

運用報告書 (全体版)

第9期<決算日2021年1月12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。
	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	海外の証券取引所に上場している株式 [®] を主要投資対象とします。 ※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	エマーシング債券パッシブ・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 [®] を主要投資対象とします。 ※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。 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。 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、2021年1月12日に第9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。

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/

<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

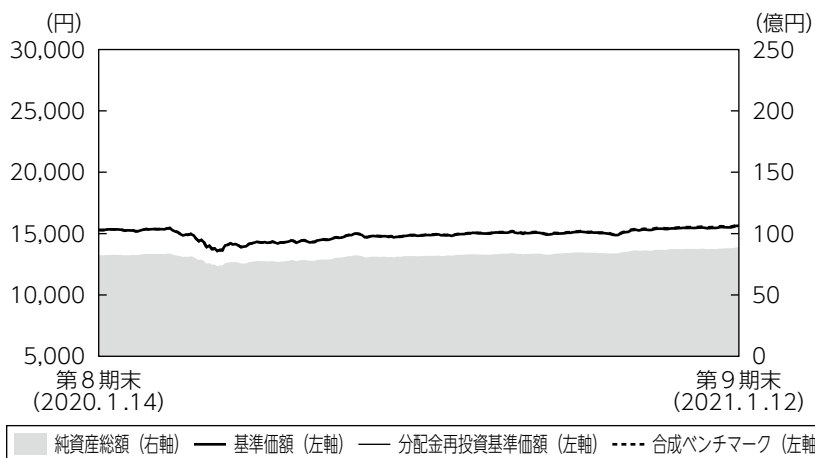
お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

■当期の運用経過（2020年1月15日から2021年1月12日まで）

DIAMDC 8資産バランスファンド（新興国10）

基準価額等の推移



第9期首：15,303円
 第9期末：15,646円
 （既払分配金0円）
 騰落率：2.2%
 （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

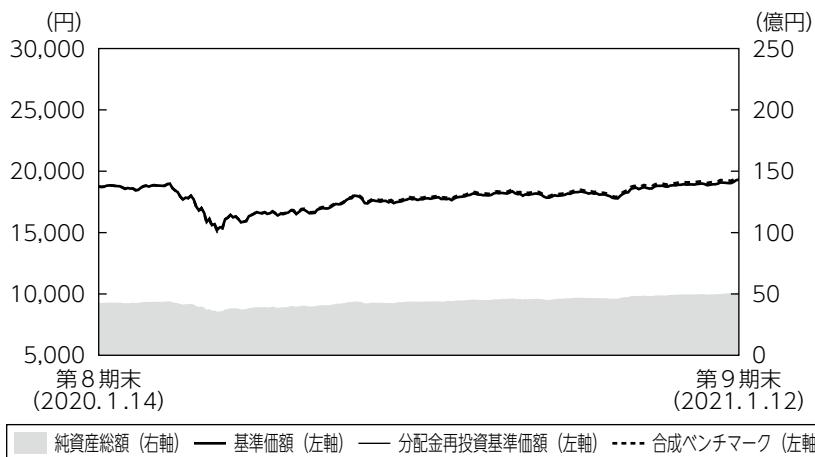
新型コロナウイルスの影響長期化や景気減速懸念等を背景に貸貸市況への影響が懸念され内外リート市場がマイナスに寄与しました。一方、世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、都市封鎖解除後の景気回復期待を好感した内外の株式市場の上昇、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場の上昇がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

◆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	9.3%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.1%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.3%
エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	10.8%
エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	△0.4%
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	△13.5%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△16.3%

DIAMDC 8資産バランスファンド（新興国20）

基準価額等の推移



- (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。

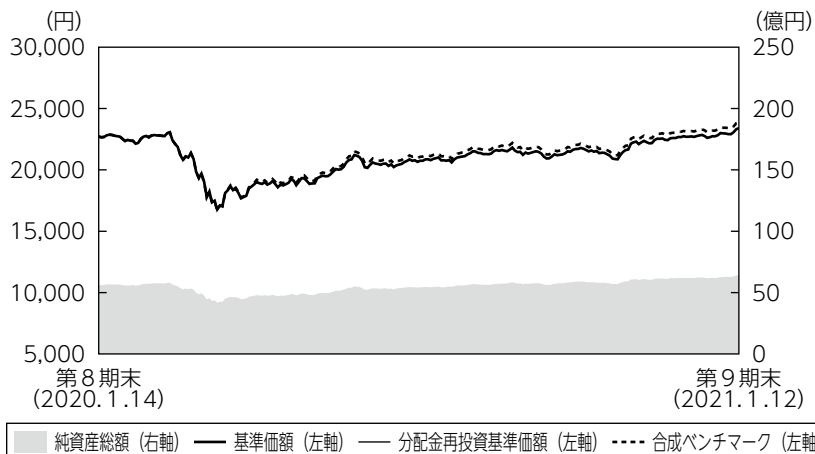
基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの影響長期化や景気減速懸念等を背景に貸貸市況への影響が懸念され内外リート市場がマイナスに寄与しました。一方、世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、都市封鎖解除後の景気回復期待を好感した内外の株式市場の上昇、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場の上昇がプラスに寄与し、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	9.3%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.1%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.3%
エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	10.8%
エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	△0.4%
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	△13.5%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△16.3%

DIAMDC 8資産バランスファンド（新興国30） 基準価額等の推移



第9期首：22,720円
 第9期末：23,400円
 (既払分配金0円)
 騰落率：3.0%
 (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

新型コロナウイルスの影響長期化や景気減速懸念等を背景に貸貸市況への影響が懸念され内外リート市場がマイナスに寄与しました。一方、世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、都市封鎖解除後の景気回復期待を好感した内外の株式市場の上昇、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場の上昇がプラスに寄与し、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	9.3%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.1%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.3%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	10.8%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	△0.4%
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	△13.5%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△16.3%

投資環境

国内株式市場は、期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスワクチンの開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2020年2月は新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり、利回りは低下したものの、3月はリスク性資産の価格の反発などを受けて利回りは上昇しました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月の下旬から期末にかけては国内株式市場が高水準で推移したことなどを受けて利回りは上昇しました。

先進国株式市場は上昇しました。米国市場は期初から堅調に推移していましたが、2020年2月下旬以降は世界的な新型コロナウイルスの感染拡大から急落しました。3月下旬以降、米景気対策法案への期待から反発し、その後も欧米における感染拡大から調整する場面もありましたが、経済活動正常化への期待感や新型コロナウイルスワクチン開発の進展などを受け底堅く推移しました。欧州市場は、急落後の反発力に欠ける市場もあり、前期末比では各国市場まちまちの値動きとなりました。

先進国債券市場では、米国債、および、ドイツ債の利回りはともに低下しました。米国債利回りは新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R B（米連邦準備理事会）による緊急利下げや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続の示唆により大幅に低下（価格は上昇）しました。足元では新型コロナウイルスのワクチンへの期待を受けて上昇しました。ドイツ債についてもE C B（欧州中央銀行）の追加金融緩和策により利回りが低下しました。

新興国株式市場は上昇しました。期初は中国における新型コロナウイルスの感染拡大を受け、軟調な展開となりました。さらに2020年2月下旬以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大により、長期的な景気低迷が意識され大幅に下落しました。その後も、米中の対立激化やインド、ブラジルなどにおける新型コロナウイルスの感染拡大が意識され調整する場面も見られましたが、いち早くプラス成長に転じた中国の景気拡大期待や新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などから堅調に推移しました。

新興国債券市場は上昇しました。2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大による経済悪化懸念や原油価格の急落などを背景に、市場は大幅に下落しました。その後は、欧米での経済活動再開に伴う景気回復期待や、新型コロナウイルスのワクチン接種への期待感、米国大統領選挙でバイデン氏が勝利したことなどから大幅に上昇しました。期末にかけては新型コロナウイルスの感染再拡大を受けてやや弱含みました。米国長期金利は大幅に低下し、対米国債スプレッド（利回り格差）は拡大しました。

国内リート市場は下落しました。新型コロナウイルスの感染拡大が世界的な規模となり、経済の長期的な停滞懸念によって2020年2月下旬から3月中旬にかけて大幅な下落となりました。その後は新型コロナウイルスのワクチン開発への期待を背景に緩やかに値を戻す展開となり、期末にかけては国内感染者数が再び増加したものの、欧米でのワクチン接種開始や米国の追加経済対策決定などが相場を支えました。

外国リート市場は下落しました。各国リート市場は期初に上昇傾向で推移していましたが、2020年2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大懸念により大幅に下落しました。期の半ばにかけて米国リート市場と豪州リート市場が徐々に下げ幅を縮小した一方で、欧州リート市場は一進一退の動きとなりました。期末にかけては経済活動再開への期待や新型コロナウイルスのワクチンの治験で有望な結果が示されたことから上昇する局面がありましたが、いずれの市場も前期末比では下落となりました。

為替市場では主要通貨に対してまちまちな動きとなりました。ドル/円相場は、2020年2月から3月にかけて新型コロナウイルスの感染拡大を受けたリスク回避の動きや世界的なドル需要の高まりが交錯し相場が変動した後、米中対立の警戒や金融緩和の長期化観測、先々の景気不透明感等から円高ドル安の動きとなりました。ユーロ/円相場については復興基金設立への期待等により5月以降は円安ユーロ高の動きとなりました。その他の通貨については概ね期初との比較では円高となりました。

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>

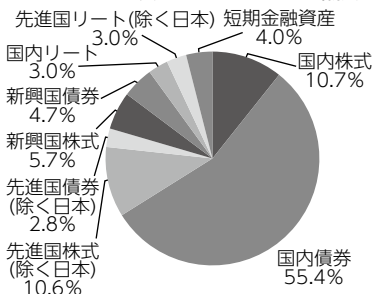
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）：国内株式10%、国内債券57%、先進国株式（除く日本）10%、先進国債券（除く日本）3%、新興国株式5%、新興国債券5%、国内リート3%、先進国リート（除く日本）3%、短期金融資産4%

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%

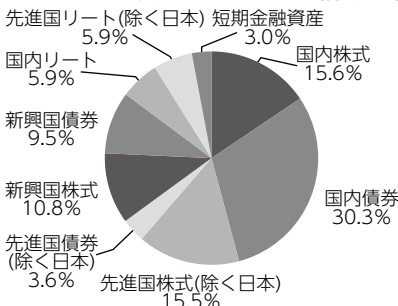
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）：国内株式20%、国内債券5%、先進国株式（除く日本）20%、先進国債券（除く日本）5%、新興国株式15%、新興国債券15%、国内リート9%、先進国リート（除く日本）9%、短期金融資産2%

決算日（2021年1月12日）現在の組入比率

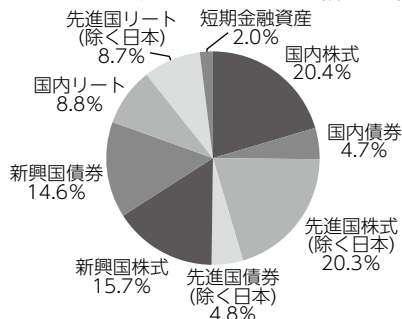
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）



DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）



DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）



●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NOMUR A-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

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しました。

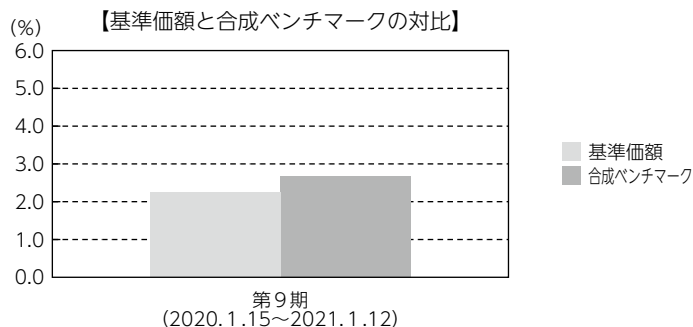
●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

DIAMDC 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2.7%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0.4%下回りました。信託報酬の要因を除くと、合成ベンチマークにほぼ連動した運用結果となりました。



(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
	2020年1月15日 ～2021年1月12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	5,646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。

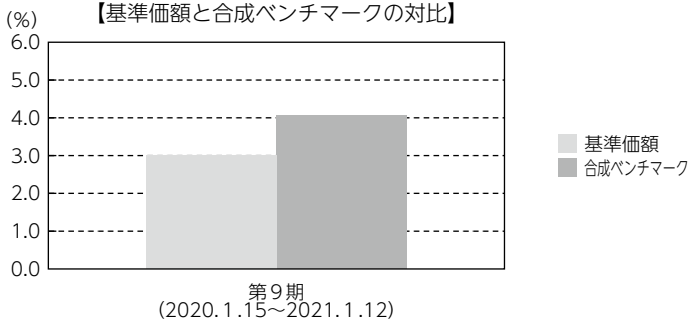
(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(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。

DIAMDC 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4.1%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1.1%下回りました。信託報酬の要因を除くと、2020年2月～4月にかけてマーケット変動が大きくなる中、時価ぶれによりポートフォリオと基本資産配分比率との間に乖離が生じ、資産配分効果が比較的大きくなったためベンチマークとの乖離が生じました。



(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
	2020年1月15日 ～2021年1月12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	9,321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。

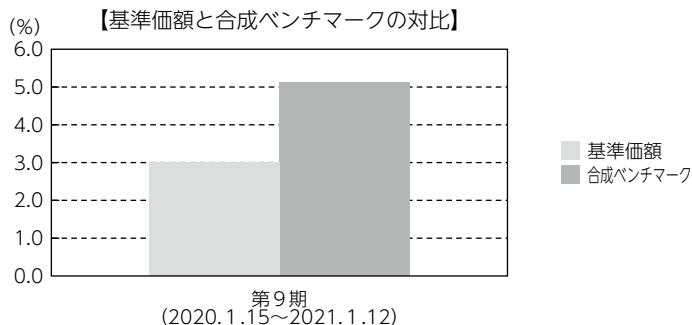
(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(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。

DIAMDC 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5.1%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2.1%下回りました。信託報酬の要因を除くと、2020年2月～4月にかけてマーケット変動が大きくなる中、時価ぶれによりポートフォリオと基本資産配分比率との間に乖離が生じ、資産配分効果が比較的大きくなったためベンチマークとの乖離が生じました。



(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
	2020年1月15日 ～2021年1月12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	13,400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パッシブ運用を行います。

●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した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。

■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&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズ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			合ベンチマーク		株式組入率 比	株式先物率 比	債券組入率 比	新株予約権付社債 (転換社債)率 比	債券先物率 比	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額
	(分配) 円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %	ポイント	期中 騰落率 %							
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	百万円 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
9期(2021年1月12日)	15,646	0	2.2	16,320.35	2.7	25.6	1.2	62.2	-	-	6.2	8,888

(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		合ベンチマーク		株式組入率 比	株式先物率 比	債券組入率 比	新株予約権付社債 (転換社債)率 比	債券先物率 比	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
	円	騰落率 %	ポイント	騰落率 %						
(期首) 2020年1月14日	15,303	-	15,894.85	-	24.3	1.5	61.9	-	-	6.2
1月末	15,254	△0.3	15,854.81	△0.3	23.7	1.2	64.0	-	-	6.3
2月末	14,960	△2.2	15,546.22	△2.2	22.3	1.2	66.4	-	-	5.9
3月末	14,141	△7.6	14,676.95	△7.7	24.0	2.5	66.3	-	-	6.0
4月末	14,429	△5.7	14,999.40	△5.6	24.6	1.7	63.4	-	-	5.9
5月末	14,654	△4.2	15,249.82	△4.1	24.3	1.6	62.8	-	-	5.9
6月末	14,728	△3.8	15,333.23	△3.5	23.9	1.4	64.3	-	-	5.9
7月末	14,811	△3.2	15,414.45	△3.0	23.8	1.2	64.6	-	-	6.0
8月末	15,076	△1.5	15,702.33	△1.2	23.7	2.3	63.9	-	-	6.1
9月末	14,995	△2.0	15,622.97	△1.7	24.1	1.2	64.4	-	-	5.9
10月末	14,875	△2.8	15,497.90	△2.5	23.5	1.1	64.3	-	-	5.9
11月末	15,368	0.4	16,029.27	0.8	25.1	1.3	63.6	-	-	6.3
12月末	15,522	1.4	16,195.61	1.9	25.1	1.2	62.8	-	-	6.3
(期末) 2021年1月12日	15,646	2.2	16,320.35	2.7	25.6	1.2	62.2	-	-	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9期		項目の概要
	(2020年1月15日 ～2021年1月12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 期中の平均基準価額は14,916円です。 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
(投信会社)	(25)	(0.170)	
(販売会社)	(20)	(0.137)	
(受託会社)	(6)	(0.038)	
(b) 売買委託手数料	2	0.011	(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 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)	(0.008)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(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	2	0.017	(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 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(2)	(0.014)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.003)	
(d) その他費用	3	0.023	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(2)	(0.013)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(1)	(0.007)	
合計	59	0.395	

(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。

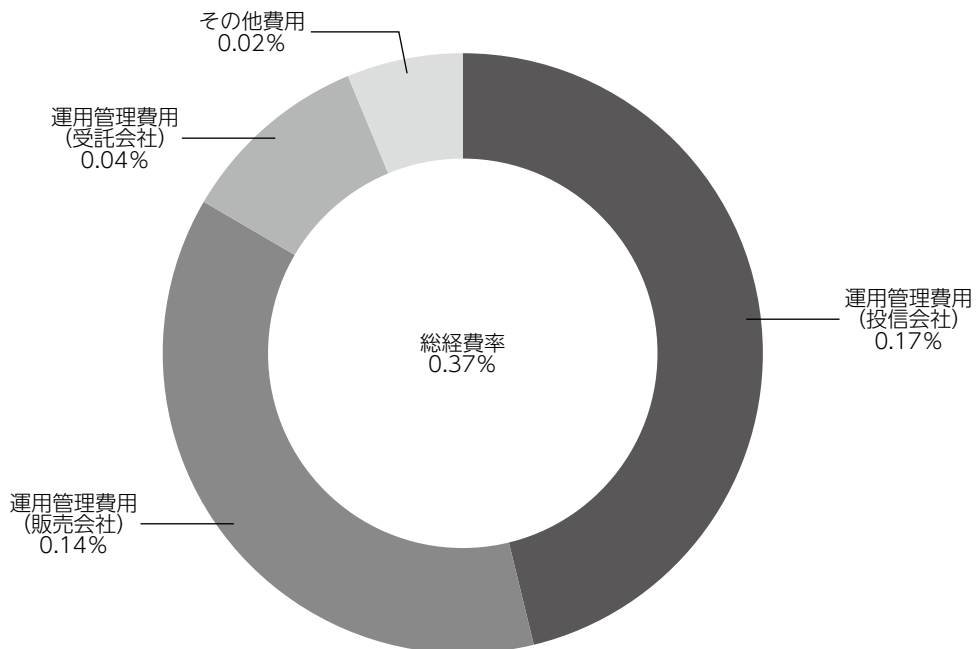
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.37%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（2020年1月15日から2021年1月12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 (最適化法)・マザーファンド	50,259	107,847	41,172	108,507
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	507,611	665,370	251,186	331,969
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	49,917	152,551	51,400	199,331
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	75	148	—	—
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	47,718	43,161	41,235	49,381
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	5,804	11,942	208	454
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	26,956	46,346	—	—
外国リート・パッシブ・ファンド・ マザーファンド	51,945	51,072	—	—

■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・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド	エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	230,888,079千円	134,614,137千円	132,326,522千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	233,300,427千円	339,772,854千円	39,810,556千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.98	0.39	3.32

(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（2020年1月15日から2021年1月12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)	920千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.715千円
(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 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 126,542	百万円 172	% 0.1	百万円 104,345	百万円 1,074	% 1.0

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 1,066	百万円 857	百万円 2,383

(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 250

【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 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 178,168	百万円 3,974	% 2.2	百万円 137,578	百万円 11,587	% 8.4

平均保有割合 2.0%

(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 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 65,395	百万円 1,113	% 1.7	百万円 38,980	百万円 -	% -

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 1,348

【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、みずほリソース、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	306,668	315,755	951,275
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	3,511,003	3,767,427	4,923,651
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	210,547	209,064	944,889
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	125,271	125,346	249,415
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	350,917	357,400	508,008
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	196,542	202,138	421,720
J-R E I Tインデックスファンド ・マザーファンド	103,553	130,509	268,066
外国リート・パッシブ・ファンド ・マザーファンド	177,352	229,297	268,989

■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	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	951,275	10.7
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,923,651	55.3
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	944,889	10.6
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	249,415	2.8
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	508,008	5.7
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	421,720	4.7
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	268,066	3.0
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	268,989	3.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	370,182	4.2
投 資 信 託 財 産 総 額	8,906,199	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、2021年1月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは433,816,338千円、99.9％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは133,684,067千円、99.8％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは91,433,604千円、99.7％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは142,754,358千円、99.5％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは53,511,410千円、93.6％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、2021年1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1香港・ドル=13.44円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニューージーランド・ドル=74.76円、1台湾・ドル=3.72円、1イギリス・ポンド=140.94円、1イスラエル・シケル=32.85円、1スイス・フラン=117.09円、1トルコ・リラ=13.94円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローナ=12.56円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1フィリピン・ペソ=2.17円、100チリ・ペソ=14.45円、100コロンビア・ペソ=2.97円、1クウェート・ディナール=343.88円、1カタール・リアル=28.57円、1サウジアラビア・リアル=27.83円、1インド・ルピー=1.43円、1パキスタン・ルピー=0.65円、100インドネシア・ルピア=0.74円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=28.42円、1ブラジル・レアル=18.93円、1チェコ・コルナ=4.83円、100韓国・ウォン=9.50円、1オフショア・人民元=16.10円、1マレーシア・リンギット=25.70円、1南アフリカ・ランド=6.71円、1タイ・バーツ=3.45円、1ポーランド・ズロチ=27.99円、100ハンガリー・フォリント=35.06円、1ユーロ=126.73円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,906,199,390円
コール・ローン等	369,911,186
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド(評価額)	951,275,398
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	4,923,651,504
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	944,889,726
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	249,415,018
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド(評価額)	508,008,888
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド(評価額)	421,720,688
J-R E I Tインデックスファンド・ マザーファンド(評価額)	268,066,745
外国リート・パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	268,989,237
未 収 入 金	271,000
(B) 負 債	17,524,614
未 払 解 約 金	2,764,562
未 払 信 託 報 酬	14,594,234
そ の 他 未 払 費 用	165,818
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,888,674,776
元 本	5,681,101,387
次 期 繰 越 損 益 金	3,207,573,389
(D) 受 益 権 総 口 数	5,681,101,387口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	15,646円

(注) 期首における元本額は5,387,975,800円、当中における追加設定元本額は779,738,086円、同解約元本額は486,612,499円です。

■損益の状況

当期 自2020年1月15日 至2021年1月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△138,449円
受 取 利 息	5,816
支 払 利 息	△144,265
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	252,083,079
売 買 益	344,304,061
売 買 損	△92,220,982
(C) 信 託 報 酬 等	△28,677,210
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	223,267,420
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	446,418,825
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,537,887,144
(配 当 等 相 当 額)	(1,918,661,474)
(売 買 損 益 相 当 額)	(619,225,670)
(G) 合 計(D+E+F)	3,207,573,389
次 期 繰 越 損 益 金(G)	3,207,573,389
追 加 信 託 差 損 益 金	2,537,887,144
(配 当 等 相 当 額)	(1,919,342,891)
(売 買 損 益 相 当 額)	(618,544,253)
分 配 準 備 積 立 金	669,686,245

(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	106,941,033円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	116,326,387
(c) 収 益 調 整 金	2,537,887,144
(d) 分 配 準 備 積 立 金	446,418,825
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3,207,573,389
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	5,646.04
(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			合ベンチマーク		株式組入率	株式先物率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)率	債券先物率	投資信託受益証券・投資証券組入率	純資産額
	(分配)	税込み分配金	期中騰落率	ポイント	期中騰落率							
5期(2017年1月11日)	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%	百万円
	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
9期(2021年1月12日)	19,322	0	3.0	20,577.20	4.1	39.4	2.1	42.7	-	-	12.0	5,107

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

(注2) 株式組入率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物率は、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		合ベンチマーク		株式組入率	株式先物率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)率	債券先物率	投資信託受益証券・投資証券組入率
	騰落率	騰落率	ポイント	騰落率						
(期首) 2020年1月14日	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%
	18,760	-	19,775.39	-	37.3	2.7	43.1	-	-	12.2
1月末	18,588	△0.9	19,601.67	△0.9	37.3	2.1	44.5	-	-	12.4
2月末	17,924	△4.5	18,892.03	△4.5	35.9	2.2	45.8	-	-	11.8
3月末	16,313	△13.0	17,188.19	△13.1	37.3	4.7	47.5	-	-	11.8
4月末	16,816	△10.4	17,773.88	△10.1	38.1	3.0	43.7	-	-	11.8
5月末	17,301	△7.8	18,326.62	△7.3	37.1	2.8	43.4	-	-	12.0
6月末	17,484	△6.8	18,558.72	△6.2	38.0	2.6	44.0	-	-	11.9
7月末	17,639	△6.0	18,704.93	△5.4	37.8	2.1	44.5	-	-	12.1
8月末	18,204	△3.0	19,333.40	△2.2	37.0	4.0	44.0	-	-	12.0
9月末	17,996	△4.1	19,112.06	△3.4	37.9	2.1	44.4	-	-	12.0
10月末	17,791	△5.2	18,887.74	△4.5	37.4	1.9	43.9	-	-	12.0
11月末	18,755	△0.0	19,958.42	0.9	39.3	2.3	43.4	-	-	12.4
12月末	19,068	1.6	20,307.75	2.7	39.1	2.1	42.9	-	-	12.4
(期末) 2021年1月12日	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%
	19,322	3.0	20,577.20	4.1	39.4	2.1	42.7	-	-	12.0

(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、「株式組入率」、「株式先物率」、「債券組入率」、「新株予約権付社債(転換社債)率」、「債券先物率」、「投資信託受益証券・投資証券組入率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物率は、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9期		項目の概要
	(2020年1月15日 ～2021年1月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	67円	0.377%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は17,862円です。 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
(投信会社)	(33)	(0.186)	
(販売会社)	(27)	(0.153)	
(受託会社)	(7)	(0.038)	
(b) 売買委託手数料	4	0.021	(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 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)	(0.015)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	6	0.032	(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 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)	(5)	(0.026)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(1)	(0.005)	
(d) その他費用	7	0.040	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(4)	(0.025)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(2)	(0.012)	
合計	84	0.471	

