-------|------------|------|
|                                  |                     | □       | 数            | □  | 数            | 外貨建金額 | 邦貨換算金額     | 比率   |
| (ユーロ…フランス)                       |                     |         | 千口           |    | 千口           | 千ユーロ  | 千円         | %    |
| MERCIALYS                        |                     |         | 22,547       |    | 18,406       | 210   | 25,739     | 0.1  |
| 小計                               | □ 数 金 額<br>柄 数<比 率> |         | 173,241      |    | 147,882      | 8,445 | 1,032,318  | —    |
|                                  |                     |         | 6銘柄<2.4%>    |    | 6銘柄<2.2%>    | —     | —          | 2.2  |
| (ユーロ…ドイツ)                        |                     |         | 千口           |    | 千口           | 千ユーロ  | 千円         | %    |
| HAMBORNER REIT AG                |                     |         | 33.143       |    | 27,782       | 247   | 30,292     | 0.1  |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG           |                     |         | 61.358       |    | 56,116       | 788   | 96,377     | 0.2  |
| 小計                               | □ 数 金 額<br>柄 数<比 率> |         | 94,501       |    | 83,898       | 1,036 | 126,670    | —    |
|                                  |                     |         | 2銘柄<0.3%>    |    | 2銘柄<0.3%>    | —     | —          | 0.3  |
| (ユーロ…スペイン)                       |                     |         | 千口           |    | 千口           | 千ユーロ  | 千円         | %    |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA  |                     |         | 136.98       |    | 97,764       | 999   | 122,135    | 0.3  |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA |                     |         | 39.724       |    | 25,183       | 172   | 21,117     | 0.0  |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS S |                     |         | 46.179       |    | —            | —     | —          | —    |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA      |                     |         | 140.114      |    | 127,901      | 1,580 | 193,243    | 0.4  |
| 小計                               | □ 数 金 額<br>柄 数<比 率> |         | 362,997      |    | 250,848      | 2,752 | 336,497    | —    |
|                                  |                     |         | 4銘柄<1.0%>    |    | 3銘柄<0.7%>    | —     | —          | 0.7  |
| (ユーロ…イタリア)                       |                     |         | 千口           |    | 千口           | 千ユーロ  | 千円         | %    |
| BENI STABILI SPA                 |                     |         | 437.76       |    | —            | —     | —          | —    |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE |                     |         | 20.03        |    | 15,915       | 94    | 11,555     | 0.0  |
| 小計                               | □ 数 金 額<br>柄 数<比 率> |         | 457.79       |    | 15,915       | 94    | 11,555     | —    |
|                                  |                     |         | 2銘柄<0.1%>    |    | 1銘柄<0.0%>    | —     | —          | 0.0  |
| 合計                               | □ 数 金 額<br>柄 数<比 率> |         | 525,734.8    |    | 44,555.511   | —     | 47,028,742 | —    |
|                                  |                     |         | 311銘柄<99.3%> |    | 303銘柄<99.2%> | —     | —          | 99.2 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## ■投資信託財産の構成

2019年6月24日現在

| 項 目           | 当期         |     | 末     |
|---------------|------------|-----|-------|
|               | 評 価 額      | 比 率 |       |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 千円         |     | %     |
|               | 47,028,742 |     | 99.2  |
| コール・ローン等、その他  | 382,171    |     | 0.8   |
| 投資信託財産総額      | 47,410,913 |     | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、47,359,422千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.42円、1カナダ・ドル=81.39円、1オーストラリア・ドル=74.72円、1香港・ドル=13.75円、1シンガポール・ドル=79.36円、1ニュージーランド・ドル=70.86円、1イギリス・ポンド=136.94円、1イスラエル・シケル=29.71円、100韓国・ウォン=9.28円、1ユーロ=122.24円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年6月24日)現在

| 項 目                        | 当 期 末           |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産                    | 47,623,950,891円 |
| コ ー ル ・ オ ー ン 等            | 133,244,022     |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)       | 5,083,074,363   |
| 投 資 証 券(評価額)               | 41,945,667,910  |
| 未 収 入 金                    | 361,567,209     |
| 未 収 配 当 金                  | 100,397,387     |
| (B) 負 債                    | 213,744,900     |
| 未 払 金                      | 213,036,900     |
| 未 払 解 約 金                  | 708,000         |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)       | 47,410,205,991  |
| 元 本                        | 36,301,672,788  |
| 次 期 繰 越 損 益 金              | 11,108,533,203  |
| (D) 受 益 権 総 口 数            | 36,301,672,788口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 13,060円         |