(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。

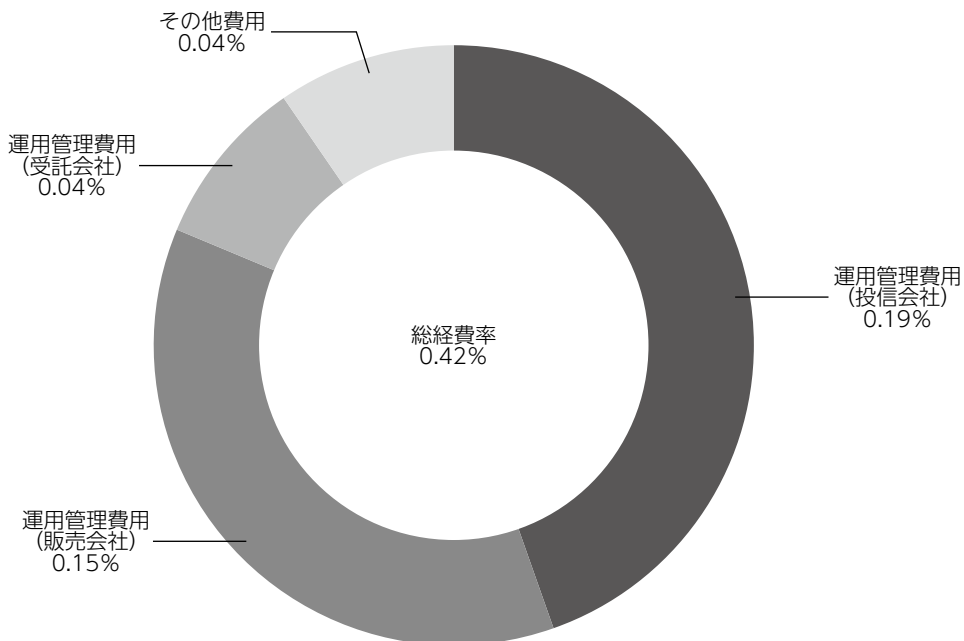
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.42%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（2020年1月15日から2021年1月12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 (最適化法)・マザーファンド	36,547	85,011	6,585	16,938
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	303,924	398,125	112,413	148,602
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	29,791	97,537	13,218	52,727
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	3,689	7,258	101	195
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	68,398	68,843	26,358	33,387
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	27,829	57,586	1,613	3,458
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	41,097	72,383	-	-
外国リート・パッシブ・ファンド・ マザーファンド	74,217	74,304	427	503

■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・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド	エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	230,888,079千円	134,614,137千円	132,326,522千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	233,300,427千円	339,772,854千円	39,810,556千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.98	0.39	3.32

(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（2020年1月15日から2021年1月12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)	944千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.57千円
(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 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 126,542	百万円 172	% 0.1	百万円 104,345	百万円 1,074	% 1.0

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 1,066	百万円 857	百万円 2,383

(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 250

【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 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 178,168	百万円 3,974	% 2.2	百万円 137,578	百万円 11,587	% 8.4

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。

【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 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 65,395	百万円 1,113	% 1.7	百万円 38,980	百万円 -	% -

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 1,348

【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	234,064	264,026	795,432
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	990,847	1,182,359	1,545,225
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	158,784	175,357	792,545
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	89,318	92,906	184,864
エマージング株式パッシブ ・マザーファンド	344,598	386,638	549,568
エマージング債券パッシブ ・マザーファンド	205,341	231,556	483,096
J-R E I Tインデックスファンド ・マザーファンド	105,960	147,057	302,056
外国リート ・パッシブ ・ファンド ・マザーファンド	184,756	258,547	303,301

■投資信託財産の構成

2021年1月12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	795,432	15.5
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,545,225	30.2
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	792,545	15.5
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	184,864	3.6
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	549,568	10.7
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	483,096	9.4
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	302,056	5.9
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	303,301	5.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	168,415	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	5,124,507	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、2021年1月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは433,816,338千円、99.9％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは133,684,067千円、99.8％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは91,433,604千円、99.7％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは142,754,358千円、99.5％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは53,511,410千円、93.6％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、2021年1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1香港・ドル=13.44円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニューージーランド・ドル=74.76円、1台湾・ドル=3.72円、1イギリス・ポンド=140.94円、1イスラエル・シユケル=32.85円、1スイス・フラン=117.09円、1トルコ・リラ=13.94円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローナ=12.56円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1フィリピン・ペソ=2.17円、100チリ・ペソ=14.45円、100コロンビア・ペソ=2.97円、1クウェート・ディナール=343.88円、1カタール・リアル=28.57円、1サウジアラビア・リアル=27.83円、1インド・ルピー=1.43円、1パキスタン・ルピー=0.65円、100インドネシア・ルピア=0.74円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=28.42円、1ブラジル・レアル=18.93円、1チェコ・コルナ=4.83円、100韓国・ウォン=9.50円、1オフショア・人民元=16.10円、1マレーシア・リンギット=25.70円、1南アフリカ・ランド=6.71円、1タイ・バーツ=3.45円、1ポーランド・ズロチ=27.99円、100ハンガリー・フォリント=35.06円、1ユーロ=126.73円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,124,507,003円
コール・ローン等	166,404,691
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド(評価額)	795,432,389
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	1,545,225,612
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	792,545,865
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	184,864,539
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド(評価額)	549,568,262
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド(評価額)	483,096,820
J-R E I Tインデックスファンド・ マザーファンド(評価額)	302,056,135
外国リート・パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	303,301,690
未 収 入 金	2,011,000
(B) 負 債	17,145,784
未 払 解 約 金	8,202,039
未 払 信 託 報 酬	8,851,954
そ の 他 未 払 費 用	91,791
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,107,361,219
元 本	2,643,311,943
次 期 繰 越 損 益 金	2,464,049,276
(D) 受 益 権 総 口 数	2,643,311,943口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	19,322円

(注) 期首における元本額は2,280,592,387円、当期中における追加設定元本額は637,017,771円、同解約元本額は274,298,215円です。

■損益の状況

当期 自2020年1月15日 至2021年1月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△56,013円
受 取 利 息	3,081
支 払 利 息	△59,094
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	221,554,908
売 買 益	285,501,011
売 買 損	△63,946,103
(C) 信 託 報 酬 等	△16,794,983
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	204,703,912
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	399,053,715
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,860,291,649
(配 当 等 相 当 額)	(1,436,391,183)
(売 買 損 益 相 当 額)	(423,900,466)
(G) 合 計(D+E+F)	2,464,049,276
次 期 繰 越 損 益 金(G)	2,464,049,276
追 加 信 託 差 損 益 金	1,860,291,649
(配 当 等 相 当 額)	(1,437,367,745)
(売 買 損 益 相 当 額)	(422,923,904)
分 配 準 備 積 立 金	603,757,627

(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	82,228,566円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	122,475,346
(c) 収 益 調 整 金	1,860,291,649
(d) 分 配 準 備 積 立 金	399,053,715
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,464,049,276
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	9,321.83
(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			合ベンチマーク		株式組入率	株式先物率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物率	投資信託受益証券・投資証券組入比率	純資産額
	(分配)円	税込み分配金円	期中騰落率%	ポイント	期中騰落率%							
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	百万円 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
9期(2021年1月12日)	23,400	0	3.0	25,635.88	5.1	53.1	3.0	23.6	—	—	17.7	6,419

(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		合ベンチマーク		株式組入率	株式先物率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物率	投資信託受益証券・投資証券組入比率
	円	騰落率%	ポイント	騰落率%						
(期首) 2020年1月14日	22,720	—	24,389.27	—	50.8	4.0	23.9	—	—	18.1
1月末	22,370	△1.5	24,022.60	△1.5	51.1	3.0	24.6	—	—	18.6
2月末	21,201	△6.7	22,751.55	△6.7	49.6	3.2	24.8	—	—	18.0
3月末	18,462	△18.7	19,911.57	△18.4	50.2	6.9	29.5	—	—	17.2
4月末	19,216	△15.4	20,826.85	△14.6	51.4	4.2	25.1	—	—	16.9
5月末	20,022	△11.9	21,775.07	△10.7	49.8	4.0	24.6	—	—	17.5
6月末	20,368	△10.4	22,204.17	△9.0	51.2	3.7	24.6	—	—	17.9
7月末	20,610	△9.3	22,435.48	△8.0	51.5	3.0	24.5	—	—	18.5
8月末	21,562	△5.1	23,527.75	△3.5	50.0	5.5	24.1	—	—	18.2
9月末	21,192	△6.7	23,107.08	△5.3	52.0	3.0	24.3	—	—	18.0
10月末	20,877	△8.1	22,748.96	△6.7	51.4	2.8	23.2	—	—	18.0
11月末	22,448	△1.2	24,556.11	0.7	53.1	3.2	24.2	—	—	18.2
12月末	22,974	1.1	25,161.60	3.2	52.8	2.9	23.5	—	—	18.4
(期末) 2021年1月12日	23,400	3.0	25,635.88	5.1	53.1	3.0	23.6	—	—	17.7

(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9期		項目の概要
	(2020年1月15日 ～2021年1月12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 期中の平均基準価額は21,017円です。 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
(投信会社)	(43)	(0.202)	
(販売会社)	(36)	(0.170)	
(受託会社)	(8)	(0.038)	
(b) 売買委託手数料	7	0.031	(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 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)	(5)	(0.022)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(1)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	10	0.047	(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 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)	(8)	(0.038)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(2)	(0.008)	
(d) その他費用	12	0.056	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(8)	(0.036)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(3)	(0.016)	
合計	114	0.545	

(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。

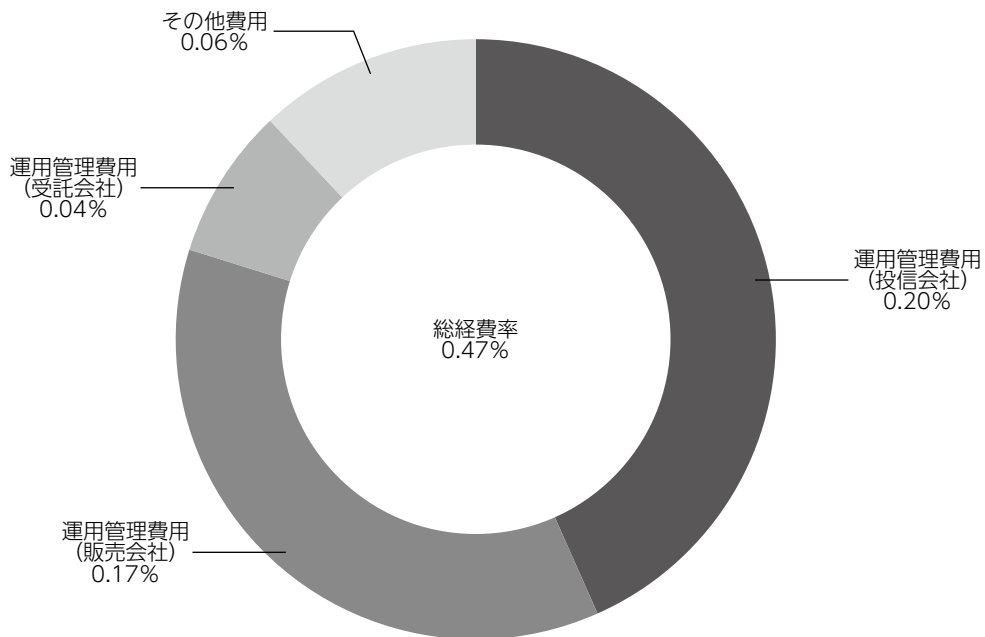
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.47%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（2020年1月15日から2021年1月12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 (最適化法)・マザーファンド	52,657	133,933	22,214	56,947
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	38,262	50,092	11,757	15,571
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	28,213	103,470	16,526	67,615
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	17,932	35,399	8,492	16,313
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	109,950	117,013	79,229	96,594
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	78,414	162,929	28,803	59,951
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	69,794	130,109	1,726	4,227
外国リート・パッシブ・ファンド・ マザーファンド	129,546	134,133	13,499	16,405

■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・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド	エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	230,888,079千円	134,614,137千円	132,326,522千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	233,300,427千円	339,772,854千円	39,810,556千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.98	0.39	3.32

(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（2020年1月15日から2021年1月12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)	1,725千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.931千円
(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 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 126,542	百万円 172	% 0.1	百万円 104,345	百万円 1,074	% 1.0

平均保有割合 0.5%

(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 1,066	百万円 857	百万円 2,383

(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 250

【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 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 178,168	百万円 3,974	% 2.2	百万円 137,578	百万円 11,587	% 8.4

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 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 65,395	百万円 1,113	% 1.7	百万円 38,980	百万円 -	% -

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 1,348

【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、みずほリソース、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	404,786	435,230	1,311,218
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	206,249	232,754	304,186
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	276,422	288,109	1,302,139
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	144,218	153,658	305,748
エマージング株式パッシブ ・マザーファンド	679,488	710,209	1,009,492
エマージング債券パッシブ ・マザーファンド	398,187	447,798	934,242
J-R E I Tインデックスファンド ・マザーファンド	207,630	275,698	566,285
外国リート ・パッシブ ・ファンド ・マザーファンド	361,025	477,072	559,654

■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	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	1,311,218	20.3
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	304,186	4.7
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,302,139	20.2
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	305,748	4.7
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,009,492	15.7
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	934,242	14.5
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	566,285	8.8
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	559,654	8.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	151,512	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	6,444,481	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、2021年1月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは433,816,338千円、99.9％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは133,684,067千円、99.8％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは91,433,604千円、99.7％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは142,754,358千円、99.5％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは53,511,410千円、93.6％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、2021年1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1香港・ドル=13.44円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニューージーランド・ドル=74.76円、1台湾・ドル=3.72円、1イギリス・ポンド=140.94円、1イスラエル・シケル=32.85円、1スイス・フラン=117.09円、1トルコ・リラ=13.94円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローナ=12.56円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1フィリピン・ペソ=2.17円、100チリ・ペソ=14.45円、100コロンビア・ペソ=2.97円、1クウェート・ディナール=343.88円、1カタール・リアル=28.57円、1サウジアラビア・リアル=27.83円、1インド・ルピー=1.43円、1パキスタン・ルピー=0.65円、100インドネシア・ルピア=0.74円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=28.42円、1ブラジル・レアル=18.93円、1チェコ・コルナ=4.83円、100韓国・ウォン=9.50円、1オフショア・人民元=16.10円、1マレーシア・リンギット=25.70円、1南アフリカ・ランド=6.71円、1タイ・バーツ=3.45円、1ポーランド・ズロチ=27.99円、100ハンガリー・フォリント=35.06円、1ユーロ=126.73円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	6,444,481,099円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	151,512,792
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド(評価額)	1,311,218,644
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	304,186,572
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	1,302,139,741
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	305,748,909
エマーシング株式パッシブ・ マザーファンド(評価額)	1,009,492,189
エマーシング債券パッシブ・ マザーファンド(評価額)	934,242,448
J-R E I Tインデックスファンド・ マザーファンド(評価額)	566,285,495
外国リート・パッシブ・ファンド・ マザーファンド(評価額)	559,654,309
(B) 負 債	24,687,492
未 払 解 約 金	12,550,997
未 払 信 託 報 酬	12,021,797
そ の 他 未 払 費 用	114,698
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	6,419,793,607
元 本	2,743,480,456
次 期 繰 越 損 益 金	3,676,313,151
(D) 受 益 権 総 口 数	2,743,480,456口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	23,400円

(注) 期首における元本額は2,469,566,123円、当期中における追加
設定元本額は872,226,324円、同解約元本額は598,311,991
円です。

■損益の状況

当期 自2020年1月15日 至2021年1月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△48,350円
受 取 利 息	5,460
支 払 利 息	△53,810
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	347,417,102
売 買 益	482,630,882
売 買 損	△135,213,780
(C) 信 託 報 酬 等	△22,790,478
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	324,578,274
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	589,217,319
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,762,517,558
(配 当 等 相 当 額)	(2,120,663,914)
(売 買 損 益 相 当 額)	(641,853,644)
(G) 合 計(D+E+F)	3,676,313,151
次 期 繰 越 損 益 金(G)	3,676,313,151
追 加 信 託 差 損 益 金	2,762,517,558
(配 当 等 相 当 額)	(2,122,638,142)
(売 買 損 益 相 当 額)	(639,879,416)
分 配 準 備 積 立 金	913,795,593

(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	132,327,505円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	192,250,769
(c) 収 益 調 整 金	2,762,517,558
(d) 分 配 準 備 積 立 金	589,217,319
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3,676,313,151
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	13,400.18
(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18期（決算日 2020年2月7日）

（計算期間 2019年2月8日～2020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18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 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰	期中 落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 落率			
14期 (2016年2月8日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760

(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（㈱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、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱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、㈱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）。

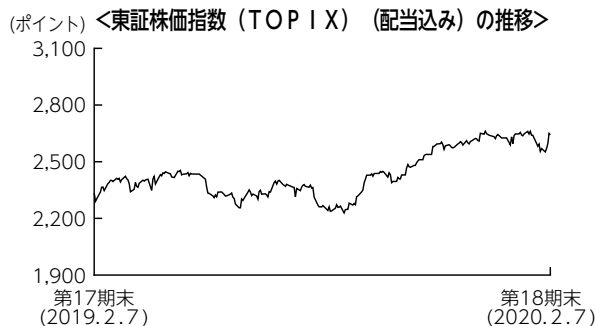
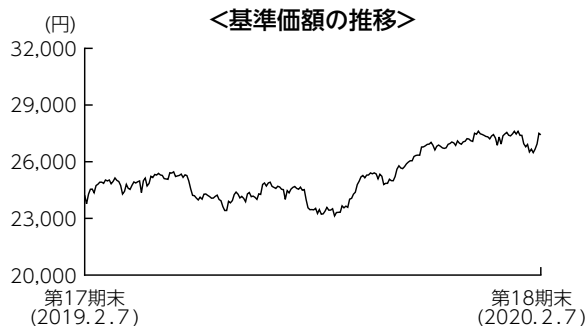
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物比率
	円	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク) ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2019年 2月7日	24,228	% -	2,334.81	% -	% 98.5	% 1.5
2月 末	24,833	2.5	2,393.08	2.5	97.7	2.3
3月 末	24,854	2.6	2,395.21	2.6	97.1	2.9
4月 末	25,266	4.3	2,434.82	4.3	97.4	2.3
5月 末	23,624	△2.5	2,275.96	△2.5	97.8	2.2
6月 末	24,269	0.2	2,338.89	0.2	97.7	1.9
7月 末	24,491	1.1	2,360.18	1.1	98.9	0.8
8月 末	23,664	△2.3	2,280.58	△2.3	97.9	1.8
9月 末	25,094	3.6	2,418.29	3.6	96.9	3.1
10月 末	26,349	8.8	2,539.02	8.7	97.3	2.6
11月 末	26,861	10.9	2,588.40	10.9	97.7	2.3
12月 末	27,250	12.5	2,625.91	12.5	97.8	1.9
2020年 1月 末	26,665	10.1	2,569.77	10.1	97.2	2.8
(期 末) 2020年 2月7日	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4

(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（2019年2月8日から2020年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は27,423円となり、前期末比で13.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米中貿易協議の状況次第の相場展開となりましたが、期末にかけては貿易協議が再開し、第1段階の合意に達したことが好感され、国内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

国内株式市場は、期初から2019年4月までは、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2020年1月前半までは、欧米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が好感され、上昇しました。期末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大が嫌気され、下落する局面がありました。

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	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



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	14.2%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.4
4	化学	6.9
5	医薬品	6.1
6	銀行業	5.5
7	サービス業	5.1
8	機械	5.0
9	卸売業	4.9
10	小売業	4.4

○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	3.2%
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	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.5%
2	ソニー	日本・円	2.0
3	ソフトバンクグループ	日本・円	1.6
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.6
5	武田薬品工業	日本・円	1.5
6	日本電信電話	日本・円	1.5
7	キーエンス	日本・円	1.4
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.2
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.1
10	KDDI	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,151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13.2%上昇しました。
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 (株 式)	0円 (0)	0.002% (0.000)
(先物・オプション)	(0)	(0.002)
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(25,270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 (2019年2月8日から2020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
		29,008.8 (2,820.619)	54,443,054 (-)	46,738.519	91,420,458

(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 106,543	百万円 104,700	百万円 -	百万円 -

(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	145,863,512千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	254,160,767千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.57

(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2月8日から2020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 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 54,443	百万円 24	% 0.0	百万円 91,420	百万円 5,933	% 6.5

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 497	百万円 856	百万円 2,492

(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 98

(4) 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)	4,389千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	17千円
(B)/(A)	0.4%

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。

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	株	数	株	数	株	数	株	数	株	数	株	数
				千円	千円					千円	千円					千円	千円
				価 額	価 額					価 額	価 額					価 額	価 額
日本発条	120.9	114.3	107,099	TOWA	10.4	10.9	12,131	THK	76.5	62.7	182,519						
中央発條	1.4	1.2	3,578	丸山製作所	2.6	2.2	3,405	ユーション精機	9.5	8.4	7,786						
アドパネクス	1.6	1.3	2,242	北川鉄工業	5.5	4.8	10,651	前澤給装工業	4.8	3.9	8,919						
立川ブラインド工業	5.4	4.7	6,044	ローツェ	5.3	4.7	19,575	イーグル工業	15.1	13.3	13,193						
三益半導体工業	9.5	8.4	20,344	タカキタ	4.4	3.7	2,086	前澤工業	9.1	7.1	2,811						
機械 (5.1%)				クボタ	658.2	572.1	1,024,917	日本ピラー工業	12.4	10.9	17,352						
日本ドライケミカル	3.4	2.7	4,749	荏原実業	3.5	2.7	5,526	キッツ	49.7	43.8	34,076						
日本製鋼所	36.7	32.3	69,380	三菱化工機	4.3	3.8	7,695	マキタ	149.3	140.6	605,986						
三浦工業	52.6	46.1	195,003	月島機械	24.3	19.9	28,835	日立造船	97.1	85.6	36,551						
タクマ	44.2	36.1	45,161	帝国電機製作所	8.6	8.9	12,513	三菱重工業	205.6	180.7	724,426						
ツガミ	27.1	22	23,188	東京機械製作所	4.7	4.7	1,701	IHI	94.3	77.6	222,712						
オークマ	15.4	12.4	64,852	新東工業	29.1	25.5	23,511	スター精密	21.1	16.6	23,688						
東芝機械	13.7	12	40,560	澁谷工業	10.7	9.4	29,375	電気機器 (14.6%)									
アマダホールディングス	187.2	135.5	159,483	アイチコーポレーション	21.2	18.7	13,669	日清紡ホールディングス	68.1	71.8	73,738						
アイエンジニアリング	33.7	27.9	25,444	小森コーポレーション	33.2	27.3	27,163	イビデン	75.1	66	178,992						
滝澤鉄工所	3.9	3.3	4,484	鶴見製作所	9.6	8.4	15,531	コニカミノルタ	268.1	235.6	165,155						
FUJII	36.3	45.8	84,638	住友精細工業	2	1.6	5,208	ブラザー工業	159.9	131.6	305,312						
牧野プライス製作所	14.2	12.4	53,258	日本ギア工業	-	3.5	1,396	ミネベアミツミ	227.8	200.1	448,824						
オーエスジー	59.7	49.3	94,705	酒井重工業	2.3	2	5,508	日立製作所	552.4	518.1	2,211,768						
ダイジェット工業	1.4	1.2	1,716	住原製作所	54.4	44.6	156,323	三菱電機	1,227	1,078.2	1,759,622						
旭ダイヤモンド工業	31.8	27.9	17,019	石井鐵工所	1.9	1.4	3,960	富士電機	79.6	65	233,675						
DMG森精機	76.7	67.4	110,333	西島製作所	12.6	10.9	9,777	東洋電機製造	4.8	4.3	6,467						
ソディック	26.4	25.1	22,037	北越工業	12.7	11.1	14,718	安川電機	142.2	116.1	458,595						
ディスコ	16.4	14.5	383,815	ダイキン工業	167.5	137.4	2,245,803	シンフォニアテクノロジ	17	14	17,626						
日東工器	6.6	5.8	14,871	オルガン	4.5	3.9	28,821	明電舎	24.3	19.8	41,085						
日進工具	3.7	3.2	9,193	トヨーカネツ	4.6	4.7	10,415	オリジン	3.3	3	4,617						
パンチ工業	8.5	9.8	4,635	栗田工業	66.4	58.3	203,758	山洋電気	5.9	5.2	28,600						
富士ダイス	5.4	4.6	3,330	椿本チエイン	16	15.4	54,362	デンヨー	11.3	9.2	19,660						
豊和工業	6.7	5.9	4,867	大同工業	5.8	5.2	4,201	東芝テック	15.3	13.5	59,332						
OKK	5	4.4	2,736	木村化工機	10.2	9	5,454	芝浦メカトロニクス	2.2	1.9	6,944						
石川製作所	2.9	2.5	4,057	アネスト岩田	19.1	16.7	17,401	マップモーター	33.9	29.9	120,048						
東洋機械金属	8.8	7.5	3,945	ダイフク	67.4	55.1	380,741	日本電産	147.7	129.7	1,931,881						
津田駒工業	2.6	2	2,274	サムコ	3.4	3	5,988	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.6	6.5	2,762						
エンシュウ	3.2	2.5	3,107	加藤製作所	6.3	5.9	9,823	トレックス・セミコンダクター	4.2	6.2	9,405						
島精機製作所	16.7	17.1	37,431	油研工業	2.2	1.7	2,915	東光高岳	6.2	6	7,152						
オプトラン	11.9	11.9	35,819	タダノ	59.2	52	55,536	ダブル・スコープ	17.8	16.7	12,909						
NCホールディングス	3.8	3.3	2,247	フジテック	44.6	39.2	69,776	宮越ホールディングス	4.6	4	3,584						
イワキ	-	5.1	6,262	CKD	34.1	30	57,300	ダイヘン	13.5	11.8	42,657						
フリユー	9.7	10.4	12,282	キトー	9.3	8.2	14,013	田淵電機	16.5	-	-						
ヤマシンフィルタ	21.1	23.2	18,003	平和	34.2	30.1	68,266	ヤーマン	17.7	15.6	10,654						
日阪製作所	15	13.2	12,500	理想科学工業	10.9	9.5	17,888	JVCケンウッド	89.9	88	21,912						
やまびこ	23.6	20.7	23,039	SANKYO	30.7	24	92,400	ミキエンジニアリング	11	9.6	4,963						
平田機工	5.7	5	32,800	日本金銭機械	13.6	11.9	10,091	第一精工	5.1	4	9,630						
ベガサスマシン製造	11.4	10.7	5,157	マースグループホールディングス	7.7	6.8	13,525	日新電機	28.8	25.3	30,815						
マルマエ	3.3	4.4	4,452	フクシマガリレイ	7.5	6.6	27,687	大崎電気工業	24.4	21.4	13,524						
タツモ	3.9	5	6,315	オーイズミ	5	4.6	2,580	オムロン	130.3	96.7	661,428						
ナプテスコ	66.7	62.8	200,646	ダイコク電機	5.6	5	7,865	日東工業	19.6	15.8	36,545						
三井海洋開発	12.9	11.3	23,560	竹内製作所	20.5	18.1	35,530	IDEC	16.4	15.6	31,200						
レオン自動機	12	10.5	15,456	アマノ	35.1	28.3	85,324	正興電機製作所	-	2.5	2,842						
SMC	35.9	33.9	1,720,425	JUKI	17	15	12,030	不二電機工業	1.3	1.2	1,490						
ヤマハモーター・ロボティクス&システムズ	9.2	9.3	4,780	サンデンホールディングス	14.9	14.2	9,372	ジェー・エス・エフ コーポレーション	44.1	36	80,820						
ホソカワミクロン	4.3	3.8	19,342	蛇の目マシン工業	11.2	10.1	4,161	サクホールディングス	3	2.5	5,137						
ユニオンツール	5.2	4	12,160	マックス	18.9	16.4	34,177	メルコホールディングス	5.1	3.8	10,389						
オイレス工業	16.9	13.8	22,273	グロウリー	34	27.6	88,182	テクノメディカ	2.8	2.4	4,958						
日精イー・エス・ビー機械	3.5	3.6	14,148	新晃工業	11.4	10	17,640	ダイモンドレック・リソグラフィホールディングス	-	1.7	1,662						
サトーホールディングス	14.6	15.2	47,956	大和冷機工業	17.6	15.6	18,345	日本電気	158.8	130.9	655,809						
技研製作所	8.5	9.4	45,825	セガサミーホールディングス	121.8	107	169,381	富士通	118.3	103.9	1,321,088						
日本エアーテック	3.8	3.4	2,954	日本ピストンリング	4.5	4	5,920	沖電気工業	53.2	43.9	61,460						
カワタ	2.5	3.2	3,184	リケン	5.6	5	18,350	岩崎通信機	5.8	4.8	3,988						
日精樹脂工業	10.2	9	8,694	TPR	16.5	14.5	27,332	電気興業	6.4	5.2	19,058						
オカダアイオン	4.2	3.4	4,229	ツバキ・ナカシマ	18.5	22	29,480	サンケン電気	14.3	11.7	34,304						
ワイエイシイホールディングス	4.9	4.6	3,026	ホシザキ	35.8	31.5	332,640	ナカヨ	2.3	1.9	3,157						
小松製作所	555.5	488.3	1,171,187	大豊工業	10	8.9	6,470	アイホン	7	6.1	10,729						
住友重機械工業	70.2	61.7	178,991	日本精工	252	203	193,053	ルネサスエレクトロニクス	127	514.9	383,085						
日立建機	49.1	43.1	130,377	NTN	263.7	249.6	74,630	セイコーエプソン	152.2	133.8	230,403						
日工	3.4	14.8	11,988	ジェイテクト	117.7	103.4	125,010	ワコム	88.9	72.4	28,815						
巴工業	5.2	4.6	10,248	不二越	11.4	10	42,700	アルバック	24.5	19.8	80,091						
井関農機	12.3	10.8	16,405	日本トムソン	36.4	31.9	14,897	アクセル	5	4.5	3,753						

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	千株	千円 評価額		株数	株数	千株	千円 評価額		株数	株数	千株	千円 評価額
EIZO					ウシオ電機					日信工業				
ジャパンディスプレイ	290.1		11.3	33,054	岡谷電機産業	8.8	8.5	3,162		トビー工業	10.1	8.9	16,278	
日本信号	31.2		27.4	39,538	ハリオス テクノ ホールディング	11.3	9.9	4,405		ティラド	4.5	3.9	7,203	
京三製作所	26.3		25.2	14,288	エノモト	2.6	3.3	4,319		曙ブレーキ工業	67.3	59.3	13,994	
能美防災	16.2		14.3	35,750	日本セラミック	12.5	10.9	27,489		タチエス	20.8	17.6	24,992	
ホーチキ	7.7		7.9	11,699	遠藤照明	6.3	5.4	3,812		NOK	65.9	57.9	91,366	
星和電機	4.1		5.4	3,191	古河電池	8.8	7.6	5,806		フタバ産業	34.1	30.1	20,016	
エレコム	11.1		11.7	50,017	双信電機	5.9	5.4	2,386		KYB	12.8	12	36,720	
パナソニック	1,401.8	1,231.9	1,522.6	28,628	山一電機	8.9	7.9	15,191		大同メタル工業	19.9	20.7	14,117	
シャープ	121.8	124.7	192.9	10	図研	7.9	7	18,487		プレス工業	60.8	53.5	20,169	
アンリツ	79	69.5	149,355		日本電子	24.2	21.2	77,698		ミックニ	15.5	13.7	4,699	
富士通ゼネラル	37.4	29.3	72,898		カシオ計算機	108.5	95.4	193,757		太平洋工業	25.7	22.5	30,555	
ソニー	822.6	681.6	5,334,201		ファナック	116.6	102.4	2,139,648		ケーヒン	28.2	24.8	64,033	
TDK	64.2	52	627,640		日本シイエムケイ	31.2	25.4	13,716		河西工業	15	14.5	12,020	
帝国通信工業	5.4	4.7	5,870		エンプラス	5.5	5.5	16,885		アイシン精機	101.1	88.7	335,286	
タムラ製作所	47.2	36	23,256		大真空	4.5	4	7,084		マツダ	385.1	317.2	289,286	
アルプスアルパイン	127.7	95.5	191,764		ローム	59.3	47.8	410,124		今仙電機製作所	11.4	10	9,030	
池上通信機	3.9	3.5	3,888		浜松ホトニクス	88.1	77.3	376,064		本田技研工業	1,035.2	849	2,426,017	
パイオニア	204.5	—	—		三井ハイテック	13.6	11.9	20,396		スズキ	224.5	213.7	1,094,357	
日本電波工業	11.2	9.8	4,753		新光電気工業	41.1	36.2	48,942		SUBARU	381	334.7	950,882	
鈴木	2.1	5.8	4,547		京セラ	187.1	151.7	1,111,657		安永	5.9	5.2	6,193	
日本トリム	6.4	1.4	6,167		太陽誘電	54.6	47.9	167,650		ヤマハ発動機	173.2	140.6	295,822	
ローランド ディー. ジー.	6.3	5.9	12,000		村田製作所	128.8	316.7	2,096,554		ショーワ	29	25.4	58,039	
フォスター電機	14.4	11.3	18,543		ユーシン	19.4	—	—		TBK	14.8	12.9	6,011	
クラリオン	10.7	—	—		双葉電子工業	20	17	22,865		エクセディ	16.6	14.7	34,104	
SMK	3.4	2.8	8,764		北陸電気工業	4.6	4.3	5,022		豊田合成	39.7	34.8	85,990	
ココオ	8.8	6.9	20,838		ニチコン	38.6	36.6	35,062		菱三工業	19.2	16.9	12,168	
ティアック	8.6	8	1,592		日本ケミコン	8.8	8.2	14,546		盟和産業	1.9	1.6	1,740	
ホシデン	36.1	29.5	37,229		KOA	18.6	16.2	20,250		日本プラスト	9.6	8.4	5,812	
ヒロセ電機	17.5	16.7	232,965		市光工業	18.4	16.1	11,157		ヨロフ	11.5	10.1	14,705	
日本航空電子工業	28.2	24.7	50,412		小糸製作所	73.6	64.6	321,708		エフ・シー・シー	22.1	17.6	39,564	
TOA	13.3	11.5	12,420		ミツバ	22.6	19.9	15,064		シマノ	49.5	40.4	727,200	
マクセルホールディングス	26.4	23.3	34,181		SCREENホールディングス	21.3	18.7	122,672		テイ・エス テック	28.5	25	78,875	
古野電気	15.8	13.9	15,429		キャノン電子	11.3	11.3	23,843		ジャムコ	6.2	5.4	7,759	
ユニデンホールディングス	3.7	3	6,306		キャノン	660.6	580.4	1,716,823		精密機器 (2.4%)				
スマイコーボレーション	10.4	8.3	9,777		リコー	369	274.3	342,600		テルモ	173.6	305.1	1,202,399	
アイコム	6.8	6	15,990		象印マホービン	22.9	31.6	72,206		クリエートメディック	4.2	3.6	3,888	
リオン	5.6	4.5	14,917		MUTOHホールディングス	1.6	1.4	2,438		日機装	39.7	32.3	44,251	
本多通信工業	10.5	9.4	5,094		東京エレクトロン	81.9	71.9	1,750,765		日本エム・ディ・エム	7	6.2	12,499	
船井電機	12.5	10.9	7,662		輸送用機器 (7.6%)					島津製作所	157.9	128.8	390,908	
横河電機	122.8	98.9	197,008		トヨタ紡織	42.9	31.4	52,783		JMS	11.1	9.2	8,050	
新電元工業	4.4	3.8	13,338		芦森工業	2.6	2.2	3,018		クボテック	2.6	2.8	1,145	
アズビル	79.2	68	204,680		ユニプレス	23.8	20.9	30,305		長野計器	9.6	7.8	7,332	
東亜ディーケーケー	6.1	5.3	5,469		豊田自動織機	99.3	87.3	545,625		パイ・テクノロジ	2.9	5	25,150	
日本光電工業	54.1	44.6	155,654		モリタホールディングス	21.4	18.9	33,207		東京計器	7.7	6.9	7,024	
チノー	4.3	3.7	5,154		三菱工業	15.5	13.7	14,371		愛知時計電機	1.6	1.3	5,609	
共和電業	13	11.3	4,892		デンソー	270.2	237.4	1,075,184		インターアクション	6.5	5.8	15,433	
日本電子材料	4.7	4.3	4,588		東海理化電機製作所	32.8	28.4	54,698		オーバル	11.7	9.8	2,489	
堀場製作所	24.3	21.3	153,573		E&Sホールディングス	44.3	39	37,167		東京精密	22.2	19.5	78,975	
アドバンテスト	83.6	80.2	453,130		川崎重工業	95.5	83.9	191,375		マニー	14.9	42.9	123,981	
小野測器	5.7	4.2	2,553		名村造船所	36.8	34.7	8,744		ニコン	213.8	174.4	233,347	
エスベック	10.9	9.5	22,600		サノリスホールディングス	16.3	13.2	2,349		トプコン	65.8	54.3	69,829	
キーエンス	60.2	97.7	3,743,864		日本車輦製造	4.5	4	12,340		オリンパス	182.8	596.7	1,231,588	
日置電機	6.4	5.6	23,072		三菱ロジスネクスト	14.6	14.3	22,880		理研計器	10.9	9.5	21,755	
シスメックス	95.6	77	631,554		近畿車輛	1.9	1.6	2,579		タムロン	10.9	8.7	20,584	
日本マイクロニクス	9.8	18.8	24,289		日産自動車	1,447.3	1,271.6	758,000		HOYA	247.1	215.3	2,190,677	
メガチップス	19.7	10	18,290		いすゞ自動車	387.9	312.4	356,292		シード	5.2	4.6	4,793	
OBARA GROUP	7.1	5.6	20,608		トヨタ自動車	1,367.5	1,203.1	9,458,772		ノーリツ鋼機	9.7	7.2	11,124	
滝藤電機	1.5	1.3	2,802		日野自動車	153.2	134.6	142,003		エー・アンド・デイ	11.2	9.8	9,898	
原田工業	3.8	5.1	5,100		三菱自動車工業	454.2	399	169,575		朝日インテック	52	91.6	291,288	
コーセル	17	13.2	15,272		エフテック	8.7	7.5	5,505		シチズン時計	134.2	126.3	68,075	
イリソ電子工業	11.2	9.1	39,084		レシップホールディングス	4.5	4.4	3,022		リズム時計工業	4.1	3.4	3,107	
オプテックスグループ	21.6	17.6	27,385		GMB	2.5	2	1,612		大研医器	9.8	7.5	5,167	
千代田インテグレ	5.1	5	10,630		ファルテック	2.1	1.9	2,050		メニコン	16.8	14.8	78,144	
アイ・オー・データ機器	5.1	4	4,172		武蔵精密工業	28.9	24	32,112		シンシア	1.9	1.1	749	
レーザーテック	25.1	47.3	259,677		日産車体	24	21.1	22,387		松風	6.2	4.9	9,770	
スタンレー電気	86.9	75.8	234,601		新明和工業	57.1	29.1	39,023		セイコーホールディングス	19	15.2	41,100	
岩崎電気	4.8	4.2	6,997		極東開発工業	24.4	20	29,720		ニプロ	84.9	74.7	99,052	

銘柄	前期(前期末)		当期 末		銘柄	前期(前期末)		当期 末		銘柄	前期(前期末)		当期 末	
	株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円
その他製品 (2.2%)					レンパ					三菱倉庫				
中本パックス	3.4	2.8	4,631		東京瓦斯	240.7	207.5	509,723		三井倉庫ホールディングス	14.3	11.6	21,750	
スノービーフ	4.5	5.1	5,298		大阪瓦斯	238	209.3	404,995		住友倉庫	43.7	37.5	56,362	
パワフロントベッドホールディングス	14.1	11.4	52,611		東邦瓦斯	60.7	53	226,045		湊湾倉庫	6.5	5.6	12,572	
トランザクシヨン	6.7	6.9	7,741		北海道瓦斯	6.6	5.8	9,744		東陽倉庫	20.5	18.5	6,012	
粧美堂	3.5	3.2	1,270		広島ガス	25.5	22.4	8,086		日本トランスシティ	25.7	22.5	11,047	
ニホンフラッシュ	5.2	5	13,760		西部瓦斯	13.9	12.1	29,645		ケイヒン	2.2	1.8	2,408	
前田工織	13.6	11.8	26,432		静岡ガス	37.7	30.6	29,345		中央倉庫	6.9	6.2	7,278	
永大産業	16.4	14.3	4,876		メタウオーター	5.9	5.2	22,204		川西倉庫	2.3	1.8	1,873	
アートネイチャー	13.1	11.5	8,487		陸運業 (4.3%)					安田倉庫	9.7	8.4	9,382	
バンダイナムコホールディングス	126.8	111.5	701,892		SBSホールディングス	12.2	9.3	17,725		フェイスホールディングス	—	2.2	1,023	
アイフィスジャパン	2.7	2.8	2,038		東武鉄道	129.4	113.7	432,060		東洋埠頭	3.3	3.1	4,380	
共立印刷	20.8	18.4	3,091		相鉄ホールディングス	42.2	34.5	100,153		宇徳	10.1	8.7	4,724	
SHOE I	5.8	5.2	28,288		京浜急行電鉄	333.3	271.9	531,292		上組	71.8	58.5	141,043	
フランスベッドホールディングス	17.4	15.3	14,504		小田急電鉄	168.1	138.5	289,326		サンリツ	2.9	2.3	1,616	
パイロットコーポレーション	21.4	17.5	78,487		京王電鉄	196.6	160.3	390,490		キムラユニティー	3.2	2.8	3,166	
萩原工業	6.8	6	9,966		京成電鉄	9.6	56	349,440		キューソー流通システム	3	2.5	4,997	
トップラン・フォームズ	26.3	23.2	28,327		富士急行	92	75.1	307,159		近鉄エクスプレス	22	21.6	39,614	
フジシールインターナショナル	27.4	24.2	52,441		富士急行	16.7	14.7	53,508		東海運	6.3	5.8	1,664	
タカラトミー	51.4	48.3	56,849		新京成電鉄	3.1	2.8	6,860		エーアイティ	7.5	7.2	7,113	
廣済堂	11.4	7.5	7,830		東日本旅客鉄道	218.2	189.8	1,850,550		内外トランスライン	3.8	3.6	4,644	
エステールホールディングス	3.5	2.8	1,971		西日本旅客鉄道	110	96.1	891,904		日本コンセプト	3.2	3.3	5,200	
アーク	46.7	41.5	3,776		東海旅客鉄道	109.9	89.7	1,987,303		情報・通信業 (9.0%)				
タカノ	4.9	4.2	3,486		西武ホールディングス	156.3	144.7	263,064		NECネットエスアイ	13.4	10	42,150	
プロネックス	10.5	9.3	11,206		鴻池運輸	19.6	17.1	27,018		クロスキャット	—	2.8	3,539	
ホクシン	7.7	7.2	1,130		日本鉄道	34	29.9	78,427		システナ	43	37.7	63,147	
ウッドワン	4	3.5	4,000		ハマキョウレックス	9.4	8.3	28,884		デジタルアーツ	6.5	5.2	29,068	
大建工業	9.3	7.2	13,701		サイ引越センター	6.5	5.7	35,397		日鉄ソリューションズ	18	15.9	52,072	
凸版印刷	173.2	152.2	336,362		近鉄グループホールディングス	116.1	102.1	594,222		キューブシステム	6.4	5.6	4,362	
大日本印刷	172.9	141.1	433,882		阪急阪神ホールディングス	155	136.2	591,108		エイジア	2.4	1.9	2,958	
図書印刷	11.5	—	—		南海電気鉄道	51.9	48.4	135,326		コア	5.1	4.5	6,426	
共同印刷	3.9	3.4	10,121		京阪ホールディングス	51.8	45.5	227,500		ソリトンシステムズ	6.8	4.6	5,828	
N I S S H A	25.1	22.1	23,249		神戸電鉄	3	2.4	9,552		ソフトウェイトホールディングス	5.2	4.6	8,234	
光村印刷	1	0.9	1,498		名古屋鉄道	93.1	83.9	274,353		T I S	40.1	35.3	250,277	
TAKARA & COMPANY	6.4	5.2	8,996		山陽電気鉄道	9	7.3	16,016		ネオス	4.1	4.3	3,173	
アシックス	121.9	89	142,578		日本通運	45.6	36.1	221,654		電算システム	4.6	4.1	11,533	
ツツミ	3.9	3.4	7,650		ヤマトホールディングス	203.7	179	352,630		グリー	83.1	64.9	31,930	
小松ウォール工業	3.8	3.4	7,524		山丸	32.3	28.4	161,596		コエテクモホールディングス	24.6	21.6	68,148	
ヤマハ	73	64.2	364,014		丸連	6.2	5.9	1,911		三菱総合研究所	4.7	4.6	21,183	
河合楽器製作所	3.8	3.4	11,356		丸全昭和運輸	9.4	8.3	24,543		ボルテージ	2.4	1.9	969	
クリナップ	11.5	10.1	7,029		セコグループホールディングス	64.1	56.3	50,163		電算	1.3	1.2	2,691	
ピジヨソ	74.2	65.2	259,822		トナミホールディングス	2.8	2.4	12,528		AGS	6.8	5.9	5,032	
オリバー	—	2.2	7,546		ニッコンホールディングス	44.2	36.5	94,973		ファインデックス	10.1	9	11,007	
兼松サステック	0.8	0.7	1,283		日本石油輸送	1.4	1.1	3,432		ピト・コミュニケーションズ	2.8	—	—	
キングジム	10.2	9	8,091		福山通運	14.9	13.1	50,173		ブレインパッド	2.6	2.1	12,075	
リントック	29.2	25.6	63,385		セイノールホールディングス	87	76.5	112,761		K L a b	21.4	20.4	16,748	
イトーキ	22.6	22.9	11,335		エスライン	3.1	3.1	3,239		ホトウィン・ビストロホールディングス	16	12.7	12,509	
任天堂	75.5	66.1	2,677,050		神奈川中央交通	2.9	2.5	10,075		イーブックイニシアティブジャパン	2	1.5	2,634	
三菱鉛筆	20.2	17.7	29,789		日立物流	25.6	18.8	60,912		ネクソン	306.6	301.2	497,281	
タカラスタンダード	25.4	22.2	41,358		丸和運輸機関	6.1	10.8	25,153		アイスタイル	30.6	27.3	12,285	
コクヨ	58.9	51.7	86,028		C&Fホールディングス	11.9	10.3	13,348		エムアップ	4.2	3.1	9,293	
ナカバヤシ	12.3	10.7	6,805		九州旅客鉄道	97.6	91.1	330,693		エイチーム	7.5	7.2	6,955	
グローブライド	5.9	4.8	11,731		SGホールディングス	109.8	107.2	258,459		エニゲモ	—	7.5	6,802	
オカムラ	42.9	37.6	41,059		海運業 (0.2%)					テクノスジャパン	10.1	8.3	4,332	
美津濃	12.2	9.8	27,557		日本郵船	97.1	85.4	153,549		enish	4.2	4.7	2,608	
電気・ガス業 (1.5%)					商船三井	69	64.6	168,864		コロブラ	34.3	34.7	32,895	
東京電力ホールディングス	979.5	860.8	388,220		川崎汽船	35.8	31.4	47,162		オルトプラス	7.3	7.9	7,102	
中部電力	375.4	330	517,440		NSユニテッド海運	6.4	5.6	11,228		ブロードリーフ	59.7	52.5	33,180	
関西電力	500.7	408.6	533,835		明治海運	12.1	10.2	3,712		クロス・マーケティンググループ	3.3	4.9	1,768	
中国電力	169.6	149.1	225,141		飯野海運	55	48.1	17,941		デジタルホールディングス	5.4	5.6	5,420	
北陸電力	120.1	98.6	87,359		共栄タンカー	0.8	1.8	1,683		システム情報	—	5.4	5,437	
東北電力	287.4	269.6	284,967		乾汽船	10.4	5.9	7,262		メディアドックホールディングス	3.5	3.4	10,931	
四国電力	110.5	97.2	90,882		空運業 (0.5%)					じげん	12.8	26.2	13,466	
九州電力	252.9	222.3	204,738		日本航空	212.8	183.8	582,094		アイキューブ	6.3	6.5	4,147	
北海道電力	114.8	101	52,318		ANAホールディングス	212.5	186.6	645,449		エコレック・テクノロジ	—	1.7	1,496	
沖縄電力	22.7	20	41,820		パスコ	2.3	1.9	4,187		サイバリークス	1.9	1.6	1,832	
電源開発	97.7	85.9	217,842		倉庫・運輸関連業 (0.2%)					ディー・エル・イー	7.5	7.9	1,540	
エフオン	7.3	5.1	3,901		トラココム	3.3	2.9	23,113		フィックスターズ	11.5	11.2	17,080	
イーレックス	21.3	15.3	26,285		日新	10	8.8	14,528		CARTA HOLDINGS	6.4	5.1	5,502	