(注1) 期首元本額 44,369,434,317円  
 追加設定元本額 48,480,219,419円  
 一部解約元本額 56,547,980,948円

(注2) 期末における元本の内訳

|                                  |                |
|----------------------------------|----------------|
| 先進国REITインデックスF<為替ヘッジなし>(ファンドラップ) | 160,560,827円   |
| 先進国REITインデックスF<為替ヘッジあり>(ファンドラップ) | 93,381,433円    |
| MITOラップ型ファンド(安定型)                | 5,570,605円     |
| MITOラップ型ファンド(中立型)                | 14,365,615円    |
| MITOラップ型ファンド(積極型)                | 22,970,643円    |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型)             | 53,567,046円    |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型)             | 38,170,950円    |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型)             | 28,280,765円    |
| たわらノーロード 先進国リート                  | 3,920,685,465円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>           | 599,465,183円   |
| たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>         | 151,921,418円   |
| たわらノーロード バランス(8資産均等型)            | 326,595,821円   |
| たわらノーロード バランス(堅実型)               | 2,096,319円     |
| たわらノーロード バランス(標準型)               | 42,404,047円    |
| たわらノーロード バランス(積極型)               | 94,801,723円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)      | 17,099,439円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)    | 87,460,533円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)      | 76,847,691円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)      | 204,814,938円   |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型)            | 676,227円       |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)          | 2,026,563円     |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型)            | 1,696,987円     |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型)            | 5,195,023円     |
| マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)             | 19,026,187円    |
| マネックス資産設計ファンド(育成型)               | 520,077,807円   |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション           | 53,216,299円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)       | 175,540,190円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)       | 158,001,161円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)       | 310,814,217円   |
| 投資のソムリエ                          | 7,768,303,637円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>                    | 795,364,191円   |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>          | 135,937,313円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型              | 282,312,537円   |
| ダイナミック・ナビゲーション                   | 746,055円       |

|  |                 |
|--|-----------------|
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                       | 4,021,843,742円  |
| ワールドアセットバランス(基本コース)                      | 951,671,015円    |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)                   | 3,735,792,629円  |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)                   | 4,282,362円      |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)                   | 3,668,511円      |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)                   | 2,038,670円      |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)                   | 7,614,992円      |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                      | 673,546,769円    |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                     | 16,954,156円     |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)                   | 794,026円        |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)                   | 794,026円        |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)                   | 794,026円        |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド                         | 834,894,408円    |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>                | 40,270,163円     |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)          | 363,780,773円    |
| DIAMグローバルβ私募ファンド(適格機関投資家向け)              | 12,032,969円     |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)         | 3,432,240,792円  |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定) | 2,009,502,069円  |
| P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)            | 3,461,256,521円  |
| DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)           | 557,905,314円    |
| 期末元本合計                                   | 36,301,672,788円 |

## ■損益の状況

当期 自2018年6月23日 至2019年6月24日

| 項                        | 目   | 当 期             |
|--------------------------|-----|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益            | 金 当 | 2,193,044,685円  |
| 受 取 配 当                  |     | 2,191,595,379   |
| 受 取 利 息                  |     | 1,865,527       |
| 支 払 利 息                  |     | △416,221        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益      |     | 1,897,564,952   |
| 売 買 益                    |     | 7,074,533,912   |
| 売 買 損                    |     | △5,176,968,960  |
| (C) そ の 他 費 用            |     | △51,136,964     |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) |     | 4,039,472,673   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金        |     | 8,778,934,476   |
| (F) 解 約 差 損 益 金          |     | △12,880,878,527 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金      |     | 11,171,004,581  |
| (H) 合 計(D + E + F + G)   |     | 11,108,533,203  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)         |     | 11,108,533,203  |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。