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	株	数		株	数	株	数
オプティム	2.7		千株	千円	野村総合研究所	76.5	149.9	409.826		日本通信	102.6	81.8	18,895	
セレス	—	4	3.5	4,140	サイバネットシステム	9.9	7.5	6,135		クロップス	2.3	1.9	1,664	
S H I F T	—	2.8	22,876		CEホールディングス	3.2	6.1	3,013		日本電信電話	823.5	1,414.3	4,031,462	
ペリサープ	1.1	—	—	—	日本システム技術	2	1.7	2,342		KDDI	1,061.1	788.5	2,689,573	
ティールガイド	12.1	9.4	24,120		インテジホールディングス	15.4	13.3	12,089		ソフトバンク	957.3	961.6	1,457,785	
セック	2	1.5	5,887		東邦システムサイエンス	3.7	2.9	2,633		光通信	14.2	10.9	295,717	
日本アジアグループ	12.8	11.1	4,184		ソースコム	46.4	50.2	24,849		N T T ドコモ	864.6	781.6	2,451,097	
豆蔵ホールディングス	8.1	7.2	13,550		インフォコム	4.9	11.5	34,845		EMティーツーアイ	14.1	10.2	7,221	
デクマトリックス	8.6	7.4	21,186		HEROZ	—	0.5	2,670		GMOインターネット	43.8	41.7	89,363	
プロシップ	3.6	3.1	4,231		ラクスル	—	5.6	20,804		ファイバーゲート	—	2	2,584	
カネー・オンライン・エンターテインメント	290.2	25.5	53,626		FIG	10.6	11.6	3,480		アドマーケティングコミュニケーション	2.5	3.2	1,955	
GMOベイメントゲートウェイ	19.8	17.4	127,890		システムサポート	—	0.9	2,337		KADOKAWA	35.1	28.5	52,212	
ザッパラス	5.9	5.6	2,156		イートン	—	3.8	9,245		学研ホールディングス	4.1	3.6	25,560	
システムリサーチ	1.6	2.9	5,594		アルテリア・ネットワークス	9.9	11.7	23,341		ゼンリン	24	21.1	33,422	
インターネットイニシアティブ	19.6	15.6	50,700		ヒト・コミュニティソリューションズホールディングス	—	2.4	4,106		昭文社	5.4	5	1,900	
さくらインターネット	14.4	11.3	7,356		フォーカスシステムズ	8	6.5	6,838		インプレスホールディングス	9.7	8.8	1,689	
ヴィンクス	4.1	3	3,375		クレスコ	3.7	6.5	12,200		アイネット	6.8	5.4	8,694	
GMOクラウド	2.7	1.9	4,921		フジ・メディア・ホールディングス	124.9	101.9	157,129		松竹	7.9	7	106,260	
SRAホールディングス	6.4	5.6	15,372		オービック	41.8	36.7	575,456		東宝	79.2	63.2	265,756	
MINOR1ソリューションズ	2.4	—	—		ジャストシステム	17.1	17.2	99,072		東映	5.1	4	61,920	
システムインテグレータ	3.4	3.4	3,097		TDCソフト	10.5	9.3	9,030		エヌ・ティ・ティ・データ	320.7	281.7	416,634	
朝日ネット	10.1	7.5	5,385		Zホールディングス	785.1	1,452.9	634,917		ビー・シー・イー	1.6	1.3	5,785	
eBASE	3.7	6.3	11,050		トレンドマイクロ	64.2	47	284,350		ビジネスプレインス光畑昭利	2.1	1.8	5,202	
アバント	3.2	7.5	7,912		IDホールディングス	3.4	4.1	6,490		D T S	13.5	23.7	55,126	
アドソール日進	4.3	3.8	9,610		日本オラクル	24.4	21.4	211,218		オウエフ・エックス・ホールディングス	56	45.1	232,716	
フリービット	7.9	6.3	5,600		アルファシステムズ	4	3.3	9,603		シーイーシー	12.9	11.3	24,069	
コムチュア	6.7	11.8	28,508		フューチャー	16.3	12.7	23,863		カブコン	51.6	49.9	163,921	
サイバーコム	2.2	1.8	3,697		CAC Holdings	9.1	6.8	10,159		アイ・エス・ピー	2.4	2	3,918	
アステリア	5.9	6.4	3,673		S Bテクノロジー	5.1	3.8	9,222		ジャスコ	7	6.7	7,323	
アール	—	3.8	7,311		トーセ	3.3	2.9	2,726		S C S K	31.8	24.4	149,572	
マークラインズ	4.2	5.3	10,838		オービックビジネスコンサルタント	12.4	10.8	47,250		日本システムウェア	4	3.5	8,330	
メディカル・データ・ビジョン	10.6	8.1	7,290		伊藤忠テクノソリューションズ	54.9	48.2	161,229		アイネス	15.2	10.4	18,106	
gumi	13.9	13.6	10,132		アイティフォー	14.6	12.9	10,203		T K C	10.1	9	50,760	
ショーケース	2.6	2.4	1,706		東計電算	1.8	1.5	6,442		富士ソフト	18	13.6	62,832	
モバイルファクトリー	3.3	2.3	4,179		エックスネット	2.3	1.6	1,545		N S D	19.7	34.8	65,110	
テラスカイ	0.7	3.8	11,970		大塚商会	65.1	57.2	291,148		コナミホールディングス	49.3	38.5	169,015	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	5.3	4.7	8,149		サイボウズ	14.1	12.3	25,694		野村コンピュータホールディングス	4	4.2	14,112	
P C Iホールディングス	2.2	2.1	5,210		ソフトブレイン	9.5	6.2	3,546		JBCホールディングス	9.5	7.1	15,030	
パイプHD	2	1.3	2,509		電通国際情報サービス	7.4	6.5	30,745		ミロク情報サービス	12	9.3	26,709	
アイビシー	2	1.9	2,707		デジタルガレージ	23.5	19.1	81,079		ソフトバンクグループ	503.2	839.5	4,251,228	
ネオジャパン	2.3	1.9	2,354		イーエムシステムズ	9.7	14.9	13,737		卸売業 (5.0%)				
P R T I M E S	0.7	0.9	2,310		ウェザーニューズ	4.1	3.6	14,058		ホウスイ	0.9	0.9	846	
ランドコンピュータ	1.4	1.6	1,865		C I J	9.5	7.9	6,904		高千穂交易	4.7	4.1	4,805	
ダブルスタンダード	0.7	1.3	5,635		ビジネスエン지니어リング	1.1	1.2	4,068		伊藤忠食品	2.9	2.4	12,480	
オーブンドア	5.9	5.2	6,994		日本エンタープライズ	12.7	10.8	2,862		エレマテック	5.6	9.9	10,355	
マイネット	3.9	3.5	2,411		WOWOW	5.7	5.1	13,851		J A L U X	3.4	3.1	7,402	
アカツキ	4.3	3.8	20,102		スカラ	9.7	7.5	5,670		あらた	6.7	8.5	39,525	
ベネフィットジャパン	0.6	0.8	1,412		インテリジェント ウェブ	—	4	3,096		トーマンデバイス	1.9	1.6	6,368	
Ubi comホールディングス	2.2	2.3	3,521		IMAGICA GROUP	10.2	9	4,626		東エレクtron デバイス	4.4	3.9	10,288	
L I N E	36.6	24.2	130,196		ネットワークシステムズ	42.7	40.3	77,617		フィールズ	10.5	8.2	4,682	
カナミックネットワーク	1.9	6.4	4,358		システムソフト	29.1	26.3	2,630		双日	667.4	586.6	208,829	
ナムテックコム・ソリューション	0.9	2.3	1,166		アルゴグラフィックス	5.1	9	35,820		アルフレッサ ホールディングス	134.3	118	280,486	
チェンジ	1.5	2.1	7,833		マーベラス	18.4	16.1	11,414		横浜冷凍	31.7	29.9	29,571	
シンクロ・フード	5.1	4.6	2,534		エイベックス	20.7	18.2	23,587		神栄	1.6	1.5	1,194	
オークネット	6.3	6.5	8,040		日本ユニシス	37.6	33	126,060		ラサ商事	6.5	5.6	5,264	
セグエグループ	—	1.7	1,490		兼松エレクトロニクス	6.5	5.7	20,605		ラクーンホールディングス	7.1	5.1	4,166	
エイトレッド	—	1.3	1,808		東京放送ホールディングス	79.8	64.4	135,368		アルコム	12.8	11.2	14,907	
AOI TYO HOLDINGS	13.1	10.7	7,639		日本テレビホールディングス	110.5	88.3	137,218		神戸物産	18.3	36.6	159,942	
マクロミル	21.3	18.9	19,202		朝日放送グループホールディングス	12.1	10.5	7,896		あい ホールディングス	17.2	15.2	28,484	
ビーグリ	2.3	2	2,576		テレビ朝日ホールディングス	33.1	29.1	63,292		ディープイェックス	4.2	3.8	3,587	
オロ	1.1	2.8	9,800		スカパーJ S A Tホールディングス	92	69.6	33,756		ダイワホールディングス	11	9.1	58,149	
テモナ	—	1.3	725		テレビ東京ホールディングス	9.9	8.7	21,341		マクニコ・富士エレクトロニクス	33.5	25.3	45,109	
ニーズウエル	—	1.2	992		日本BS放送	4.2	3.6	4,478		ラクト・ジャパン	2.7	4	17,060	
サインポスト	—	1.6	3,208		ビジョン	3.8	9.9	13,988		バスタークエストホールディングス	22.9	20	21,300	
ソルクサイズ	5.1	4.5	4,072		S マーケットバリュー	—	3.1	2,563		八洲電機	9.5	8.3	7,660	
フェイス	4.2	3.8	3,081		USEN-NEXT HOLDINGS	4.6	4	7,148		メディアスホールディングス	6.7	6	4,920	
プロトコルソリューション	—	9.5	13,414		ワイヤレスゲート	5.3	5	3,985		レスタホールディングス	7.7	11.1	21,101	
ハイマックス	1.5	1.2	2,365		コネクシオ	8.6	6	9,450		ジュテックホールディングス	2.7	2.3	2,674	

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	株	数	株		株	数	株	株	数	株		株	数	株	株	数	
大光		千株	千株		千円		東都水産		千株	千株	千円		J Kホールディングス		千株	千株	千円			
OCH1ホールディングス		3	4.6		3,091		OUGホールディングス		1.8	1.3	3,849		日伝		11.1	9.6	7,344			
TOKAIホールディングス		3.4	3.1		4,637		スターゼン		2.1	1.6	4,336		北沢産業		10	9.6	19,641			
黒谷		63.9	56.2		57,492		山善		4.5	3.9	17,628		杉本商事		9.2	7.8	2,121			
Cominix		2	1.9		955		橋本興業		47.2	41.4	43,304		因幡電機産業		6.6	5.7	11,451			
三洋貿易		1.9	1.8		1,476		住友商事		2.7	1.9	7,809		バイテックホールディングス		17.1	30.2	83,321			
ビューティガレージ		6.1	10.6		14,087		内田洋行		714.7	670	1,139,335		東テク		5.4	—	—			
ウィン・パートナーズ		1.8	1.7		3,728		三菱商事		5.5	4.5	30,735		ミスミグループ本社		4.1	3.5	9,607			
ミタチ産業		7.8	7.6		8,648		第一実業		848	745.2	2,175,984		アルテック		151.3	133	374,395			
シッパヘルスケアホールディングス		2.9	3.2		2,323		セゾンマーケティングジャパン		5.5	5.2	19,344		タキヒヨー		8.7	8.6	2,347			
明治電機工業		25.1	17		86,700		西華産業		34.5	30.4	84,116		蔵王産業		3.8	3.1	6,001			
テリファースホールディングス		3.9	3.4		5,168		佐藤商事		6.8	6	7,854		ジェコス		2.1	2.1	3,114			
スターティアホールディングス		2.2	3.9		2,800		三菱エレクトロ		10.9	8.8	8,404		グローセル		55.1	45	201,825			
コメダホールディングス		2.4	2.4		1,896		ユアサ商事		12.3	10.8	19,980		ローソン		8.5	7.3	7,927			
アセンテック		27.7	23.2		51,341		神鋼商事		12.1	9.6	5,865		サンエー		11.2	9.4	4,267			
富士興産		—	0.8		1,988		小林産業		12.4	10.1	35,754		カーワチ薬品		30.6	26.8	171,252			
協栄産業		4.6	3.3		2,316		阪和興業		2.7	2.7	6,782		エービーシー・マート		9.2	8.9	41,162			
小野建		1.4	1.2		1,744		正栄食品工業		7	6.3	1,801		ハードオフコーポレーション		9.4	8.3	18,475			
南陽		10.6	9.6		13,180		カナデン		21	19.9	54,824		アスクル		18.9	16.6	119,852			
佐島電機		2.5	2.1		3,897		三菱商事		6.4	6.8	26,418		ゲオホールディングス		4.8	4.2	3,444			
エコーレーディング		9	7.9		6,975		フルサト工業		11.7	8.6	11,653		アダストリア		12.7	11.1	39,793			
伯東		2.6	2.3		1,324		岩谷産業		8.3	5.9	10,112		ジーフット		18.4	19.1	23,875			
コンドールテック		8.3	8.2		9,785		若てきナイスグループ		9.4	26.7	86,612		シー・ヴィ・エス・ベイヤリア		16.7	14.7	31,399			
中山福		6.6	6.2		3,224		昭光通商		5	4.6	5,920		くら寿司		7.4	6.4	4,019			
ナガイレーベン		17.4	15.4		37,545		ニチモウ		4.4	3.5	2,502		キャンドウ		1.5	1.5	1,005			
三菱食品		13.4	11.6		37,062		極東貿易		1.9	1.7	3,456		パルグループホールディングス		7.1	5.1	32,120			
松田産業		8.9	7.8		12,347		イワキ		3.8	3.1	6,668		エディオン		5.7	5.5	8,583			
第一興商		18	15.8		84,688		三菱石油		14.5	14	7,238		サーラコーポレーション		6.2	5.4	18,360			
メディバルホールディングス		130.5	114.6		285,468		稲畑産業		32.4	26.1	31,554		ワッツ		51.1	48.8	51,776			
S P K		2.5	2.2		5,902		G S Iクレオス		29	23.4	36,199		ハローズ		24.5	21.6	13,629			
萩原電気ホールディングス		4.5	4		10,240		明和産業		3.2	2.5	3,105		フジオワードシステム		4.1	4	3,009			
アズワン		8.7	6.9		66,171		クワザワ		11.4	9.8	5,958		あみやき亭		4.6	4	11,320			
スズデン		4.3	3.7		5,320		ワキタ		—	3.8	2,546		ひらまつ		—	9	15,921			
尾家産業		3.4	3.1		4,144		東邦ホールディングス		25.8	22.6	23,843		大黒天物産		2.7	2.2	7,755			
シモジマ		7.4	6.5		7,592		サンゲツ		35.8	34.1	80,919		ハニースホールディングス		24.1	19.6	5,370			
ドウシシャ		11.4	10.1		16,998		サンリョ		36.5	29.2	55,918		ファーマライズホールディングス		2.8	2.5	9,075			
小津産業		2.6	2.3		4,232		サンワテクノス		17.5	15.7	19,468		アルベン		11.8	9.4	13,084			
高速		7.3	6.3		7,774		リョーサン		5	4.4	9,380		ハブ		2.7	2.5	1,647			
たけびし		4.3	3.5		5,148		新光商事		26.6	23.5	22,795		クオールホールディングス		9.3	8.2	15,662			
リックス		2.7	2.3		3,877		トーホー		37.3	29.8	66,126		ジンズホールディングス		3.9	3.1	3,248			
丸文		10.7	9.4		6,063		三信電気		7.3	7.5	7,080		ビックカメラ		17.7	15.6	23,524			
ハピネット		20.1	8.9		12,050		東陽テクノカ		13.4	11.7	29,987		DCMホールディングス		8.1	5.6	43,568			
橋本総業ホールディングス		10.4	2.1		3,876		モスフードサービス		11.4	16.7	14,462		ペッツァーフードサービス		64.5	62.9	74,725			
日本ライフライン		37.9	31.4		46,597		加賀電子		5.5	4.8	8,793		MonotaRO		65.1	57.3	60,909			
タカショー		6.1	5.4		2,543		ソードナニカ		10	5.7	9,957		DDホールディングス		9.5	8.5	8,058			
エクセル		4.5	3.1		4,947		立花エレクトック		14	12.2	13,383		きちりホールディングス		76.3	75.5	212,608			
マルカ		4	3.8		8,200		フォーバル		15.9	14	43,190		アラブコムホールディングス		2.5	2.7	1,674			
I DOM		40.7	28.7		16,646		P A L T A C		12.1	10.6	25,185		マツモトキヨシホールディングス		2.7	4.2	7,018			
進和		7.1	6.3		14,357		丸紅建材リース		12.7	10.8	7,030		プロンコビリー		3.1	2.9	2,259			
エスケイジャパン		2.9	2.2		987		日鉄物産		9	7.9	14,472		ZOZO		8.9	7.8	15,834			
ダイトロン		5.5	4.5		8,577		三谷産業		5.3	4.7	5,593		トリジャー・ファクトリー		154.5	126.8	170,672			
シークス		15.3	13.5		17,536		トラスコ中山		21.8	17	92,140		ココカラファイン		21.2	16.9	35,743			
田中商事		3.7	3.4		2,482		オートバックセブン		14.4	14.2	5,012		Hame e		50	43.9	194,696			
オーハシテクニカ		6.8	5.9		9,971		モリト		4.9	4.1	3,275		ウェルシアホールディングス		6.3	5.5	14,613			
白銅		4	3.9		6,056		加藤産業		2.8	1.9	6,868		クレイトSDホールディングス		130.6	73	131,911			
伊藤忠商事		845.4	742.8		1,996,646		北恵		0.9	0.8	1,697		エー・ピーカンパニー		3.7	3.2	2,784			
丸紅		1,191.9	1,105.3		893,635		イノテック		21.2	25.2	7,207		シュッピン		10.0	9.4	24,354			
高島		2	1.6		3,155		イエローハット		6.1	5.3	8,278				3.4	2.7	24,354			
長瀬産業		68	59.8		91,075				1.1	1	1,903				13.6	11.1	62,826			
蝶理		7.7	6.8		15,177				8.7	7.5	36,450				225.9	185.6	157,388			
豊田通商		134.9	118.5		450,892				4.1	3.3	10,246				3.1	3.3	5,610			
三共生興		20.7	16		9,408				25.1	22.1	57,658				32	31.6	199,712			
兼松		48.3	39.6		54,370				48	39.4	63,906				17.7	17.8	51,317			
ツカモトコーポレーション		2.2	1.8		2,070				8.9	7.8	6,263				14.5	12.4	4,563			
三井物産		995.7	933.4		1,849,065				18.9	16.6	59,843				2.4	2.1	1,409			
日本紙パルプ商事		6.9	6		24,300				2.3	2	1,836				1.6	1.4	1,278			
日立ハイテクノロジーズ		36.7	36.9		295,938				8.3	6.3	7,276				2.3	2	1,278			
カメイ		15.8	13.9		16,429				11.4	20.1	35,175				3.8	3.3	7,761			
															8.1	7.2	7,718			

銘柄	期首(前期末)		当期		銘柄	期首(前期末)		当期		銘柄	期首(前期末)		当期	
	株	数	株	数		株	数	株	数		株	数	株	数
		千株		千株			千株		千株			千株		千株
		千円		千円			千円		千円			千円		千円
		株数		株数			株数		株数			株数		株数
ネクステージ		18.6	15.2	16,248	京都きもの友禅		7.7	7	2,373	プレナス		13.6	11.9	23,919
ジョイフル本田		35.4	31.1	42,855	コロナフイット		40.2	35.3	78,366	ミニストップ		9	7.9	12,829
鳥富族		4.4	3.5	8,925	ピーシーデポコボレーション		16	14.1	7,896	アークス		22.7	21.7	43,638
キリンホールディングス		4.8	4.2	7,564	壱番屋		8.6	7.4	42,994	パロールホールディングス		26.1	23.5	46,788
ホットランド		6.3	7.1	9,251	トップカルチャー		4.6	3.9	1,294	藤久		0.9	0.9	648
すいらーくホールディングス		112.6	119	245,616	P L A N T		2.9	2.8	1,582	ベルク		5.9	5.2	31,824
S F Pホールディングス		—	4.5	10,111	スキホールディングス		26.5	21.2	117,872	大 庄		6.5	5.7	9,547
綿半ホールディングス		4.5	4	7,804	義王堂ホールディングス		—	4.6	10,363	ファーストリテイリング		16.2	14.2	830,984
ヨシックス		2	1.7	4,807	ヴィア・ホールディングス		14.8	13.1	8,803	サンドラッグ		45.4	40	149,800
コイヤド・スードマーク・ホールディングス		35.2	30.9	30,312	スクロール		18.6	16.3	5,900	サクスパールホールディングス		10.2	9	7,731
ゴルフダイジェスト・オンライン		4.9	4.9	3,155	ヨンドシホールディングス		13.5	10.8	26,784	ヤマザワ		2.4	2	3,380
B E E N O S		2.8	4	5,100	ファミリーマート		33.8	84.9	212,844	やまや		2.1	2.1	4,735
あさひ		10	8	10,792	木曾路		14.8	13.9	41,769	ペルルーナ		29.6	22.7	14,709
日本調剤		4.3	3.3	12,490	S R Sホールディングス		14.3	12.5	13,175	銀行業 (5.6%)				
コスモ薬品		5.3	4.7	117,970	千趣会		21.9	19.2	9,388	島根銀行		2.7	2.1	1,365
トーエル		5.8	5.2	4,284	タカキュー		9.2	8.6	1,599	じもとホールディングス		82.1	72.2	7,581
オンリー		2.2	1.8	1,429	ケーヨー		22.4	21.8	12,164	めびきフィナンシャルグループ		628.6	552.6	138,702
セブ&アイ・ホールディングス		506.6	415.4	1,814,051	上新電機		14.3	12.5	28,912	東京海上ホールディングスグループ		16.3	14.4	18,561
薬王堂		5.2	—	—	日本瓦斯		19.6	16.8	61,236	九州フィナンシャルグループ		198.5	174.5	81,666
クワイート・レストラン・ホールディングス		32.6	28.6	67,467	ロイヤルホールディングス		21.4	18.6	44,993	ゆうちょ銀行		343.1	301.3	315,461
ツルハホールディングス		26.2	23.1	313,236	東天紅		0.8	0.8	1,017	富士第一銀行		29.2	25.4	8,458
サンマルクホールディングス		9.5	8.4	18,740	いなげや		13.6	13.2	19,892	コンコミア・フィナンシャルグループ		77.0	625.3	273,256
フェリシモ		2.7	2.3	2,288	鳥忠		27.3	20	65,900	西宮フィナンシャルホールディングス		77.4	72.5	53,505
トリドールホールディングス		14.9	13.2	35,204	チヨダ		12.7	11.1	16,772	鹿島らひフィナンシャルグループ		56.8	62.4	38,313
TOKYO BASE		10.7	9.6	4,992	ライフコーポレーション		9.2	8.1	22,113	十三フィナンシャルグループ		10.4	9.9	16,077
ウイルススホールディングス		1.1	1.6	1,456	リンガーハット		14.9	13.1	32,619	舞鶴フィナンシャルグループ		21	18.5	50,412
JMホールディングス		4.6	5.4	12,630	MrMa x HD		16.6	14.6	6,978	新生銀行		88.8	78	134,862
サツドラホールディングス		2	1.5	2,820	テアライド		11.5	9.8	4,380	あおぞら銀行		67.5	63.3	196,230
デファクトスタンダード		0.7	—	—	AOKIホールディングス		24.2	21.2	22,493	三井住友フィナンシャルグループ		8,428.8	7,320.8	4,241,671
アレサホールディングス		6.5	5.3	5,353	オークワ		17.2	16.6	25,564	りそなホールディングス		1,328	1,167	544,288
朝日田中ホールディングス		—	1.6	3,780	コメリ		18.7	16.4	39,064	三井住友トラスト・ホールディングス		237.9	201	823,899
パロクジャパリミテッド		9.7	7.3	7,248	青山商事		21.1	21.9	30,922	三井住友フィナンシャルグループ		853	735.5	2,908,167
グスリのアオキホールディングス		12	9.5	66,690	しまむら		14.1	12.3	101,967	千葉銀行		428.7	365.7	228,562
力の源ホールディングス		3.4	4.8	4,944	はせがわ		6.1	5.3	2,120	群馬銀行		242	209	76,494
スノーグローバルホールディングス		13.3	11.6	113,680	高島屋		94.7	77.4	93,499	武蔵野銀行		18	15.8	27,792
L I X I L ビバ		10.2	10.5	23,425	松屋		24.3	21.4	16,692	千葉興業銀行		33	29.2	10,482
メディカルシステムネットワーク		12.9	10.3	5,191	イチ・ツー・オー リテイリング		62.1	50.3	50,853	筑波銀行		50.4	44.4	9,590
はるやまホールディングス		5.5	4.5	3,955	近鉄百貨店		4.7	4	14,440	七十七銀行		37.9	35.9	60,778
ノジマ		21.6	18.9	43,791	バルコ		11.7	10.2	18,849	青森銀行		9.4	8.3	22,858
カップ・クリエイティブ		16.9	14.9	22,156	丸井グループ		102.3	97.3	232,255	秋田銀行		7.7	6.8	13,878
ライトオン		10.2	8	4,792	アフリアル リテイリング		10	8.8	34,056	山形銀行		13.7	11.9	17,695
ジーンズメイト		3.7	3.4	1,016	井筒屋		6.4	5.8	1,421	岩手銀行		8.5	6.9	18,126
良品計画		17.1	14.1	263,952	イオン		465.1	408.7	958,197	東邦銀行		108.2	95.1	24,250
三城ホールディングス		15.1	11.5	3,967	イズミ		24.5	21.6	77,112	東北銀行		6.3	5.1	5,293
アドヴァン		18.6	16.2	20,930	平和堂		24.5	21.5	42,462	みちのく銀行		7.7	6.8	9,676
アルビス		4.6	4	8,936	フジ		14.6	12.9	24,355	ふくおかフィナンシャルグループ		98.3	89.5	178,821
コナカ		15.7	12.5	5,100	ヤオコー		13.8	12	69,720	静岡銀行		304.5	263.3	207,480
ハウス オブ ローゼ		1.5	1.3	2,204	ゼビオホールディングス		14.6	12.9	15,531	十六銀行		16.2	13.4	30,337
G-7ホールディングス		3.5	6.2	15,276	ケーズホールディングス		125.5	102.5	144,627	スルガ銀行		123.7	108.8	47,219
イオン北海道		12.3	10.7	8,923	Olympicグループ		7.1	5.5	3,371	八十二銀行		218.9	256.7	110,381
コジマ		17.7	18.3	9,497	日産東販売ホールディングス		18.2	15.9	4,436	山梨中央銀行		15	12.3	12,915
ヒマラヤ		3.9	3.5	2,901	Genky DrugStores		4.7	5.2	10,634	大垣共立銀行		19.1	21	48,384
コーナン商事		15.9	15.1	37,463	ナルミヤ・インターナショナル		—	1.8	2,201	福井銀行		10.3	9.1	15,233
エコス		4.5	3.9	6,704	総合メディカルホールディングス		10.5	9.3	23,696	北國銀行		12.9	10.9	34,662
ワタミ		15.9	12.5	16,162	フクオクグループホールディングス		6.4	6.2	6,237	清水銀行		5	4.4	9,332
マルシェ		3.3	2.9	2,273	アインホールディングス		16.2	13.1	91,700	富士銀行		2.3	2	4,382
バルコフレイク・リテックホールディングス		72.5	233.4	470,067	元気寿司		3.4	2.7	8,410	滋賀銀行		24.2	21.3	57,211
西松屋チェーン		26.5	23.3	22,694	ヤマダ電機		368	323.6	189,953	南都銀行		14.2	17.6	46,622
センショールディングス		57	50.9	122,770	アークランドサカモト		20.5	16.6	20,484	百五銀行		108.8	95.7	32,155
幸楽苑ホールディングス		7.6	6.7	13,004	ニトリホールディングス		52.4	46	809,600	京都銀行		43.4	38	173,470
ハウズレイ		2.7	2	2,494	グルメ枠屋		8.8	7.5	9,067	紀陽銀行		42.9	37.6	61,250
サイゼリヤ		19.9	17.5	44,135	愛眼		9.7	8.3	2,116	ほくほくフィナンシャルグループ		80.6	70.7	75,861
VIホールディングス		41	44.1	19,977	ケーユーホールディングス		6.2	5.5	5,109	広島銀行		178.5	157.1	85,148
魚力		3.4	3	4,821	吉野家ホールディングス		42.3	34.9	89,972	山陰合同銀行		71.8	63	39,627
ポプテ		3.1	2.8	1,430	松屋フーズホールディングス		5.8	5.1	24,505	中国銀行		78.1	91.5	93,970
フジ・コーポレーション		2.5	2.9	6,148	サガミホールディングス		16.2	14.2	19,894	鳥取銀行		4.3	3.7	4,876
ユナイテッドアローズ		13.9	11.1	31,956	関西スーパーマーケット		9.2	8.9	9,238	伊予銀行		160.3	151.7	87,379
ハイデイ日高		15.9	15.3	31,043	王将フードサービス		8.9	7.8	51,324	百十四銀行		12.9	11.3	23,345

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	千株	株数	千円 評価額		株数	千株	株数	千円 評価額		株数	千株	株数	千円 評価額
四国銀行		17.3		16.1	日本モーゲージサービス		1.6		2.1	ダイビル		35.6		27.4
阿波銀行		19.4		17.3	CASA		4.1		3.7	京阪神戸ビルディング		21.7		17.2
大分銀行		7.4		6.1	アルビ		11		16.9	住友不動産		272	239.1	1,006.371
宮崎銀行		8		7	プレミアグループ		2.5		5.8	テオーシー		27.7		20.9
住友銀行		7.3		6.4	クレディセゾン		84.7		74.5	東京築天地		1.9		1.4
十八銀行		7.4		-	芙蓉総合リース		13.9		11.1	レオパレス21		149.3	139.4	45,862
沖縄銀行		11.1		9.7	みずほリース		22.7		16.4	スターツコーポレーション		16.4	14.5	39,222
琉球銀行		27.9		24.6	東京証券シュリー		24.4		21.4	フジ住宅		15.4	12.4	8,543
セブン銀行		408.8		355.3	日本証券金融		53.3		46.8	空港施設		14.4	10.8	5,950
みずほフィナンシャルグループ		16,445.7		14,451.2	アイフル		184.4		162.3	明和地所		6.7	5.9	3,681
高知銀行		4.5		4	リコリース		9.5		8.4	ゴールドクレスト		9.5	8.4	16,447
山口フィナンシャルグループ		151.1		132.8	イオンフィナンシャルサービス		77.2		65.1	エスロード		4.7	4.2	8,177
長野銀行		4.1		3.5	アコム		243.2		213.7	日神グループホールディングス		17.8	15.7	8,697
名古屋銀行		9.8		8.6	ジャックス		13.4		11.7	日本エスコ		21.9	19.2	17,683
北洋銀行		182.3		160.2	オリエントコーポレーション		327.1		287.8	タカラレーベン		56.6	48.7	24,398
愛知銀行		4.4		3.9	日立キャピタル		28.6		25.1	AVANTIA		6.8	6	6,012
中京銀行		5.5		4.9	アプラスフィナンシャル		58.7		51.2	イオンモール		60.6	53.3	101,270
大光銀行		4		3.7	オリックス		807.5		665.2	毎日コムネット		-	2.2	2,054
愛媛銀行		16.9		14.9	三菱UFJリース		273.1		269.9	ファースト住建		4.6	4.6	5,754
トマト銀行		4.8		4.1	九州リースサービス		5.9		5	ランド		492.6	589.5	6,484
京葉銀行		53.4		45.3	日本取引所グループ		326.8		305.3	カチタス		13.5	13.2	57,816
栃木銀行		62.7		51.4	イー・ギョランティ		11.3		11.4	トーセイ		16.6	14.7	21,226
北日本銀行		3.9		3.4	アサックス		4.9		5.5	穴吹興産		1.3	2.2	3,839
東和銀行		21.2		18.7	NECキャピタルソリューション		5		4.3	サンフロンティア不動産		16.7	14.7	19,845
福島銀行		10.5		10.4	不動産業 (2.5%)					エフ・ジー・ネクスト		10.5	9.3	11,104
大東銀行		5.8		5.6	いちご		153.9		135.3	インテリックス		3.5	3.1	2,256
トモニホールディングス		93.5		82.3	日本駐車場開発		145.8		117.2	ランドビズネス		6.2	4.3	3,220
フィデアホールディングス		117.8		103.6	スター・マイカ・ホールディングス		-		5.5	日本社宅サービス		-	2.8	3,068
池田泉州ホールディングス		128.5		122.8	ヒューリック		252.6		227.1	グランディハウス		10.6	8.3	4,257
証券先物取引業 (0.8%)					三栄建築設計		4.9		4.3	日本空港ビルデング		38.6	34	187,000
FPG		38.7		32.8	スター・マイカ		5.5		-	サービス業 (5.2%)				
マーキュリアンベストメント		4.7		4.7	新井不動産ホールディングス		80.6		64.5	日本工営		7.8	6.9	25,047
SB Iホールディングス		144.2		118.8	三重交通グループホールディングス		24.6		21.5	LIFULL		40.7	36	20,988
日本アジア投資		10.5		9.3	サムディ		16.7		15.1	ジェイシーワールメント		9.4	6.9	11,861
ジャフコ		19.8		16.3	ディア・ライフ		15.4		13.7	日本M&Aセンター		87.3	77.8	297,974
大和証券グループ本社		971.1		853.2	コーセーアールイー		3.7		3.2	メンバーズ		4	3.1	5,164
野村ホールディングス		2,129.4		1,871.3	イー・ディー・ワークス		171.5		201.8	中広		1.1	1.1	606
岡三証券グループ		103.1		90.6	日本商業開発		7.5		6.7	UTグループ		-	12.1	31,798
丸三証券		35.9		31.5	プラザスコポレーション		19.1		17.4	アイティメディア		-	3.1	3,295
東洋証券		43.4		38.2	ユニソールホールディングス		18.3		16	タケイ		12.2	9.9	10,692
東興証券		144.3		122	THEグローバル社		5.5		5.5	E・Jホールディングス		1.5	1.2	2,104
光世証券		2.9		2.5	ハウスコム		-		1.4	ビーネット		5.6	11.3	12,825
水戸証券		35.1		30.8	日本管理センター		7.9		7	コジカホールディングス		31.3	24.8	38,564
いちよし証券		25.4		19.8	サンセイラディック		3.2		3.2	アルトナー		2.2	2.5	2,115
松井証券		59.3		60.7	エストラスト		1.6		1.4	パソナグループ		14.3	11.1	15,873
だいがう証券ビジネス		5		5.2	フージャースホールディングス		27		21.2	CDS		2.9	2.5	3,817
マネックスグループ		113		80.3	オープンハウス		19.7		30.9	リンクアンドモチベーション		21.6	22.7	12,598
カブドットコム証券		90.4		-	東急不動産ホールディングス		325.4		289.3	GCA		12	12.4	11,656
株元証券		16.2		14.3	郵船グループホールディングス		101		88.7	エス・エム・エス		43.1	32	75,008
岩井コスモホールディングス		12.4		10	イギリスランド		1.8		1.7	サイノサイドアップグループ		-	2.3	2,467
藍澤證券		22.7		19.1	ムゲンエステート		8.5		7.3	パーソルホールディングス		117.3	103	224,334
マネバートナズグループ		14.2		11.5	ビーロッド		2		2.4	リニカル		6.6	5	5,445
スパークスグループ		-		36.8	ファーストプラザーズ		3.3		2.4	クックパッド		36.7	36.1	11,876
小林洋行		3.4		3.2	ハウスドゥ		4.5		5.9	エスクリ		3.2	3.3	2,554
保険業 (2.3%)					シーアールイー		4		2.7	アイ・ケイ・ケイ		5.8	5.1	3,768
かんぽ生命保険		45.7		37.6	プロバティエージェント		1.1		1.6	学情		4.7	3.7	8,839
SOMPOホールディングス		213.3		200	ケイアイスター不動産		3.2		3.4	スタジオアリス		5.8	5.2	9,916
アコムホールディングス		9.4		8.8	アグレ都市デザイン		1.5		1.5	シミックホールディングス		6.5	5.7	9,792
MS&Iフィナンシャルグループホールディングス		316.5		278	グッドコムアセット		2.2		2.4	エプロ		-	1.6	2,208
ソニーフィナンシャルホールディングス		99.9		87.4	ジェイ・エス・ビー		0.4		1.1	NJS		2.6	2.2	3,984
第一生命ホールディングス		684.7		601.8	トンボイノベーション		-		2.4	綜合警備保障		46.6	41	234,110
東京海上ホールディングス		438.8		380.3	グローバル・リンク・マネジメント		-		1.7	カカコム		88.3	77.1	237,468
T&Dホールディングス		374.2		317.8	パーク24		70.6		57.1	アイロムグループ		4.5	3.7	5,979
アドバンスクリエイト		2.8		2.4	バラカ		3.1		2.8	セントケア・ホールディング		6.4	6.7	3,202
その他金融業 (1.2%)					三井不動産		642.2		524.5	サイネックス		1.8	1.7	1,166
全国保証		34.1		30	三菱地所		847.9		745.2	ルネサンス		6.5	5.7	10,014
ジェイリース		2.6		3	平和不動産		23		19.5	ディップ		18.9	14.5	53,287
インタラスト		3.4		3.8	東京建物		132.2		116.3	オプトホールディング		7.1	5.6	9,077

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
新日本科学		千株		千円	リソルホールディングス		千株		千円	東 祥		千株		千円
ツワイ	15.9	11.2	7,033		テクノ/プロ・ホールディングス	23.6	20.7	160,425		エイチ・アイ・エス	20.9	16	42,672	
キャリアデザインセンター	27.6	24.3	14,045		アトラ	2.3	2.3	731		ラックランド	2.3	2.1	4,653	
ペネフィット・ワン	3	2.7	3,310		インターワークス	2.3	1.9	1,035		共立メンテナンス	17.8	17	77,860	
エムスリー	246.9	227.1	717,636		アイ・アールジャパンホールディングス	3.8	4.2	25,620		イネンホールディングス	12.3	11.5	17,342	
ツカガ・グローバルホールディング	7.5	6.7	3,906		KeepPer 技研	3.9	3.9	4,917		建設技術研究所	8	7.1	17,366	
プラス	0.8	0.8	642		ファーストロジック	2.3	2.3	1,389		スペース	7.6	6.7	8,220	
アウトソーシング	61.8	59	58,705		三機サービス	1.9	2.1	2,230		長 大	4.7	3.8	4,742	
ウェルネット	11.9	9.8	6,967		Gunosy	7.2	7.1	8,889		燐ホーディングス	2.6	4.5	7,650	
ワールドホールディングス	3.2	3.5	5,992		デザインワン・ジャパン	2.3	2	612		スバル興業	0.7	0.6	5,682	
ディー・エヌ・エー	63.2	50.5	77,416		イー・ガーディアン	5.5	5.2	10,826		東京テアトル	4.6	4.1	5,629	
博報堂DYホールディングス	16.3	143.3	230,283		リブセックス	6.3	6.7	1,943		タナベ経営	2.3	1.9	2,447	
ぐるなび	16.6	18	15,588		ジャパンマテリアル	32.1	31.7	51,956		ナガワ	3.3	3.3	22,968	
タカミヤ	12.2	11	6,743		バクトル	14.3	12.9	15,763		よみうりランド	2.6	2.2	9,779	
ジャパンストレスキューシステム	9.3	6.9	6,575		ウチヤマホールディングス	5.9	5.2	2,631		東京都競馬	7.6	6.7	21,105	
ファンコミュニケーションズ	32.2	28.4	13,546		チャーム・ケア・コーポレーション	—	7.5	6,787		常盤興産	4.8	4.2	7,123	
ライク	4.6	4.1	8,019		ライクキッズ	2.5	2.4	2,056		カナモト	17.4	16.8	47,107	
ビジネス・ブレイクスルー	4.9	4.4	1,760		キャリアリンク	4.3	3.4	1,989		東京ドーム	43.8	41.8	43,555	
エスピーール	—	19.9	16,954		I B J	7.8	7	8,890		西尾レントオール	12	10.5	31,657	
WDBホールディングス	5.3	4.7	12,925		Aサンテ	4.7	4.2	8,211		アソナ・ネスタリテイィーグループ	63	69	2,139	
ティア	5.4	6.1	3,684		N・フィールド	7.5	7.1	4,409		トランス・コスモス	13	9.8	28,586	
CDG	1.1	1.1	1,548		パリュウHR	2.5	2	6,080		乃村工藝社	27.3	44.2	57,902	
パリュウコマーヌ	7.8	5.8	15,549		M&Aキャピタルパートナーズ	3	7.3	28,141		藤田観光	4.7	4.5	12,325	
インフォマート	64.3	112.9	99,803		リドオエストリアルホールディングス	4.8	3.9	7,335		KNT-CTホールディングス	6.3	6.4	8,499	
JPホールディングス	33.5	32.4	10,335		ERLホールディングス	3.3	3	2,391		日本管財	12.6	11	21,307	
Eコナックホールディングス	22.2	18.8	2,838		アビスト	1.9	1.6	4,214		トーカイ	11.3	10	28,110	
E P Sホールディングス	17.6	15.5	21,002		シグマクシス	5.5	7	12,964		白洋舎	1.3	1.1	3,098	
レックス	2.9	2.5	3,937		ウィルグループ	7.5	6.7	7,376		セコム	124.4	109.3	1,066,002	
プラスター・インターナショナル	2.2	38.6	39,951		エスコロー・エージェンシー・ジャパン	16.1	14.5	3,175		セントラル警備保障	5.6	5	29,800	
アミューズ	7.1	5.6	15,870		日本ビューホテル	3.8	—	—		丹青社	22.2	19.5	24,960	
ドリームインキュベータ	3.5	3.2	5,635		リクルートホールディングス	839.9	738	3,335,760		メイテック	14.8	12.7	79,756	
クイック	7.2	6.4	9,516		エラン	8	6.1	10,553		応用地質	12.6	11.1	15,784	
TAC	6.8	6.7	1,413		土木管理総合試験所	5.1	4.5	1,917		船井総研ホールディングス	24.3	21.3	68,905	
ケネディクス	103	98	57,036		ネットマーケティング	—	3.8	3,792		進学会ホールディングス	5.2	4.1	2,099	
電通グループ	142.9	106.2	388,692		日本郵政	961.1	844.5	870,257		オオバ	9.3	8.1	6,285	
ディファンドギザ・ニーズ	4.5	4	4,084		ベルシス24ムホールディングス	19.6	17.2	27,124		いであ	2.3	1.9	4,081	
ぴあ	3.3	2.9	13,006		鎌倉新書	8.6	7.6	13,026		学究社	4	3.1	4,532	
イオンファンタジー	3.8	4	9,696		SMN	—	1.6	1,408		ベネッセホールディングス	43	34.3	107,016	
シーティーエス	13.3	11.6	8,096		一蔵	1.5	1.1	759		イオンティライト	14.3	12.7	48,895	
ネクシズグループ	3.7	3.6	5,770		L I T A L I C O	2.7	3.6	10,090		ナック	7.4	5.7	6,526	
みらかホールディングス	32.9	28.9	87,422		グローバルキッズCOMPANY	1.4	1.5	1,191		ニチイ学館	16.7	14.7	22,402	
アルプス技研	10.2	9.1	19,383		エアトリ	3.3	4.6	7,433		ダイセキ	19.6	17.2	51,600	
サニックス	20.5	18.1	5,792		アトラエ	2.3	2.7	10,233		ステップ	4.4	3.8	6,456	
ダイオーズ	2.8	2	2,758		ストライク	3	3.9	20,358						
日本空調サービス	13.4	10.8	8,121		ソラスト	28.5	28.4	32,972						
オリエンタルランド	138.6	109.5	1,605,270		セラク	2.6	3.3	4,217		合計	株数・金額 142,571.8 銘柄数<比率> 2,113銘柄	千株 127,662.7 銘柄 2,151銘柄	千円 263,153,477. <97.6%>	
ダスキン	31.6	26.4	80,784		インソース	3.9	5	16,325						
明光ネットワークジャパン	14.8	12.1	11,567		ベイカレント・コンサルティング	6.2	6.2	51,398		(注1) 銘柄欄の () 内は、期末の国内株式評				
ファルコホールディングス	6.5	5.7	12,323		Orchestra Holdings	—	2	2,392		価総額に対する各業種の比率です。				
秀英予備校	2.5	2.3	1,051		アイモバイル	2.8	3.3	2,293		(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に				
田谷	2.1	2	1,272		キャリアインデックス	4	4.2	1,575		対する評価額の比率です。				
ラウンドワン	36.3	28.8	30,441		MS-Japan	4.7	3.4	4,399		(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。				
リゾートトラスト	49.6	47.2	83,449		船場	2.1	1.7	1,762						
ビー・エム・エル	15.1	13.3	42,227		グレイステクノロジー	3.2	4.7	14,476						
ワタベウエディング	1.9	1.6	864		ジャウエレベーターサービスホールディングス	6.9	10.8	26,470						
りらほコミュニケーションズ	21.2	18.7	27,788		フルテック	1.3	1.2	1,422						
リソー教育	59.5	47.1	17,662		グリーンズ	2.6	3.9	3,634						
早稲田アカデミー	1.6	3.4	3,678		ツナググループ・ホールディングス	1	1.2	882						
ユー・エス・エス	143.3	115.4	231,492		GAMEWITH	—	2.2	1,630						
東京個別指導学院	4.2	3.7	2,641		ソウルドアウト	—	1.6	3,478						
サイバーエージェント	72.3	59.3	259,437		MS&Consulting	—	1.4	1,568						
楽天	546.6	480.2	419,694		日総工産	2.9	6.8	5,718						
クワーク・アンド・リバー社	6.8	5.3	5,575		キューベネットホールディングス	5.9	4.3	10,311						
テー・オー・ダブリュー	11.2	9	8,361		RPAホールディングス	—	5.8	6,119						
山田コンサルタントグループ	—	5	7,390		スプリックス	3.3	3.5	3,941						
セントラルスポーツ	4.4	3.9	11,973		マネジメントソリューションズ	—	1.1	3,982						
フルキャストホールディングス	11.8	10.3	25,544		アドバテッジリスコムマネジメント	4.6	5.2	4,680						
エン・ジャパン	12.8	18.4	85,560		リログループ	64.1	56.3	171,996						

(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 6,514		百万円 -

■投資信託財産の構成

2020年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 263,153,477		% 95.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,850,991		4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	275,004,469		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

(2020年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	275,805,961,791円
コ ー ル ・ 公 ー ン 産 等	11,473,389,265
株 式(評価額)	263,153,477,450
未 収 入 金	140,926,920
差 入 収 配 入 当 金	415,029,156
(B) 負 債	6,045,704,260
未 払 金	5,048,362,260
差 入 委 託 証 拠 金	193,592,000
(C) 純 資 産	803,750,000
元 本	269,760,257,531
次 期 繰 越 損 益	98,370,254,055
(D) 受 益 権 総 額	171,390,003,476
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	98,370,254,055円 27,423円

(注1) 期首元本額	115,232,523,115円
追加設定元本額	39,816,140,869円
一部解約元本額	56,678,409,929円
(注2) 期末における元本の内訳	
One DC 国内株式インデックスファンド	13,753,125,332円
D I AM国内株式パッシブ・ファンド	2,300,256,155円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,872,943円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	5,009,685円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	7,743,904円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,418,134円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,818,754円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	10,586,919円
たわらノーロード TOP I X	545,594,662円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	324,239,506円
たわらノーロード バランス(堅実型)	10,938,893円
たわらノーロード バランス(標準型)	67,669,431円
たわらノーロード バランス(積極型)	103,376,978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)	439,198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)	31,315,589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)	98,543,681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)	66,484,262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)	135,912,579円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	193,848円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	830,832円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,814,864円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,287,993円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,036,718円
D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,349,147,451円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	994,502,045円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,256,411,336円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,366,803,245円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	348,375,776円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	1,182,324,299円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	1,119,029,562円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	38,945,261円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	1,120,067,435円
マネックス資産設計ファンド エゴリ ューション	25,180,737円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	307,430,970円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	239,536,588円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	419,353,751円
投資のソムリエ	8,729,703,223円
クルーズコントロール	410,638,853円
投資のソムリエ<DC年金>	829,749,325円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	261,682,155円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	316,105,471円
クルーズコントロール<DC年金>	412,795円
D I AMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,507,282円
D I AMコア資産設計ファンド(積極型)	7,001,423円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,307,956円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,017,761,432円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	5,883,416円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,725,965円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,914,158円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	13,386,629円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	35,525,818円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,093,711,974円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	217,750,260円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	900,539円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	766,807円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	889,213円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	197,398円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	97,721,972円
D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,537,910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)	748,659,317円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	42,276,864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)	90,882,753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)	205,217,487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)	13,081,740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)	49,099,169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)	14,085,281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)	11,090,446円
D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,577,334円
D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,241,538円
D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	856,834,056円
D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	856,427,853円
D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,443,533,162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)	174,658,821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)	48,206,798円
D I AM アスク グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	469,721,881円
D I AM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家限定)	125,441,570円
D I AM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,312,004円
D I AM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	35,583,091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)	490,063,850円
D I AM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	37,551,836円
D I AM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	134,171,540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)	347,374,438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)	876,490,927円
D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	53,451,662円
D I AM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	23,728,407円
D I AMバランス20VA(適格機関投資家限定)	13,986,618円
D I AMバランス40VA(適格機関投資家限定)	104,317円
D I AMバランス60VA(適格機関投資家限定)	121,717円
D I AM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)	380,720,505円
D I AM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)	1,210,952,937円
D I AM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)	1,605,155,025円
D I AM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)	65,047,821円
期末元本合計	98,370,254,055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	1,965,500,000円

■損益の状況

当期 自2019年2月8日 至2020年2月7日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	金	6,474,619,048円
受 取 配 当	金	6,470,932,929
そ の 他 収 益	金	6,596,035
支 払 利 息	金	△2,909,916
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	益	25,090,512,011
売 買 益	益	37,376,506,942
売 買 損	損	△12,285,994,931
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	益	549,897,040
取 引 益	益	1,316,074,846
取 引 損	損	△766,177,806
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		32,115,028,099
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		163,951,791,282
(F) 解 約 差 損 益 金		△85,804,876,036
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		61,128,060,131
(H) 合 計(D + E + F + G)		171,390,003,476
次 期 繰 越 損 益 金(H)		171,390,003,476

(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) (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。

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17期 (決算日 2020年2月14日)

(計算期間 2019年2月15日～2020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。 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。 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				
13期 (2016年2月15日)	12,614	3.7	ポイント 373.37	% 3.7	% 98.6	% -	% -	百万円 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
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	-	-	222,859

(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

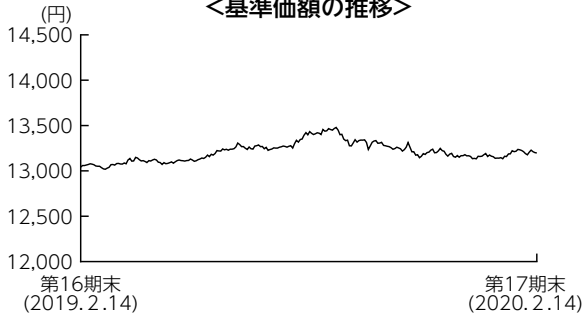
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率 比	新株予約債 (転換社債) 率	債券先物率 比
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2019年 2月14日	円 13,042	% -	ポイント 386.15	% -	% 99.3	% -	% -
2 月 末	13,051	0.1	386.43	0.1	99.2	-	-
3 月 末	13,142	0.8	389.14	0.8	99.4	-	-
4 月 末	13,101	0.5	387.94	0.5	98.8	-	-
5 月 末	13,183	1.1	390.32	1.1	99.4	-	-
6 月 末	13,263	1.7	392.69	1.7	99.2	-	-
7 月 末	13,278	1.8	393.15	1.8	99.4	-	-
8 月 末	13,456	3.2	398.50	3.2	98.8	-	-
9 月 末	13,313	2.1	394.27	2.1	101.5	-	-
10 月 末	13,262	1.7	392.61	1.7	99.5	-	-
11 月 末	13,217	1.3	391.33	1.3	99.7	-	-
12 月 末	13,178	1.0	390.14	1.0	100.7	-	-
2020年 1 月 末	13,233	1.5	391.77	1.5	98.9	-	-
(期 末) 2020年 2月14日	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	-	-

(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 (2019年2月15日から2020年2月14日まで)

<基準価額の推移>



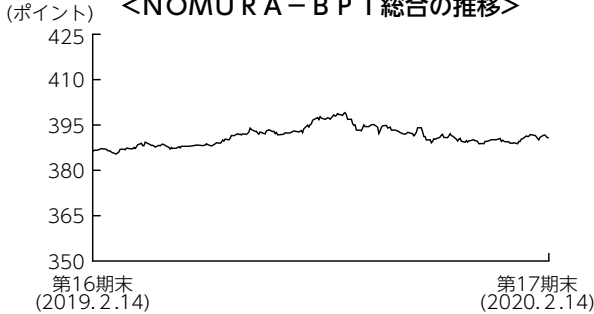
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は13,197円となり、前期末比で1.2%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、米欧中央銀行の金融緩和観測などを背景に、基準価額は概ね上昇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から、上昇幅は縮小しました。

<NOMURA-BPI総合の推移>



投資環境

国内債券市場では、利回りが低下（価格は上昇）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から、低下幅は縮小しました。

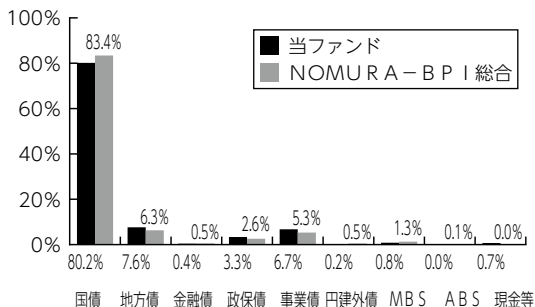
ポートフォリオについて

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。

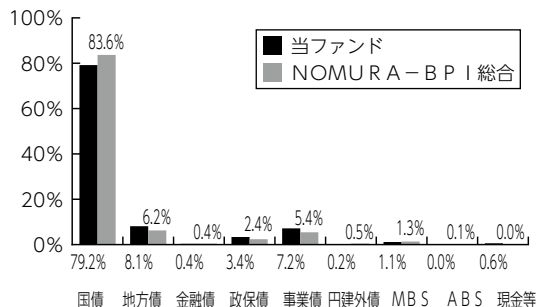
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

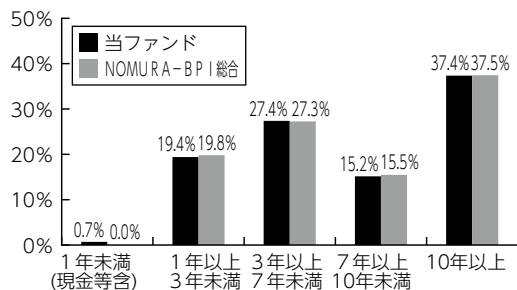


期末

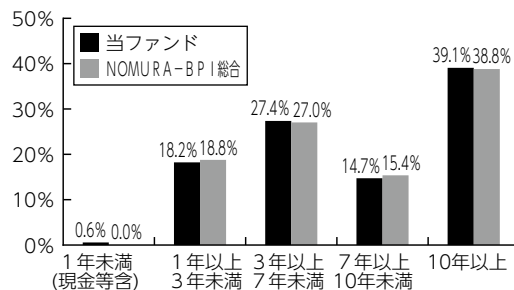


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、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+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

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況（2019年2月15日から2020年2月14日まで）

公社債

		買付額	売付額
国	内	千円 国債証券	千円 161,330,716 (-)
		地方債証券	5,193,999 (-)
		特殊債券	2,537,310 (190,215)
		社債券	5,064,157 (-)
		101,489,234	
		1,154,420	
		588,183	
		821,439	

(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（2019年2月15日から2020年2月14日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決算期 区分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公社債	百万円 104,053	百万円 8,065	% 7.8	百万円 174,126	百万円 18,207	% 10.5

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

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 B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国 債 証 券	千円 159,940,000	千円 176,414,100	% 79.2	% -	% 56.3	% 15.5	% 7.3
地 方 債 証 券	17,450,000	18,054,906	8.1	6.7	2.4	4.1	1.6
特 殊 債 券	14,698,867	15,758,836	7.1	-	4.4	2.2	0.5
金 融 債 券	800,000	800,829	0.4	-	-	0.0	0.3
普 通 社 債 券	10,181,000	10,545,134	4.7	0.1	1.1	3.1	0.5
合 計	203,069,867	221,573,805	99.4	6.8	64.3	25.0	10.2

(注1) 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。

(注2) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(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	
313回 利付国庫債券(10年)	1.3000	1,180,000	1,198,526	2021/03/20
314回 利付国庫債券(10年)	1.1000	800,000	810,816	2021/03/20
399回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,000,000	1,002,790	2021/04/01
128回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,200,000	2,207,348	2021/06/20
315回 利付国庫債券(10年)	1.2000	1,500,000	1,527,015	2021/06/20
316回 利付国庫債券(10年)	1.1000	1,000,000	1,016,670	2021/06/20
129回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,120,000	2,128,437	2021/09/20
317回 利付国庫債券(10年)	1.1000	600,000	611,892	2021/09/20
318回 利付国庫債券(10年)	1.0000	1,400,000	1,425,522	2021/09/20
130回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,780,000	1,788,188	2021/12/20
319回 利付国庫債券(10年)	1.1000	800,000	818,352	2021/12/20
320回 利付国庫債券(10年)	1.0000	900,000	918,990	2021/12/20
408回 利付国庫債券(2年)	0.1000	800,000	803,752	2022/01/01
131回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,420,000	1,427,412	2022/03/20
321回 利付国庫債券(10年)	1.0000	800,000	819,152	2022/03/20
322回 利付国庫債券(10年)	0.9000	500,000	510,925	2022/03/20
132回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,200,000	1,207,032	2022/06/20
323回 利付国庫債券(10年)	0.9000	750,000	768,375	2022/06/20
324回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,050,000	1,073,257	2022/06/20
133回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,180,000	1,187,811	2022/09/20
325回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,300,000	1,331,915	2022/09/20
134回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,180,000	1,188,566	2022/12/20
326回 利付国庫債券(10年)	0.7000	500,000	512,110	2022/12/20
327回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,200,000	1,232,484	2022/12/20

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	
135回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,040,000	1,048,216	2023/03/20
328回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,090,000	1,115,331	2023/03/20
136回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,250,000	1,260,900	2023/06/20
329回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,770,000	1,826,392	2023/06/20
137回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,400,000	1,412,880	2023/09/20
330回 利付国庫債券(10年)	0.8000	450,000	465,507	2023/09/20
331回 利付国庫債券(10年)	0.6000	650,000	667,706	2023/09/20
138回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,450,000	1,464,268	2023/12/20
332回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,410,000	1,451,101	2023/12/20
139回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,300,000	1,313,351	2024/03/20
333回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,650,000	1,701,199	2024/03/20
140回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,300,000	1,313,611	2024/06/20
334回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,770,000	1,827,949	2024/06/20
141回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,410,000	1,425,298	2024/09/20
335回 利付国庫債券(10年)	0.5000	1,900,000	1,957,057	2024/09/20
72回 利付国庫債券(20年)	2.1000	350,000	386,298	2024/09/20
142回 利付国庫債券(5年)	0.1000	500,000	505,595	2024/12/20
336回 利付国庫債券(10年)	0.5000	700,000	722,526	2024/12/20
337回 利付国庫債券(10年)	0.3000	1,090,000	1,114,176	2024/12/20
73回 利付国庫債券(20年)	2.0000	340,000	375,533	2024/12/20
338回 利付国庫債券(10年)	0.4000	1,730,000	1,778,751	2025/03/20
75回 利付国庫債券(20年)	2.1000	140,000	156,100	2025/03/20
339回 利付国庫債券(10年)	0.4000	1,790,000	1,842,464	2025/06/20
78回 利付国庫債券(20年)	1.9000	190,000	210,841	2025/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評 価 額
(国債証券)	%	千円	千円	
340回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,900,000	1,958,330	2025/09/20
81回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	240,000	268,929	2025/09/20
341回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	1,910,000	1,960,042	2025/12/20
342回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,980,000	2,009,145	2026/03/20
85回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	440,000	500,486	2026/03/20
343回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,780,000	1,807,305	2026/06/20
88回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	350,000	404,600	2026/06/20
344回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,930,000	1,960,802	2026/09/20
90回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	700,000	808,927	2026/09/20
345回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,710,000	1,738,334	2026/12/20
92回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	870,000	1,004,545	2026/12/20
346回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,920,000	1,952,275	2027/03/20
93回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	250,000	288,180	2027/03/20
94回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	450,000	521,941	2027/03/20
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,560,000	1,586,566	2027/06/20
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	350,000	412,846	2027/06/20
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,630,000	1,658,084	2027/09/20
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	588,840	2027/09/20
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,760,000	1,790,624	2027/12/20
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	450,000	528,628	2027/12/20
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,250,000	2,288,542	2028/03/20
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	600,000	712,476	2028/03/20
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,860,000	1,890,466	2028/06/20
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	360,000	435,297	2028/06/20
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,720,000	1,747,520	2028/09/20
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	475,412	2028/09/20
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	350,000	419,013	2028/09/20
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,500,000	1,523,355	2028/12/20
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	477,192	2028/12/20
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	400,000	470,076	2028/12/20
354回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,470,000	1,492,152	2029/03/20
109回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	220,000	259,388	2029/03/20
110回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	330,000	395,112	2029/03/20
355回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,450,000	1,471,083	2029/06/20
111回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	290,000	351,207	2029/06/20
112回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	550,000	660,924	2029/06/20
356回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,330,000	1,348,566	2029/09/20
1回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	100,000	127,276	2029/09/20
113回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	770,000	929,058	2029/09/20
357回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	400,000	405,328	2029/12/20
114回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	550,000	665,923	2029/12/20
115回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	200,000	244,128	2029/12/20
2回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	124,330	2030/02/20
116回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	450,000	551,227	2030/03/20
117回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	650,000	789,646	2030/03/20
3回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	247,666	2030/05/20
118回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	310,000	374,669	2030/06/20
119回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	300,000	356,370	2030/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評 価 額
(国債証券)	%	千円	千円	
120回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	400,000	466,880	2030/06/20
121回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	540,000	648,982	2030/09/20
122回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	350,000	416,930	2030/09/20
4回 利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	262,384	2030/11/20
123回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	430,000	527,868	2030/12/20
124回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	250,000	304,190	2030/12/20
125回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	360,000	447,296	2031/03/20
126回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	340,000	414,915	2031/03/20
127回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	302,317	2031/03/20
128回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	550,000	666,957	2031/06/20
129回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	290,000	348,388	2031/06/20
130回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	580,000	698,557	2031/09/20
131回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	300,000	357,858	2031/09/20
6回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	255,378	2031/11/20
132回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	440,000	526,367	2031/12/20
133回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	570,000	688,605	2031/12/20
134回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	520,000	629,688	2032/03/20
135回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	350,000	419,622	2032/03/20
136回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	200,000	237,380	2032/03/20
137回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	350,000	420,549	2032/06/20
138回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	280,000	329,576	2032/06/20
139回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	430,000	511,407	2032/06/20
140回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	920,000	1,108,517	2032/09/20
8回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	200,000	243,918	2032/11/22
141回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	650,000	784,810	2032/12/20
142回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	400,000	488,048	2032/12/20
143回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	560,000	670,656	2033/03/20
144回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	310,000	367,238	2033/03/20
11回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	200,000	242,594	2033/06/20
145回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	840,000	1,018,894	2033/06/20
12回 利付国庫債券 (30年)	2.1000	200,000	253,966	2033/09/20
146回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	850,000	1,033,719	2033/09/20
13回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	100,000	126,019	2033/12/20
147回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	980,000	1,181,448	2033/12/20
14回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	290,000	382,640	2034/03/20
148回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	690,000	823,597	2034/03/20
15回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	200,000	267,654	2034/06/20
149回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	900,000	1,076,571	2034/06/20
16回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	150,000	201,330	2034/09/20
150回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	950,000	1,124,344	2034/09/20
17回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	266,478	2034/12/20
151回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	820,000	948,412	2034/12/20
18回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	320,000	423,046	2035/03/20
152回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	890,000	1,030,121	2035/03/20
19回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	265,062	2035/06/20
153回 利付国庫債券 (20年)	1.3000	890,000	1,045,002	2035/06/20
20回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	200,000	272,216	2035/09/20
154回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	850,000	986,697	2035/09/20

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	
2 1回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	266,730	2035/12/20
1 5 5回	利付国庫債券 (20年)	1.0000	860,000	972,333	2035/12/20
2 2回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	320,000	438,108	2036/03/20
1 5 6回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	780,000	808,087	2036/03/20
2 3回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	200,000	274,728	2036/06/20
1 5 7回	利付国庫債券 (20年)	0.2000	850,000	852,694	2036/06/20
2 4回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	190,000	261,846	2036/09/20
1 5 8回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	860,000	904,324	2036/09/20
2 5回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	269,956	2036/12/20
1 5 9回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	850,000	907,596	2036/12/20
2 6回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	400,000	548,096	2037/03/20
1 6 0回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	700,000	759,073	2037/03/20
1 6 1回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	800,000	854,328	2037/06/20
2 7回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	420,000	586,126	2037/09/20
1 6 2回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	800,000	854,368	2037/09/20
1 6 3回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	770,000	822,336	2037/12/20
2 8回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	480,000	673,862	2038/03/20
1 6 4回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	910,000	955,145	2038/03/20
1 6 5回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	740,000	776,519	2038/06/20
2 9回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	560,000	780,802	2038/09/20
1 6 6回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	750,000	814,290	2038/09/20
1 6 7回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	800,000	839,000	2038/12/20
3 0回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	570,000	788,595	2039/03/20
1 6 8回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	700,000	720,433	2039/03/20
1 6 9回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	750,000	757,612	2039/06/20
3 1回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	600,000	823,098	2039/09/20
1 7 0回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	630,000	635,877	2039/09/20
1 7 1回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	250,000	252,122	2039/12/20
3 2回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	760,000	1,063,042	2040/03/20
3 3回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	740,000	996,498	2040/09/20
3 4回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	670,000	933,544	2041/03/20
3 5回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	820,000	1,113,937	2041/09/20
3 6回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	800,000	1,091,864	2042/03/20
3 7回	利付国庫債券 (30年)	1.9000	790,000	1,065,291	2042/09/20
3 8回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	570,000	759,507	2043/03/20
3 9回	利付国庫債券 (30年)	1.9000	480,000	651,763	2043/06/20
4 0回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	450,000	602,014	2043/09/20
4 1回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	460,000	605,967	2043/12/20
4 2回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	510,000	673,398	2044/03/20
4 3回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	500,000	661,015	2044/06/20
4 4回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	490,000	649,318	2044/09/20
4 5回	利付国庫債券 (30年)	1.5000	500,000	639,430	2044/12/20
4 6回	利付国庫債券 (30年)	1.5000	630,000	807,307	2045/03/20
4 7回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	540,000	706,131	2045/06/20
4 8回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	590,000	744,231	2045/09/20
4 9回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	560,000	706,865	2045/12/20
5 0回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	540,000	601,678	2046/03/20
5 1回	利付国庫債券 (30年)	0.3000	570,000	563,804	2046/06/20

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	
5 2回	利付国庫債券 (30年)	0.5000	580,000	602,625	2046/09/20
5 3回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	600,000	638,364	2046/12/20
5 4回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	600,000	669,276	2047/03/20
5 5回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	590,000	657,879	2047/06/20
5 6回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	550,000	613,041	2047/09/20
5 7回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	650,000	725,114	2047/12/20
5 8回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	710,000	791,699	2048/03/20
5 9回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	580,000	631,515	2048/06/20
6 0回	利付国庫債券 (30年)	0.9000	500,000	571,465	2048/09/20
6 1回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	500,000	543,700	2048/12/20
2回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	280,000	420,064	2049/03/20
6 2回	利付国庫債券 (30年)	0.5000	500,000	516,390	2049/03/20
6 3回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	570,000	573,003	2049/06/20
6 4回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	500,000	501,990	2049/09/20
6 5回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	200,000	200,802	2049/12/20
3回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	290,000	439,016	2050/03/20
4回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	430,000	657,624	2051/03/20
5回	利付国庫債券 (40年)	2.0000	480,000	711,532	2052/03/20
6回	利付国庫債券 (40年)	1.9000	450,000	658,768	2053/03/20
7回	利付国庫債券 (40年)	1.7000	480,000	678,360	2054/03/20
8回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	520,000	689,535	2055/03/20
9回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	780,000	778,767	2056/03/20
1 0回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	770,000	900,145	2057/03/20
1 1回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	580,000	658,851	2058/03/20
1 2回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	380,000	391,517	2059/03/20
小 計		-	159,940,000	176,414,100	-
(地方債証券)		%	千円	千円	
2 3年度 1回	千葉市公募公債	1.3700	200,000	203,200	2021/04/21
2 3年度 2回	埼玉県公募公債	1.1900	200,000	202,994	2021/05/25
6 9 7回	東京都公募公債	1.1100	500,000	507,330	2021/06/18
9 9回	共同発行市場公募地方債	1.1700	700,000	710,983	2021/06/25
7 0 1回	東京都公募公債	0.9900	700,000	710,843	2021/09/17
2 3年度 4回	横浜市公募公債	1.0450	450,000	458,073	2021/11/12
2 3年度 9回	静岡県公募公債	1.0450	200,000	203,660	2021/11/25
3 5 6回	大阪府公募公債	1.0600	200,000	203,896	2021/12/27
1 0 6回	共同発行市場公募地方債	0.9700	300,000	305,568	2022/01/25
2 3年度 2 0回	愛知県公募公債	1.0820	500,000	511,295	2022/03/29
1 0 9回	共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	511,340	2022/04/25
7 0 8回	東京都公募公債	0.8900	500,000	510,255	2022/06/20
1 1 1回	共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	714,427	2022/06/24
3 6 4回	大阪府公募公債	0.7900	300,000	306,081	2022/09/27
1 9 4回	神奈川県公募公債	0.7910	300,000	306,624	2022/12/20
2 4年度 7回	千葉県公募公債	0.7400	300,000	306,201	2022/12/22
1 1 9回	共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	511,875	2023/02/24
1 2 1回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	508,885	2023/04/25
2 5年度 4回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	308,331	2023/05/30
7 2 0回	東京都公募公債	0.8700	300,000	308,628	2023/06/20
2 5年度 4回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	205,284	2023/06/20

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円
25年度2回 横浜市公募公債	0.8880	400,000	2023/07/14
374回 大阪府公募公債	0.9380	300,000	2023/07/28
25年度5回 千葉県公募公債	0.8400	200,000	2023/08/25
128回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	2023/11/24
726回 東京都公募公債	0.7300	400,000	2023/12/20
25年度11回 福岡県公募公債	0.6940	200,000	2024/02/26
208回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	2024/06/26
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	2024/07/29
488回 名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	2024/09/20
26年度11回 京都府公募公債	0.4760	350,000	2024/12/19
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	2025/01/24
26年度7回 兵庫県公募公債	0.4600	200,000	2025/02/26
5回 東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	2025/05/23
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	2025/07/25
1回 静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	2025/09/19
9回 東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	2026/06/19
10回 東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	2026/09/18
4回 京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	2026/09/18
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	2027/01/25
29年度4回 大阪市公募公債	0.1500	200,000	2027/09/21
30年度1回 神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	2028/09/20
第91回 川崎市公募公債	0.1850	200,000	2028/09/20
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	300,000	2028/12/28
30年度19回 愛知県公募公債	0.1150	200,000	2029/03/28
8回 静岡県公募公債 15年	0.8280	200,000	2030/06/07
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	1.6350	300,000	2032/08/16
14回 千葉県公募公債 20年	1.1370	100,000	2033/04/15
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	2034/05/08
17回 北九州市公募公債 20年	1.5290	100,000	2034/06/20
小計	-	17,450,000	18,054,906
(特殊債券)	%	千円	千円
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	100,000	2021/03/26
24回 地方公共団体金融機構債券	1.2080	300,000	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	2021/08/30
14回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	400,000	2021/11/30
36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	2022/05/20
96回 高速道路機構債	0.7960	700,000	2022/09/20
44回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	2023/01/20
55回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	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	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	2023/06/30
50回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	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	2023/07/31
116回 高速道路機構債	0.7220	100,000	2023/09/20
56回 政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	2024/01/19

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	2024/09/13
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	2025/03/31
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	2026/04/28
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	200,000	2027/04/13
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	2027/04/30
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	2027/11/19
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	2028/02/18
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	2028/12/20
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	2029/09/20
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	2030/10/29
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	2030/10/31
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	2031/06/13
19回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	2031/12/26
13回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.9600	13,092	2032/05/10
14回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.7000	65,775	2032/05/10
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	2032/09/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	400,000	2033/12/20
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	2035/02/28
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	2035/06/28
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	2036/06/20
6回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	38,001	2037/05/10
8回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	26,704	2037/05/10
9回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	39,924	2037/05/10
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	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	42,426	2037/11/10
43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	14,127	2041/06/10
44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	54,016	2041/07/10
51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	40,311	2042/02/10
1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	66,765	2042/05/10
29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	142,365	2044/10/10
36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	242,352	2045/05/10
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	2045/10/31
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	2047/03/20
114回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	258,345	2051/11/10
126回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	272,001	2052/11/10
128回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	272,523	2053/01/10
131回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	277,092	2053/04/10
132回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	276,632	2053/05/10
137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	284,412	2053/10/10
小計	-	14,698,867	15,758,836
(金融債券)	%	千円	千円
220号 利附商工債(3年)	0.1100	300,000	2021/05/27
325回 利附信金中金債	0.0400	400,000	2021/12/27
い第828号 利附商工債	0.1400	100,000	2024/05/27
小計	-	800,000	800,829

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
337回 東京交通債	2.2300	200,000	204,772	2021/03/19
473回 東北電力社債	0.5970	300,000	301,854	2021/04/23
9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	1.6800	100,000	101,886	2021/04/28
32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.6200	300,000	305,928	2021/06/09
320回 北海道電力社債	0.5850	200,000	201,758	2021/12/24
6回 東海旅客鉄道社債	2.3900	100,000	104,660	2022/02/15
19回 東日本旅客鉄道社債	2.3600	100,000	104,663	2022/02/25
13回 パナソニック社債	0.5680	100,000	100,937	2022/03/18
9回 西日本旅客鉄道社債	2.2800	200,000	209,320	2022/03/25
45回 住友商事社債	1.1170	100,000	102,192	2022/04/20
23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	0.0900	100,000	99,925	2022/05/23
1回 BPCE SA円債 (ソーシャルボンド)	0.2140	200,000	200,016	2022/06/30
21回 東日本旅客鉄道社債	2.0200	100,000	105,042	2022/09/20
94回 丸紅社債	1.1700	100,000	102,719	2022/10/12
57回 東京三菱銀行社債	2.2200	200,000	211,582	2022/10/27
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.4760	100,000	101,026	2022/12/02
11回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	309,117	2022/12/20
18回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	103,948	2022/12/20
518回 中部電力社債	0.1900	200,000	200,498	2023/01/25
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	205,354	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	102,158	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	204,470	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	103,211	2023/03/24
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	309,114	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	102,598	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	205,808	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	103,273	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	414,056	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	320,919	2023/09/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	102,955	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	102,566	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	208,052	2023/11/24
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	214,718	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	309,522	2023/12/20
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	415,628	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	414,280	2024/02/23
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	204,432	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	108,529	2024/03/19
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	109,866	2024/09/20
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	204,332	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	205,188	2024/11/28
321回 北海道電力社債	0.8860	161,000	165,995	2024/12/25
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	330,489	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	219,160	2025/06/20
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	221,934	2025/09/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	136,720	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	105,066	2026/06/25
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	203,128	2027/02/16
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	303,363	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	201,258	2027/05/07
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	200,000	201,994	2028/01/18
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	201,686	2028/06/06
14回 プリダストン社債	0.3750	200,000	201,412	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	108,193	2029/04/27
43回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	101,863	2038/07/12
小計	-	10,181,000	10,545,134	-
合計	-	203,069,867	221,573,805	-

■投資信託財産の構成

2020年2月14日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	221,573,805	99.3%
コール・ローン等、その他	1,482,460	0.7%
投資信託財産総額	223,056,266	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

(2020年2月14日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	223,056,266,615円		
コ ー ル ・ 公 司 未 前 未 払 利 費	925,968,916		
(B) 負 債	221,573,805,885		
未 払 解 約 金	530,848,633		
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	25,643,181		
元 次 期 繰 越 損 益 本 金 数	196,906,000		
(D) 受 益 権 総 額	196,906,000		
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	222,859,360,615		
	168,870,516,479		
	53,988,844,136		
	168,870,516,479円		
	13,197円		
(注1) 期首元本額	223,973,156,427円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	4,843,326円
追加設定元本額	120,614,812,838円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	3,778,447円
一部解約元本額	175,717,452,786円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (D/C)	4,877,007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-2035)	9,781,550円
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	21,184,712,153円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	191,589,421円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	69,986,260円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,735,395,954円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	68,506,951円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,293,364,512円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	18,787,911円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	723,181円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	987,848,234円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	610,771円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	253,839,832円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	708,717円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	25,260,802円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	498,022円
たわらノーロード 国内債券	10,015,397,101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 バランス (8資産均等型)	644,889,238円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	1,002,734,258円
たわらノーロード バランス (堅実型)	198,546,011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)	10,109,222,296円
たわらノーロード バランス (標準型)	329,055,628円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	342,183,786円
たわらノーロード バランス (積極型)	41,366,056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)	5,071,969,240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)	14,261,260円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定)	5,050,603,156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)	422,619,412円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII (適格機関投資家限定)	5,102,756,119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)	415,409,126円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定)	5,076,506,178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)	104,078,457円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドV (適格機関投資家限定)	5,113,422,319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)	8,657,075円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	618,326,873円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	5,579,866円	D I A Mグローバル・バランスファンド25VA	219,862,252円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	8,704,630円	D I A Mグローバル・バランスファンド50VA	165,143,096円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,632,593円	D I A M国際分散バランスファンド30VA	61,558,322円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,871,083円	D I A M国際分散バランスファンド50VA	148,494,901円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	243,993円	D I A M国内重視バランスファンド30VA	70,976,271円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,054,492,139円	D I A M国内重視バランスファンド50VA	29,810,777円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	6,915,364,061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)	80,376,845円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	9,496,684,077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)	167,069,547円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,799,837,596円	D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,589,661,319円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	1,841,604,708円	D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,581,596,662円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,047,028,967円	D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,902,110,574円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	317,181,619円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA	528,103,309円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	82,330,193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)	243,077,089円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,373,109,117円	D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA	2,833,060,371円
マネックス資産設計ファンド エポリユーション	6,459,038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)	252,830,217円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	3,565,751,861円	D I A M世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	14,003,137円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	1,006,035,152円	D I A M世界アセットバランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	59,261,134円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	214,761,880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)	2,634,815,087円
投資のソムリエ	6,982,653,969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)	74,826,164円
グループコントロール	1,214,453,782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)	541,115,349円
投資のソムリエ<DC年金>	663,342,952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)	933,900,682円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,041,421,611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)	2,409,352,967円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	354,073,730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)	352,962,064円
グループコントロール<DC年金>	1,228,781円	D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	110,662,909円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,760,959円	D I A M国内バランス20VA (適格機関投資家限定)	256,171,767円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	7,262,628円	D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	739,037円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	522,448,330円	D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)	410,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,526,677,877円	期末元本合計	168,870,516,479円

■損益の状況

当期 自2019年2月15日 至2020年2月14日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		2,279,859,711円
受 取 利 息		2,281,738,927
支 払 利 息		△1,879,216
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		1,759,087,828
売 買 益		3,410,195,048
売 買 損		△1,651,107,220
(C) 当 期 損 益 金(A + B)		4,038,947,539
(D) 前 期 繰 越 損 益 金		68,139,769,721
(E) 解 約 差 損 益 金		△56,993,272,286
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金		38,803,399,162
(G) 合 計(C + D + E + F)		53,988,844,136
次 期 繰 越 損 益 金(G)		53,988,844,136

(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) (E)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) (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。

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18期（決算日 2020年2月17日）

（計算期間 2019年2月16日～2020年2月17日）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18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。 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 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	円	%	（円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	期騰落率			
14期(2016年2月15日)	23,909	△17.1	ポイント 764,772.48	% △16.9	% 96.1	% 1.2	百万円 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
18期(2020年2月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420

(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）。

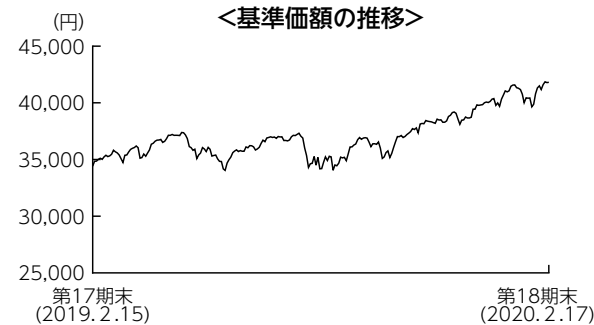
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2019年 2月 15日	34,418	% -	1,111,144.35	% -	% 95.3	% 2.0
2 月 末	35,326	2.6	1,141,179.46	2.7	95.4	2.0
3 月 末	35,574	3.4	1,149,447.69	3.4	95.6	1.7
4 月 末	37,169	8.0	1,201,500.33	8.1	96.0	1.1
5 月 末	34,824	1.2	1,125,763.75	1.3	95.4	1.9
6 月 末	36,077	4.8	1,166,661.32	5.0	95.7	1.5
7 月 末	37,059	7.7	1,198,358.28	7.8	95.6	1.6
8 月 末	35,209	2.3	1,139,763.28	2.6	94.8	2.2
9 月 末	36,342	5.6	1,176,490.64	5.9	95.1	2.0
10 月 末	37,786	9.8	1,221,956.80	10.0	95.0	2.2
11 月 末	39,192	13.9	1,268,768.91	14.2	95.3	1.9
12 月 末	40,378	17.3	1,307,005.29	17.6	95.9	1.4
2020年 1 月 末	40,429	17.5	1,309,282.33	17.8	94.8	2.7
(期 末) 2020年 2月 17日	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7

(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（2019年2月16日から2020年2月17日まで）

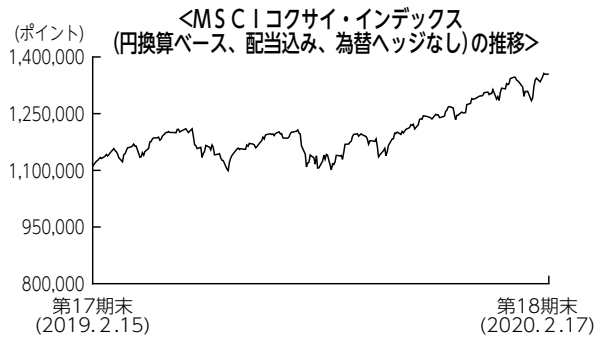


基準価額の推移

当期末の基準価額は41,812円となり、前期末比で21.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場において、米ドルやユーロなど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、米国のハト派的な金融政策や米中貿易協議の進展期待などから、米国や欧州などの株式市場が力強く上昇し、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月中旬以降は米中貿易協議へ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や新型コロナウイルスの感染拡大などから一時下落する場面があったものの、前期末比で大きく上昇しました。欧州市場では英国やイタリアの政局混乱など不安要因はありましたが、前期末比で上昇しました。

為替市場では、米中貿易摩擦の緩和期待などから2019年4月後半にかけて対円で米ドルが買われる展開となりましたが、その後は米国の金利低下見通しなどから米ドル安に転じました。9月以降は米中对立の緩和期待や、米国の追加利下げ観測の後退などから米ドル高となったものの、前期末比では米ドル安円高となりました。ユーロは域内の景気減速懸念や、低金利環境の長期化観測など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	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

期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.3%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.9
3	銀行	7.3
4	資本財	6.7
5	メディア・娯楽	6.1
6	ヘルスケア機器・サービス	4.9
7	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.9
8	小売	4.8
9	食品・飲料・タバコ	4.6
10	エネルギー	4.5



(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21.9%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	0.002%
(株 式)	(0)	(0.001)
(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)	(0.000)
(b) 有価証券取引税	1	0.004
(株 式)	(1)	(0.004)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)
(投 資 証 券)	(0)	(0.000)
(c) その他費用	13	0.034
(そ の 他)	(13)	(0.034)
合 計	15	0.040

(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(37,077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 (2019年2月16日から2020年2月17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 20,597.12 (944.38)	千アメリカ・ドル 148,036 (△3,748)	百株 52,364.81	千アメリカ・ドル 408,490				
	カ	ナ	ダ	百株 3,511.18 (△1,155.8)	千カナダ・ドル 13,919 (△390)	百株 8,023.97	千カナダ・ドル 30,759					
	オ	ー	ス	トラ	リア	百株 4,492.22 (439.83)	千オーストラリア・ドル 8,156 (515)	百株 12,399.51	千オーストラリア・ドル 21,352			
	香			港	百株 8,847 (969.27)	千香港・ドル 25,910 (-)	百株 18,974.5	千香港・ドル 64,320				
	シ	ン	ガ	ポ	ール	百株 1,711 (-)	千シンガポール・ドル 1,203 (-)	百株 11,375.4	千シンガポール・ドル 3,530			
	ニ	ュ	ー	ジ	ー	ランド	百株 1,097.05 (-)	千ニュージーランド・ドル 672 (-)	百株 912.87	千ニュージーランド・ドル 698		
	イ	ギ	リ	ス	百株 16,501.3 (174,827.16)	千イギリス・ポンド 11,324 (△314)	百株 218,837.93	千イギリス・ポンド 27,695				
	イ	ス	ラ	エ	ル	百株 1,257.5 (-)	千イスラエル・シケル 2,010 (-)	百株 2,354.7	千イスラエル・シケル 2,750			
	ス	イ	ス	百株 850.1 (375.47)	千スイス・フラン 6,472 (△480)	百株 2,677.98	千スイス・フラン 19,579					
	デ	ン	マ	ー	ク	百株 212.77 (17.54)	千デンマーク・クローネ 9,890 (-)	百株 709.27	千デンマーク・クローネ 27,146			
	ノ	ル	ウ	エ	ー	百株 291.8 (74.45)	千ノルウェー・クローネ 5,929 (-)	百株 1,353.09	千ノルウェー・クローネ 15,917			
	ス	ウ	エ	ー	デン	百株 559.9 (243.67)	千スウェーデン・クローナ 8,994 (-)	百株 2,928.51	千スウェーデン・クローナ 42,541			
国	ユ	ー	ア	イル	ランド	百株 341.42 (-)	千ユーロ 146 (-)	百株 832.18	千ユーロ 854			
			オ	ラ	ン	ダ	百株 1,455.84 (-)	千ユーロ 6,992 (-)	百株 1,907.64	千ユーロ 8,296		
			ベ	ル	ギ	ー	百株 162.34 (-)	千ユーロ 1,541 (-)	百株 361.48	千ユーロ 2,387		
			ル	ク	セ	ン	ブル	グ	百株 131.92 (-)	千ユーロ 234 (-)	百株 334.29	千ユーロ 573
			フ	ラ	ン	ス	百株 1,262.54 (71.83)	千ユーロ 7,234 (△12)	百株 4,011.97	千ユーロ 19,883		
			ド	イ	ツ	百株 1,335.84 (54)	千ユーロ 6,531 (△409)	百株 3,740.17	千ユーロ 17,458			
			ポ	ル	ト	ガル	百株 -	千ユーロ -	百株 526.32	千ユーロ 314		

			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユ ー ロ	ス ペ イ ン	1,815.36 (13,153.66)	千ユーロ 2,268 (△1)	20,677.83	千ユーロ 5,748
		イ タ リ ア	4,152.7 (-)	千ユーロ 2,024 (-)	11,344.16	千ユーロ 3,994
		フ ィ ン ラ ン ド	499.72 (252.94)	千ユーロ 739 (-)	1,374.73	千ユーロ 1,699
		オ ー ス ト リ ア	8.13 (-)	千ユーロ 38 (△35)	68.57	千ユーロ 280

(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
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	(-)	(-)	0.998	152
BOSTON PROPERTIES INC	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17.771	747	1.282	165
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	(-)	(-)	17.307	158
AVALONBAY COMMUNITIES INC	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	0.553	306	6.948	584
DUKE REALTY TRUST	(-)	(-)	(-)	(-)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2.731	334	1.862	389
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.47	149	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	5.493	432	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	11.666	378	5.676	183
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.579	153	(-)	(-)
WELLTOWER INC	2.255	198	10.048	326
LIBERTY PROPERTY TRUST	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	(△11.649)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	(-)	(-)	9.014	240
HOST HOTELS & RESORTS INC	8.128	974	(-)	(-)
MID AMERICA	(6.813)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	(-)	(-)	8.885	151
	(-)	(-)	(-)	(-)
	(-)	(-)	1.424	169
	2.065	151	(-)	(-)
	(-)	(-)	5.19	382
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
REGENCY CENTERS CORP	7.479	483	9.099	590
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	4.195	188	3.508	157
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.846	631	7.04	1,105
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	-	-	1.533	370
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	8.681	1,108	1.263	159
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	3.913	259	4.652	329
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	2.506	148	5.38	331
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	-	-	6.078	148
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.161	226	4.785	497
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	-	-	2.783	338
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	39.953	829	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	12.782	123	23.607	226
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	2.719	577	7.003	1,510
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	1.702	150	3.811	334
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	11.957	342	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	-	19.124	373
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	34.2	841	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	-	-	6.221	202
	(-)	(-)	(-)	(-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	7.819	430	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	-	-	(-)	(-)
	(17.676)	(388)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	11.77	308	7.978	208
	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
MIRVAC GROUP	110.284	354	76.649	242
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	89.108	550	75.831	465
	(-)	(-)	(-)	(-)
LENLEASE GROUP	-	-	17.897	223
	(△42.974)	(△572)	(-)	(-)
DEXUS	20.313	265	16.334	212
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	-	-	15.521	230
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	-	-	56.688	217
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	-	-	27.6	2,435
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 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
ASCENDAS REAL ESTATE INV T	(-)	(△5)	(-)	(-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	(-)	(-)	(-)	(-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192.3	461	(-)	(-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	(-)	(△0.05769)	(-)	(-)
	(32.128)	(-)	32.128	7
	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	20.951	127	23.003	122
HAMMERSON PLC	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	(-)	(-)	58.616	162
SEGRO PLC	15.752	142	(-)	(-)
	(-)	(-)	18.971	175
	22.038	146	(-)	(-)
	(-)	(-)	17.705	123
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	(-)	(-)	1.163	153
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
COVIVIO	1.446	136	1.856	168
	(-)	(-)	(-)	(-)

(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 84,266	百万円 82,751	百万円 -	百万円 -

(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	88,699,016千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	335,421,941千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.26

(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2月16日から2020年2月17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	株数	株数	評価価額		
					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			
AMAZON.COM INC	361.08	325.49	69,487	7,629,769	インターネット販売・通信販売		
ABBOTT LABORATORIES	1,515.76	1,365.53	12,243	1,344,318	ヘルスケア機器・用品		
AES CORP	556.31	475.98	996	109,385	独立系発電事業者・エネルギー販売業者		
ABIOMED INC	35.6	35.74	597	65,621	ヘルスケア機器・用品		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	798.15	684.81	10,320	1,133,145	情報技術サービス		
ADVANCED MICRO DEVICES	763.85	790.23	4,370	479,909	半導体・半導体製造装置		
ADOBE INC	422.94	375.4	14,252	1,564,958	ソフトウェア		
CHUBB LTD	393.78	352.14	5,794	636,270	保険		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	194.65	173.59	4,444	487,959	化学		
ALLEGHANY CORP	13.25	10.94	902	99,126	保険		
SAREPTA THERAPEUTICS INC	-	60.52	759	83,342	バイオテクノロジー		
RALPH LAUREN CORP	48.93	34.22	416	45,779	繊維・アパレル・贅沢品		
ALLSTATE CORP	306.51	258.32	3,243	356,160	保険		
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	641.2	556.87	10,068	1,105,550	コングロマリット		
AMGEN INC	565.43	464.84	10,388	1,140,629	バイオテクノロジー		
HESS CORP	237.34	213.67	1,289	141,563	石油・ガス・消耗燃料		
AMERICAN EXPRESS CO	643.65	544.74	7,401	812,671	消費者金融		
AMERICAN ELECTRIC POWER	426.28	392.77	4,075	447,476	電力		
AFLAC INC	633.17	570.28	3,011	330,679	保険		
AMERICAN INTL GROUP	779.1	680.37	3,298	362,168	保険		
AMERCO	5.51	5.85	202	22,240	陸運・鉄道		
ANALOG DEVICES	329.62	291.05	3,424	375,977	半導体・半導体製造装置		
ANADARKO PETROLEUM CORP	428.77	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	194.82	181.92	1,865	204,861	バイオテクノロジー		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	810.35	604.52	2,536	278,514	建設関連製品		
JONES LANG LASALLE INC	40.87	40.87	700	76,889	不動産管理・開発		
VALERO ENERGY CORP	372.19	314.33	2,597	285,219	石油・ガス・消耗燃料		
APACHE CORP	360.95	314.7	861	94,539	石油・ガス・消耗燃料		
ANSYS INC	76.33	67.7	1,976	217,042	ソフトウェア		
APPLE INC	4,204.91	3,499.77	113,725	12,487,007	コンピュータ・周辺機器		
APPLIED MATERIALS INC	831.06	711.21	4,754	522,037	半導体・半導体製造装置		
ALBEMARLE CORP	98.26	76.34	684	75,137	化学		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	496.79	421.46	1,886	207,179	食品		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	96	78.13	784	86,155	電力		
AMEREN CORP	220.7	194.87	1,691	185,702	総合公益事業		
ARROW ELECTRONICS INC	83.46	57.95	458	50,387	電子装置・機器・部品		
AUTOLIV INC	61.97	59.13	456	50,160	自動車部品		
AUTODESK INC	192.95	172.35	3,601	395,417	ソフトウェア		
AUTOMATIC DATA PROCESSING	373.36	334.93	6,070	666,552	情報技術サービス		
AUTOZONE INC	22.31	19.17	2,019	221,686	専門小売り		
AVERY DENNISON CORP	80.42	65.49	904	99,326	容器・包装		
BALL CORP	278.03	252.62	1,950	214,190	容器・包装		
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,131.63	1,020.32	23,140	2,540,866	各種金融サービス		
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	863.63	666.37	3,058	335,838	資本市場		
BAXTER INTERNATIONAL INC	449.71	370.97	3,455	379,382	ヘルスケア機器・用品		
BECTON DICKINSON & CO	228.65	207.72	5,405	593,500	ヘルスケア機器・用品		
AMETEK INC	199.25	178.21	1,805	198,296	電気設備		
VERIZON COMM INC	3,601.1	3,203.11	18,741	2,057,805	各種電気通信サービス		
WR BERKLEY CORP	81.34	122.01	968	106,369	保険		
BEST BUY CO INC	232.06	187.2	1,688	185,422	専門小売り		
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	-	15.24	615	67,541	ライフサイエンス・ツール/サービス		
YUM! BRANDS INC	278.59	231.1	2,433	267,145	ホテル・レストラン・レジャー		
FIRSTENERGY CORP	415.03	435.84	2,276	249,947	電力		
H&R BLOCK INC	161.14	-	-	-	各種消費者サービス		

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BOEING CO	476.45	413.69	14,085	1,546,613	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	108.27	83.24	501	55,021	専門サービス
BORGWARNER INC	215.54	172.1	587	64,531	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,198.2	1,066.58	4,512	495,494	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	117.55	99.88	719	78,972	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	101.53	87.66	994	109,177	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	21.42	19.29	1,472	161,648	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,426.27	1,814.88	12,047	1,322,779	医薬品
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	52.15	—	—	—	資本市場
INGREDION INC	53.05	53.05	516	56,699	食品
ONEOK INC	374.02	324.27	2,496	274,086	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	59	59	665	73,080	保険
UNITED RENTALS INC	76.93	61.81	969	106,456	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	230.49	215.99	3,476	381,727	総合公益事業
FEDEX CORP	215.25	193.68	3,072	337,322	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	96.48	80.48	1,686	185,190	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	252.01	227.63	2,368	260,110	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	235.58	243.81	1,740	191,140	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,532.41	1,252.54	903	99,158	メディア
CSX CORP	710.27	595.4	4,738	520,318	陸運・鉄道
CABOT OIL & GAS CORP	382.55	314.16	464	51,052	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	140.5	140.5	683	75,036	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	243.37	200.52	1,082	118,870	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	145.53	128.2	2,613	286,918	飲料
CARDINAL HEALTH INC	269.19	229.5	1,368	150,237	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	354.48	319.62	1,361	149,501	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	521.82	432.58	5,969	655,415	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	112.32	98.65	1,155	126,840	ソフトウェア
CELGENE CORP	608.71	—	—	—	バイオテクノロジー
CITRIX SYSTEMS INC	125.26	94.64	1,154	126,807	ソフトウェア
CENTURYLINK INC	804.24	804.24	1,117	122,744	各種電気通信サービス
CERNER CORP	264.14	251.43	1,937	212,767	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,927.32	2,476.52	34,042	3,737,838	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	222.43	198.96	1,520	166,967	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	142.86	112.22	1,292	141,958	保険
CINTAS CORP	79.44	66.04	1,987	218,173	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	4,106.72	3,309.4	15,544	1,706,758	通信機器
CLOROX COMPANY	108.85	98.76	1,627	178,739	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,520.46	3,147.58	18,869	2,071,897	飲料
COPART INC	189.44	167.49	1,729	189,880	商業サービス・用品
COGNEX CORP	152.91	122.84	660	72,510	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	710	627.79	4,814	528,634	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	263.13	221.45	3,208	352,327	ホテル・レストラン・レジャー
COMERICA INC	149.31	119.85	752	82,589	銀行
NRG ENERGY, INC.	256.31	210.39	842	92,541	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
COMCAST CORP-CL A	3,943.84	3,511.08	16,182	1,776,845	メディア
CONAGRA BRANDS INC	405.73	358.02	1,170	128,506	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	267.33	252.2	2,378	261,131	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	236.16	229.37	1,571	172,541	総合公益事業
COOPER COS INC	44.84	39.36	1,390	152,690	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	162	132.2	730	80,198	飲料
CORNING INC	686.91	583.76	1,668	183,252	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	138.7	482	52,952	容器・包装
HEICO CORP-CL A	—	52.92	545	59,942	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	131.93	119.63	1,995	219,071	機械
DR HORTON INC	321.52	283.55	1,752	192,437	家庭用耐久財
DANAHER CORP	552.86	482.99	8,015	880,071	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	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
MOODY'S CORP	154.93	129.22	3,590	394,195			資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	503.31	423.7	2,898	318,305			情報技術サービス
TARGET CORP	436.5	394.21	4,597	504,824			複合小売り
DEERE & CO	262.37	238.24	4,004	439,650			機械
MORGAN STANLEY	1,132.17	951.98	5,315	583,681			資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	198.91	180.81	1,815	199,383			商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	29.94	27.85	2,036	223,647			専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,280.37	1,394.4	19,457	2,136,428			娯楽
DOLLAR TREE INC	200.78	186.97	1,658	182,053			複合小売り
DOVER CORP	126.35	111.13	1,332	146,254			機械
OMNICOM GROUP	193.25	173.65	1,356	148,987			メディア
DTE ENERGY CO	160.34	148.17	1,985	218,038			総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	611.77	568.01	5,752	631,658			電力
FLOWERVE CORP	131.39	98.82	458	50,356			機械
DARDEN RESTAURANTS INC	109.9	97	1,180	129,628			ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	832.27	637.71	2,432	267,058			インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	8,277.12	6,844.79	23,854	2,619,179			銀行
CITIGROUP INC	2,166.9	1,746.72	13,762	1,511,112			銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	130.09	94.23	704	77,319			化学
E*TRADE FINANCIAL CORP	216.24	171.04	755	82,989			資本市場
EATON CORP PLC	384.09	318.18	3,294	361,763			電気設備
EATON VANCE CORP	91.84	91.84	451	49,563			資本市場
CADENCE DESIGN SYS INC	249.22	226.28	1,782	195,683			ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	217.62	177.49	709	77,895			メディア
ECOLAB INC	221.92	204.79	4,245	466,156			化学
PERKINELMER INC	-	83.38	796	87,486			ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	272.14	224.91	2,467	270,880			娯楽
SALESFORCE.COM INC	624.35	644.04	12,233	1,343,242			ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	-	22.43	366	40,281			保険
EMERSON ELECTRIC CO	543.24	467.05	3,433	376,974			電気設備
ATMOS ENERGY CORP	102.2	86.5	1,041	114,399			ガス
ENERGY CORP	162.59	150.31	2,016	221,368			電力
EOG RESOURCES INC	507.26	446.03	3,341	366,913			石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	102.31	91.61	1,492	163,917			専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	194.24	173.46	3,729	409,506			パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	147.92	125.15	918	100,848			航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,696.52	3,276.09	19,869	2,181,669			石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	126.34	102.09	1,076	118,226			化学
NEXTERA ENERGY INC	412.34	374.04	10,417	1,143,870			電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	-	28.75	861	94,557			資本市場
ASSURANT INC	40.89	45.94	654	71,890			保険
FASTENAL CO	254.18	458.91	1,758	193,088			商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	600.5	581.44	1,721	188,972			銀行
M&T BANK CORP	124.94	99.99	1,697	186,399			銀行
FISERV INC	357.37	443.49	5,424	595,639			情報技術サービス
FLIR SYSTEMS INC	116.23	116.23	668	73,394			電子装置・機器・部品
MACY'S INC	247.41	-	-	-			複合小売り
FORD MOTOR CO	3,243.91	3,108.36	2,517	276,451			自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	285.48	237.13	577	63,425			資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,172.69	1,149.93	1,407	154,545			金属・鉱業
FLEX LTD	676.69	351.27	477	52,377			電子装置・機器・部品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	164.78	142.7	1,557	171,036			保険
GAP INC/THE	182.95	182.95	331	36,439			専門小売り
DENTSPLY SIRONA INC	174.77	183.86	1,063	116,786			ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	221.43	188.21	3,539	388,634			航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	527.09	461.41	2,459	270,083			食品
GENUINE PARTS CO	134.32	116.05	1,119	122,924			販売

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	
GILEAD SCIENCES INC	1,133.77	978.31	6,609	725,718	バイオテクノロジー
GARTNER INC	84.12	73.84	1,125	123,568	情報技術サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	180.97	—	—	—	自動車部品
MCKESSON CORP	168.48	145.58	2,446	268,590	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	504.9	447.12	12,957	1,422,688	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	7,610.66	6,747.57	8,657	950,553	コングロマリット
WW GRAINGER INC	43.31	37.62	1,157	127,080	商社・流通業
HALLIBURTON CO	737.63	668.43	1,478	162,346	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	363.73	327.28	2,286	251,044	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	307.11	249	5,903	648,181	資本市場
HARLEY-DAVIDSON INC	129.01	129.01	443	48,671	自動車
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	100.33	175.86	4,019	441,316	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	109.27	94.73	925	101,631	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	138	115.16	830	91,205	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	—	22.78	295	32,456	航空宇宙・防衛
HELMERICH & PAYNE INC	100.55	—	—	—	エネルギー設備・サービス
HERSHEY FOODS CORP	121.35	112.92	1,810	198,799	食品
HP INC	1,376.54	1,174.82	2,628	288,562	コンピュータ・周辺機器
F5 NETWORKS INC	48.74	48.74	621	68,238	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	104.72	104.72	837	91,986	容器・包装
UNITED THERAPEUTICS CORP	34.47	—	—	—	バイオテクノロジー
JUNIPER NETWORKS INC	277.4	279.39	677	74,361	通信機器
HOLLYFRONTIER CORP	153.39	118.55	513	56,388	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	233.77	196.88	1,043	114,615	ヘルスケア機器・用品
UNUM GROUP	207.2	151.85	455	50,036	保険
HOME DEPOT INC	998.38	846.67	20,745	2,277,905	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	150.79	131.85	1,173	128,860	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	241.61	241.61	1,173	128,876	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	430.2	376.78	1,024	112,444	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	35.69	29.13	713	78,292	建設関連製品
HUMANA INC	119.62	103.84	3,902	428,530	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	73.59	60	660	72,514	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	936.48	795.17	1,119	122,932	銀行
RED HAT INC	158.43	—	—	—	ソフトウェア
NEKTAR THERAPEUTICS	156.89	—	—	—	医薬品
BIOGEN INC	173.88	141.19	4,701	516,238	バイオテクノロジー
IDEX CORP	71.74	61.54	1,075	118,107	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	264.25	247.55	4,650	510,622	機械
INTUIT INC	208.8	200.54	6,102	670,025	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	74.02	67.91	1,961	215,329	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	109.6	659	72,360	バイオテクノロジー
INGERSOLL-RAND PLC	219.89	182.44	2,673	293,567	機械
INTEL CORP	4,016.49	3,428.07	23,060	2,532,056	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	74.46	79.65	1,082	118,826	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	329.83	294.11	1,270	139,474	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	291.57	288.62	706	77,546	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	96.31	101.08	1,017	111,718	建設・土木
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	72.47	60.19	1,035	113,725	情報技術サービス
INCYTE CORP	156.01	137.98	1,082	118,853	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,336.1	2,043.38	30,677	3,368,363	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	294.41	287.53	1,699	186,583	保険
KLA CORPORATION	136.39	127.24	2,242	246,279	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	448.78	333.12	760	83,467	石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	215.64	191.81	1,298	142,602	食品
EAST WEST BANCORP INC	146	115.6	552	60,671	銀行
KEYCORP	885.11	794.97	1,568	172,218	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	301.75	261.25	3,802	417,542	家庭用品

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	
BLACKROCK INC/NEW YORK	103.26	89.29	5,053	554,849	資本市場
KOHL'S CORP	149.1	119.1	529	58,154	複合小売り
KROGER CO	666.1	639.44	1,805	198,204	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	137.25	111.39	3,779	414,985	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	-	27.16	1,057	116,149	航空宇宙・防衛
PACKAGING CORP OF AMERICA	89.82	71.43	706	77,598	容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	154.52	132.54	1,321	145,048	情報技術サービス
LEGGETT & PLATT INC	95.88	109.28	498	54,715	家庭用耐久財
LENNAR CORP	260.65	227.53	1,600	175,753	家庭用耐久財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	298.62	207.95	488	53,588	各種金融サービス
ELI LILLY & CO	845.73	672.42	9,489	1,041,913	医薬品
L BRANDS INC	216.98	-	-	-	専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	188.9	153.44	937	102,956	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	605.55	539.13	5,712	627,186	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	281.67	236.62	2,030	222,967	ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	225.6	196.76	8,615	945,941	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	213.46	217.59	1,179	129,467	保険
LOWE'S COS INC	710.7	599.41	7,517	825,454	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	654.73	637.96	5,579	612,639	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	464.14	385.73	1,215	133,497	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	109.52	99.35	1,657	181,999	食品
MCDONALD'S CORPORATION	675.89	587.12	12,745	1,399,487	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	215.99	190.18	5,850	642,427	資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	37.51	31.14	907	99,624	保険
MANPOWERGROUP INC	62.65	45.55	422	46,362	専門サービス
MARKEL CORPORATION	12.22	10.65	1,409	154,782	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	185.26	165.61	3,818	419,231	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	435.93	388.72	4,617	506,970	保険
MASCO CORP	286.38	212.16	967	106,249	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	53.82	47.86	1,261	138,459	建設資材
MATTEL INC	240.03	-	-	-	レジャー用品
METLIFE INC	702.51	612.6	3,202	351,653	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	243.23	213.86	1,359	149,250	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,179.47	1,037.71	12,175	1,336,864	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	629.53	602.43	3,826	420,164	娯楽
CVS HEALTH CORP	1,131.5	1,004.51	7,169	787,176	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	2,319.3	1,983.19	16,391	1,799,738	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	398.97	326.86	700	76,946	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	89.94	80.49	1,571	172,584	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	6,344.42	5,617.88	104,127	11,433,189	ソフトウェア
MICRON TECH INC	1,016.04	847.94	4,960	544,657	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	41	41.88	476	52,297	機械
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	202.69	184.73	2,020	221,818	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	552.42	487.15	1,223	134,364	半導体・半導体製造装置
3M CO	505.59	442.96	7,132	783,104	コンプロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	60.93	49.76	686	75,387	家庭用耐久財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	146.8	125.93	2,322	254,985	通信機器
KANSAS CITY SOUTHERN	88.56	76.14	1,322	145,166	陸運・鉄道
MYLAN NV	435.74	435.74	954	104,778	医薬品
ILLUMINA INC	126.9	116.19	3,473	381,352	ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	447.02	389.63	2,737	300,581	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	-	65.45	682	74,954	バイオテクノロジー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	334.68	271.94	622	68,347	エネルギー設備・サービス
NETAPP INC	231.04	179.63	974	106,979	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	433.8	333.17	669	73,529	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	455.65	638.69	2,814	309,054	金属・鉱業
NVR INC	3.07	2.63	1,050	115,325	家庭用耐久財

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	
			千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
NIKE INC-CL B	1,120.86	967	10,012	1,099,352		繊維・アパレル・贅沢品
NOBLE ENERGY INC	394.36	394.36	755	82,964		石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	94.87	94.87	382	41,958		複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	245.31	202.6	4,241	465,709		陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	270.88	247.68	2,319	254,710		電力
NISOURCE INC	315.44	315.48	953	104,646		総合公益事業
TAPESTRY INC	268.18	217.9	636	69,886		繊維・アパレル・贅沢品
NORTHERN TRUST CORP	178.67	159.59	1,615	177,332		資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	139.67	121.94	4,523	496,652		航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	3,986.35	3,239.87	15,622	1,715,367		銀行
NUCOR CORP	282.41	240.42	1,133	124,467		金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	191.75	191.75	1,054	115,755		石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	417.83	359.69	3,691	405,366		消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	659.07	695.5	2,893	317,682		石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	49.17	52.09	1,155	126,921		陸運・鉄道
OGE ENERGY CORP	160.28	160.28	739	81,165		電力
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	70.14	58.22	2,275	249,878		専門小売り
ORACLE CORP	2,607.88	1,806.97	10,023	1,100,554		ソフトウェア
PACCAR INC	296.61	273.94	2,047	224,807		機械
PTC INC	100.28	77.66	678	74,483		ソフトウェア
EXELON CORP	821.76	737.21	3,668	402,785		電力
PARKER HANNIFIN CORP	110.23	100.92	2,137	234,740		機械
PAYCHEX INC	287.92	253.29	2,259	248,104		情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	68.75	61.63	1,694	186,057		ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	632.29	537.24	1,900	208,643		電力
PEPSICO INC	1,214.84	1,082.92	15,917	1,747,778		飲料
PENTAIR PLC	168.69	125.11	553	60,772		機械
PFIZER INC	5,112.13	4,280.75	15,629	1,716,066		医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	-	155.16	833	91,520		水道
CONOCOPHILLIPS	999.13	858.96	5,035	552,867		石油・ガス・消耗燃料
PVH CORP	68.62	52.05	465	51,075		繊維・アパレル・贅沢品
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	143.08	129.08	1,797	197,330		石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,645.68	1,442.97	6,517	715,664		タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	397.3	344.94	5,316	583,758		銀行
BROWN & BROWN INC	-	172.94	827	90,861		保険
POLARIS INC	57.26	40.95	384	42,220		レジャー用品
GARMIN LTD	107.74	107.74	1,057	116,145		家庭用耐久財
FLUOR CORP (NEW)	98.21	-	-	-		建設・土木
PPG INDUSTRIES INC	203.71	190.31	2,286	251,065		化学
IPG PHOTONICS CORP	36.52	26.08	363	39,944		電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	384.78	339.84	10,817	1,187,755		食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	218.16	184.83	2,539	278,823		資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	128.75	108.83	1,228	134,850		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,168.05	1,939.08	24,459	2,685,659		家庭用品
PROGRESSIVE CORP	505.98	461.27	3,864	424,273		保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	439.56	390.39	2,283	250,673		総合公益事業
PULTE GROUP INC	212.09	212.09	990	108,729		家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	134.06	236.92	4,889	536,847		情報技術サービス
QUALCOMM INC	1,227.58	939.82	8,420	924,602		半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	123.37	103.88	1,027	112,862		資本市場
EXACT SCIENCES CORP	-	113.06	1,110	121,880		バイオテクノロジー
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	39.48	31.61	626	68,783		保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	70.45	61.16	2,443	268,312		バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	60.79	50.42	777	85,377		保険
RESMED INC	122.71	111.16	1,963	215,546		ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,351.09	1,156.14	6,371	699,589		銀行
SEATTLE GENETICS INC /WA	102.69	91.5	1,080	118,621		バイオテクノロジー

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	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	371.25	315	1,501	164,910	保険
ROSS STORES INC	328.58	288.14	3,508	385,284	専門小売り
ROLLINS INC	123.78	123.78	492	54,119	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	92.48	79.49	3,121	342,774	コンピュータリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	104.39	92.51	1,856	203,842	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	141.21	140.75	1,592	174,881	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	-	111.41	840	92,284	化学
RAYTHEON COMPANY	246.16	219.72	4,991	548,077	航空宇宙・防衛
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	38.48	38.48	395	43,446	情報技術サービス
ACCENTURE PLC-CL A	558.07	493.57	10,481	1,150,917	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,256.93	1,113.85	6,647	729,890	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	110.16	101.9	2,177	239,067	保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	231.27	195.63	2,694	295,910	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	293.13	474.12	7,464	819,607	情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	41.54	32.83	6,536	717,688	インターネット販売・通信販売
SCHLUMBERGER LTD	1,211.22	1,065.93	3,668	402,848	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,052.64	898.67	4,244	466,037	資本市場
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	181.38	155.9	2,500	274,569	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	103.34	106.22	575	63,236	食品
SEI INVESTMENTS CO	122.94	106.53	730	80,171	資本市場
ANTHEM INC	227.8	197.28	5,875	645,118	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	147.24	127.49	1,202	132,088	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	260.93	221.75	1,249	137,226	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	73.97	63.67	3,727	409,286	化学
CENTENE CORP	342.56	461.24	2,995	328,883	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	48.52	40.44	1,073	117,854	銀行
IAC INTERACTIVE CORP	69.38	62.52	1,487	163,345	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SMITH (A.O.) CORP	146.99	113.51	498	54,751	建設関連製品
ACUITY BRANDS INC	30.87	30.87	360	39,623	電気設備
SNAP-ON INC	49.35	39.81	622	68,303	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	350.83	313.88	2,965	325,616	保険
ADVANCE AUTO PARTS	63.3	52.97	707	77,697	専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	295.04	266.52	2,055	225,741	電力
SOUTHERN CO	865.24	800.67	5,526	606,779	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	677.81	1,036.81	5,696	625,446	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	113.52	113.52	658	72,256	旅客航空輸送業
AT&T INC	6,330.05	5,656.86	21,637	2,375,796	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,647.12	1,471.08	16,193	1,778,062	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	130.77	117.76	1,966	215,893	機械
STATE STREET CORP	336.8	295.9	2,303	252,933	資本市場
STARBUCKS CORP	1,179.2	923.12	8,241	904,929	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	190.3	175.47	499	54,794	金属・鉱業
STRYKER CORP	296.38	258.5	5,726	628,803	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	380.42	338.6	12,880	1,414,261	娯楽
SUNTRUST BANKS INC	408.38	-	-	-	銀行
NORTONLIFELOCK INC	553.68	489.55	1,011	111,052	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	97.93	382	42,000	陸運・鉄道
SYNOPSIS INC	132.39	118.55	1,936	212,629	ソフトウェア
SYSCO CORP	430.43	382.29	2,989	328,289	食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	99.01	88.5	5,339	586,303	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	39.05	34.55	1,335	146,679	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	805.53	883.22	1,079	118,506	医薬品
TERADYNE INC	-	121.62	853	93,690	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	846.28	720.56	9,526	1,046,012	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	221.99	163.04	783	86,071	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	353.36	309.95	10,513	1,154,348	ライフサイエンス・ツール/サービス
TIFFANY & CO	87.33	87.33	1,172	128,749	専門小売り

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	
GLOBE LIFE INC	106.61	72.82	807	88,711	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	143.84	—	—	—	情報技術サービス
DAVITA INC	108.78	81.59	701	77,025	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	110.88	95.73	939	103,187	専門小売り
TRIMBLE INC	200.73	200.73	910	99,974	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	28.51	964	105,885	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	246.07	227.36	1,830	200,986	食品
UGI CORP	147.25	147.97	617	67,750	ガス
MARATHON OIL CORP	718.46	584.18	621	68,248	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	638.7	544.82	10,024	1,100,710	陸運・鉄道
UNITED TECHNOLOGIES CORP	709.43	634.51	9,737	1,069,143	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	839.99	733.07	21,902	2,404,912	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	77.43	61.53	860	94,536	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	84.38	72.26	1,061	116,568	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	300.57	267.5	2,237	245,721	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	307.11	453.61	1,586	174,222	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	223.69	198.29	4,834	530,850	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	121.42	97.94	1,439	158,048	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	719.45	602.5	3,184	349,626	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,270.54	1,104.64	13,022	1,429,881	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	369.86	323	4,061	445,977	商業サービス・用品
WATERS CORP	69.53	54.68	1,181	129,719	ライフサイエンス・ツール/サービス
ALLERGAN PLC	296.2	252.62	5,009	550,093	医薬品
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	52.4	914	100,439	ヘルスケア機器・用品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	104.59	91.76	1,009	110,827	食品
VAIL RESORTS INC	37.73	31.09	775	85,140	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	260.76	225.67	1,562	171,591	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	75.3	149.64	1,152	126,596	機械
WHIRLPOOL CORP	55.53	46.14	702	77,086	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	162.96	139.02	1,654	181,631	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	92.4	79.7	1,053	115,636	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	91.32	90.2	1,048	115,084	資本市場
CME GROUP INC	304.37	276.73	5,897	647,594	資本市場
WILLIAMS COS INC	1,061.74	907.18	1,954	214,556	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	266.9	221.96	736	80,912	販売
ALLIANT ENERGY CORP	199.1	172.21	1,028	112,960	電力
WEC ENERGY GROUP INC	280.63	238.39	2,428	266,646	総合公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	256.64	218.2	1,080	118,689	資本市場
CARMAX INC	159.79	120.81	1,193	131,070	専門小売り
XEROX CORP	174.55	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
XILINX INC	210.93	189.97	1,712	188,082	半導体・半導体製造装置
CIMAREX ENERGY CO	92.53	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TJX COMPANIES INC	1,073.99	930.1	5,894	647,268	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	—	41.28	985	108,223	電子装置・機器・部品
ZIONS BANCORP NA	165.84	131.42	607	66,752	銀行
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	274	274	147	16,246	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	764	764	420	46,221	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	157	157	911	100,104	コンゴロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	171	545	59,876	コンゴロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	81.92	81.78	1,052	115,565	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	41.71	41.71	602	66,113	銀行
CBRE GROUP INC	294.99	236.13	1,510	165,829	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	198.35	127.32	258	28,420	メディア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	43.5	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	929.92	764.8	1,264	138,894	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	32.56	32.56	949	104,249	ホテル・レストラン・レジャー
WESTLAKE CHEMICAL CORP	30	30	194	21,358	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	
T-MOBILE US INC	302.13	256.75	2,477	271,988	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	333.32	277.59	1,889	207,473	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	314.33	282.49	529	58,157	化学
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	390.26	—	—	—	娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	917.84	—	—	—	娯楽
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	28.92	999	109,770	資本市場
CELANESE CORP	118.8	103.26	1,136	124,740	化学
DEXCOM INC	76.65	72.16	2,048	224,946	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	104.23	104.23	314	34,573	メディア
EXPEDIA GROUP INC	103.73	115.27	1,415	155,423	インターネット販売・通信販売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	184.75	707	77,693	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	124.93	103.12	1,843	202,470	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	418.18	340.23	661	72,659	メディア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	494.25	442.48	4,285	470,587	資本市場
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	146.96	146.96	252	27,738	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOM INC-CLASS B	302.82	—	—	—	娯楽
LIVE NATION	136.82	113.39	839	92,156	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	22.24	20.4	1,880	206,507	ホテル・レストラン・レジャー
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	61.91	45.08	358	39,375	旅客航空輸送業
TRANSDIGM GROUP INC	43.12	36.81	2,380	261,399	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	806.15	699.14	23,837	2,617,322	情報技術サービス
QURATE RETAIL INC	357.33	—	—	—	インターネット販売・通信販売
HANESBRANDS INC	276.19	276.19	394	43,365	繊維・アパレル・贅沢品
WESTERN UNION CO	352.22	352.22	924	101,479	情報技術サービス
OWENS CORNING	105.91	77.56	494	54,349	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	131.82	111.13	1,253	137,651	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	115.86	88.07	550	60,457	商社・流通業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	91.75	70.67	479	52,695	航空宇宙・防衛
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	180.99	173.5	371	40,767	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	105.19	91.76	1,122	123,200	情報技術サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	296.53	295.45	480	52,715	銀行
DELTA AIR LINES INC	138.98	111.58	657	72,161	旅客航空輸送業
INSULET CORP	—	47.81	1,015	111,458	ヘルスケア機器・用品
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	63.54	60.38	158	17,369	石油・ガス・消耗燃料
DISCOVER FINANCIAL	290.57	239.78	1,832	201,197	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	296.1	256.41	2,392	262,675	電子装置・機器・部品
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	178.07	159.7	1,244	136,650	石油・ガス・消耗燃料
WABCO HOLDING INC	40.76	40.76	554	60,870	機械
LULULEMON ATHLETICA INC	90.8	82.55	2,100	230,596	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	66.48	65.32	1,057	116,059	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	37.5	35	2,572	282,464	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	50.2	45.77	1,348	148,037	専門小売り
INVESCO LTD	421.25	334.43	594	65,288	資本市場
MSCI INC	75.37	67.14	2,165	237,790	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,360.77	1,203.48	10,650	1,169,457	タバコ
VISA INC	1,551.28	1,337.71	28,130	3,088,751	情報技術サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	159.33	145.36	2,025	222,362	水道
DISCOVERY INC-C	294.84	304.21	873	95,964	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	599.29	514.74	3,002	329,672	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	116.24	116.24	848	93,158	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,769.14	1,600.64	3,521	386,650	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	151.11	132.37	1,166	128,104	機械
ALKERMES PLC	120.53	—	—	—	バイオテクノロジー
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	289.87	208.76	1,724	189,334	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.79	34.79	856	94,050	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	122.4	111.94	1,931	212,044	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	—	40.23	952	104,578	情報技術サービス

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	
(アメリカ)	百株	百株	千円	
HCA HEALTHCARE INC	241.78	206.49	3,088	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	134.05	123.2	2,111	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	54.74	42.73	601	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	74.43	68.85	2,192	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	136.76	124.53	1,466	銀行
CIT GROUP INC	92.87	—	—	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	306	213.18	2,922	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	—	98.33	753	情報技術サービス
TARGA RESOURCES CORP	178.11	190.38	702	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	61.72	46.81	574	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	100.84	86.22	1,083	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	170	172.68	1,144	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	222.91	202.52	3,200	複合小売り
FORTINET INC	113.99	111.5	1,328	ソフトウェア
AON PLC	209.42	181.89	4,287	保険
TESLA INC	109.91	105.48	8,438	自動車
GENERAL MOTORS CO	1,100.5	1,006.95	3,500	自動車
WORLDPAY INC	265.92	—	—	情報技術サービス
XPO LOGISTICS INC	128.25	76.14	724	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC	92.63	92.63	274	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALLY FINANCIAL INC	398.19	318.71	1,046	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD	121.38	121.38	347	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC	135.25	102.73	642	各種金融サービス
APTIV PLC	225.71	189.2	1,671	自動車部品
PHILLIPS 66	381.15	342.35	3,063	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	58.85	720	ソフトウェア
FACEBOOK INC	2,102.8	1,861.56	39,870	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	134.26	134.53	2,210	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	131.09	114.24	856	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	150.71	144.06	5,130	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	79.35	72.72	1,798	ソフトウェア
WORKDAY INC	123.76	122.24	2,408	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,319.76	1,144.34	10,762	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	422.09	368.25	5,309	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	198.21	168.99	886	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	385.41	238.13	271	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	302.63	441	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC	128.91	140.75	590	商社・流通業
CDW CORP	130.4	114.06	1,577	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	638.82	638.82	555	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	101.99	101.99	297	旅客航空輸送業
ARCONIC INC	367.61	307.49	1,025	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	—	91.9	1,173	情報技術サービス
SNAP INC	—	571.3	1,003	インタラクティブ・メディアおよびサービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	178.52	143.04	670	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	50.06	50.06	247	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	179.31	142.05	706	メディア
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	154.1	154.1	238	繊維・アパレル・贅沢品
OKTA INC	—	88.16	1,208	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	—	127	944	情報技術サービス
BAKER HUGHES CO	434.04	510.05	1,121	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	126.11	106.69	1,015	食品
ALTICE USA INC-A	—	138.87	398	メディア
TECHNIPFMC LTD	387.24	312.57	539	エネルギー設備・サービス
BROADCOM INC	376.55	307.62	9,775	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	57.25	1,387	ソフトウェア
MONGODB INC	—	34.23	586	情報技術サービス

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	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円	
BURLINGTON STORES INC	60.07	50.95	1,251	137,441	専門小売り
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	99.85	—	—	—	保険
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	295.78	916	100,612	医薬品
ANTERO RESOURCES CORP	131.63	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
VEEVA SYSTEMS INC	108.52	97.33	1,546	169,781	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	562.56	575.62	2,124	233,282	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	132.14	645	70,919	電気設備
EVERGY INC	244.27	183.88	1,330	146,054	電力
PLAINS GP HOLDINGS LP	149.35	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
COMMSCOPE HOLDING CO INC	129.2	—	—	—	通信機器
ALLEGION PLC	73.25	74.69	1,037	113,911	建設関連製品
STERIS PLC	—	66.58	1,121	123,188	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	—	72.2	645	70,880	ソフトウェア
WIX.COM LTD	40	40	593	65,115	情報技術サービス
DROPBOX INC	—	175.73	325	35,753	ソフトウェア
KKR & CO INC	—	373.07	1,251	137,390	資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	105.53	609	66,869	医薬品
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	239.27	206.55	2,338	256,796	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	217.72	181.44	770	84,629	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA CORP	328.31	290.83	6,408	703,614	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	129.6	685	75,248	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	—	564.34	2,744	301,333	化学
AMCOR PLC	—	1,300	1,327	145,737	容器・包装
PINTEREST INC	—	131.83	306	33,610	インタラクティブ・メディアおよびサービス
XEROX HOLDINGS CORP	—	174.55	660	72,484	コンピュータ・周辺機器
FOX CORP-A	—	262.57	992	108,978	メディア
FOX CORP-B	—	130.09	485	53,293	メディア
UBER TECHNOLOGIES INC	—	133.12	527	57,969	陸運・鉄道
CORTEVA INC	—	593.22	1,821	200,031	化学
BLACKSTONE GROUP INC	—	508.89	3,203	351,740	資本市場
GRUBHUB INC	81.58	81.58	411	45,136	インターネット販売・通信販売
PAYCOM SOFTWARE INC	—	39.23	1,233	135,439	ソフトウェア
SABRE CORP	258.26	198.09	436	47,937	情報技術サービス
PARSLEY ENERGY INC	174.54	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ARISTA NETWORKS INC	44.41	44.41	992	108,968	通信機器
IHS MARKIT LTD	349.91	297.96	2,406	264,214	専門サービス
FNF GROUP	253.11	213.72	963	105,786	保険
SYNCHRONY FINANCIAL	605.68	439.86	1,484	163,001	消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	403.2	358.2	1,385	152,090	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	—	34.57	411	45,147	ソフトウェア
CDK GLOBAL INC	127.15	99.69	519	57,028	ソフトウェア
WAYFAIR INC	50.91	50.91	419	46,094	インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	155.15	139.54	1,369	150,395	電子装置・機器・部品
QORVO INC	108.87	88.71	940	103,267	半導体・半導体製造装置
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	160.89	168.88	589	64,733	各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	100.18	83.07	1,138	125,022	メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	231.55	170.18	508	55,851	化学
GODADDY INC	146.41	123.28	966	106,109	情報技術サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	328.27	262.04	560	61,543	専門サービス
TRANSUNION	172.08	150	1,471	161,620	専門サービス
SQUARE INC	268.2	264.87	2,168	238,071	情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	1,993.38	587.57	3,119	342,575	化学
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	171	193.21	1,065	116,997	飲料
WESTROCK CO	223.94	182.84	741	81,367	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	546.03	511.63	1,375	151,003	食品
FORTIVE CORP	267.79	225	1,750	192,229	機械
MATCH GROUP INC	—	45.99	351	38,630	インタラクティブ・メディアおよびサービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価価額		
			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	
WASTE CONNECTIONS INC	234.91	204.17	2,119	232,719	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	260.79	231.32	35,131	3,857,412	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,256.08	1,040.4	1,502	164,956	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	986.55	864.04	10,626	1,166,825	情報技術サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	232.2	354.71	953	104,728	各種金融サービス
FIRST DATA CORP	444.87	—	—	—	情報技術サービス
DXC TECHNOLOGY CO	237.34	208.48	642	70,550	情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC-C	81.34	81.66	423	46,490	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL C	273.82	242.52	36,880	4,049,532	インタラクティブ・メディアおよびサービス
BEIGENE LTD ADR	31.59	31.59	540	59,343	バイオテクノロジー
L3 TECHNOLOGIES INC	67.52	—	—	—	航空宇宙・防衛
CHEMOURS CO	127.23	—	—	—	化学
LINDE PLC	481.71	417.98	9,305	1,021,788	化学
ATHENE HOLDING LTD	117.84	118.47	571	62,802	保険
ROKU INC	—	66.74	869	95,447	娯楽
CHARTER COMMUNICATIONS INC	142.27	119.86	6,411	703,948	メディア
VISTRA ENERGY CORP	300	300	698	76,717	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数 銘柄数<比率>	株数 銘柄数	2,232,683	245,148,645	
	263,700.87 593銘柄	232,877.56 608銘柄	—	<66.2%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	202.81	163.02	1,076	89,232	金属・鉱業
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	397.22	684.96	3,017	250,065	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP	1,507.26	1,409.53	3,681	305,065	金属・鉱業
ATCO LTD	71.93	71.93	389	32,268	総合公益事業
BANK OF MONTREAL	550.83	502.86	5,119	424,211	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,049.73	945.61	7,066	585,533	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	285.53	255.48	1,884	156,143	銀行
BCE INC	115.68	116.73	750	62,221	各種電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	740.72	687.51	6,192	513,102	資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC	258.19	204.15	750	62,199	医薬品
BOMBARDIER INC 'B'	1,516.15	1,516.15	250	20,728	航空宇宙・防衛
SAPUTO INC	186.01	186.01	770	63,808	食品
BLACKBERRY LTD	396.52	396.52	306	25,397	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	—	363.21	792	65,698	総合公益事業
CGI INC	227.36	186.86	1,923	159,384	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	113.4	113.4	665	55,147	容器・包装
CAE INC	230	230	930	77,107	航空宇宙・防衛
CAMECO CORP	326.27	326.27	399	33,117	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	308.22	276.96	1,819	150,797	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	385.86	341.11	3,753	311,049	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,080.4	914.93	3,550	294,222	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	48.62	48.62	724	59,990	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	91.19	91.19	382	31,667	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	637.81	554.93	6,908	572,469	陸運・鉄道
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	114.17	—	—	—	エケイティブ不動産投資信託 (REITs)
GILDAN ACTIVEWEAR INC	201.76	159.11	586	48,635	繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	257.88	217.95	1,379	114,279	ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	150.93	476	39,481	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	997.41	997.41	667	55,289	金属・鉱業
FINNING INTERNATIONAL INC	98.92	—	—	—	商社・流通業
FORTIS INC	360	323.12	1,885	156,251	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	552.96	552.96	673	55,806	金属・鉱業
TELUS CORP	159.45	159.45	856	70,988	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	277.66	207.22	720	59,666	保険
IMPERIAL OIL LTD	215.42	215.42	685	56,762	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,771.76	1,565.99	8,774	727,033	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	84.26	29.53	116	9,643	資本市場

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	879.95	—	—	—	金属・鉱業
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,736.4	1,470.54	3,839	318,147	保険
LOBLAW CO LTD	153.54	153.54	1,091	90,443	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	285.9	239.09	1,623	134,556	自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	524.57	442.41	2,939	243,556	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	24.19	20.72	1,303	107,978	保険
METRO INC	192.26	199.49	1,113	92,302	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	287.49	287.49	238	19,724	石油・ガス・消耗燃料
EMERA INC	65.09	191.38	1,135	94,084	電力
METHANEX CORP	52.81	52.81	235	19,494	化学
ONEX CORP	66.46	66.46	572	47,458	各種金融サービス
GOLDCORP INC	819.02	—	—	—	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	379.42	237.92	817	67,776	保険
POWER FINANCIAL CORP	277.73	216.76	780	64,658	保険
QUEBECOR INC-B	—	113.31	372	30,870	メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,255.49	1,113.11	12,054	998,875	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	131.34	—	—	—	建設・土木
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	128.84	107.47	3,856	319,581	陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	357.48	354.31	917	76,008	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,424.03	1,191.41	4,700	389,451	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	718.05	434.8	318	26,408	金属・鉱業
ENCANA CORP	1,275.17	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	410.16	731	60,596	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	192.18	163.94	1,779	147,455	専門サービス
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,574.19	1,409.24	10,610	879,158	銀行
TC ENERGY CORP	805.43	717.04	5,350	443,346	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	56.96	56.96	359	29,814	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	82.39	61.84	683	56,636	食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	127.16	109.89	1,678	139,077	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	424.47	349.63	1,389	115,157	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	17.29	15.65	2,305	191,029	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	168.87	149.22	2,285	189,397	金属・鉱業
CI FINANCIAL CORP	206.95	206.95	519	43,024	資本市場
TOURMALINE OIL CORP	274.1	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	232.06	166.68	599	49,692	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND FUEL CORP	—	105.83	504	41,819	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	239.44	239.44	534	44,302	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	437.84	426.84	2,251	186,530	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	282.95	235.36	1,026	85,047	複合小売り
STARS GROUP INC	185.29	185.29	573	47,517	ホテル・レストラン・レジャー
CENOVUS ENERGY INC W/I	805.45	807.21	954	79,058	石油・ガス・消耗燃料
VERMILION ENERGY INC	129.23	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ARC RESOURCES LTD	229.97	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	152.5	747	61,942	金属・鉱業
INTER PIPELINE LTD	386.09	279.46	609	50,526	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	542.24	444.53	2,429	201,333	化学
CRONOS GROUP INC	—	160	155	12,846	医薬品
WSP GLOBAL INC	84	84	812	67,284	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	129.97	81.04	560	46,460	保険
OVINTIV INC	—	192.78	405	33,576	石油・ガス・消耗燃料
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	149.61	149.61	216	17,913	石油・ガス・消耗燃料
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	172.31	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
AIR CANADA	—	107.22	495	41,062	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	206.64	196.85	1,754	145,347	ホテル・レストラン・レジャー
AURORA CANNABIS INC	500	665.62	137	11,361	医薬品
SHOPIFY INC	76.71	76.05	5,355	443,739	情報技術サービス
CANOPY GROWTH CORP	186.34	186.34	558	46,289	医薬品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	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	
HYDRO ONE LTD	273.4	273.4	801	66,375	電力
小 計	株 数 : 36,595.21 銘柄 数 <比率> : 88銘柄	株 数 : 30,926.62 銘柄 数 <比率> : 85銘柄	157,018	13,010,568	<3.5%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	111.15	124.32	991	73,099	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	2,516.48	2,181.8	5,805	428,059	銀行
AMCOR LTD	1,101.42	—	—	—	容器・包装
WESTPAC BANKING CORPORATION	2,932.6	2,654.07	6,820	502,909	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	305.69	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,141.25	1,156.62	1,271	93,720	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	3,606.54	2,969.65	1,119	82,545	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	390.14	390.14	412	30,404	銀行
AMP LTD	3,024.14	3,024.14	551	40,691	各種金融サービス
ASX LTD	155.73	155.73	1,280	94,439	資本市場
BHP GROUP LTD	2,596.25	2,281.36	8,817	650,111	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LTD	209.46	209.46	702	51,812	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	221.82	148.67	71	5,261	複合小売り
COMPUTERSHARE LT	380.4	380.4	663	48,885	情報技術サービス
CSL LIMITED	396.08	351.66	11,646	858,705	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	41.19	41.19	468	34,539	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,233.54	2,064.75	3,379	249,207	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	486.01	486.01	578	42,677	飲料
COCHLEAR LTD	53.74	43.81	1,020	75,261	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,630.57	1,328.6	1,030	76,015	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,535.19	1,370.26	12,467	919,265	銀行
BORAL LIMITED	861.01	861.01	406	29,963	建設資材
RIO TINTO LIMITED	325.62	280.81	2,742	202,175	金属・鉱業
APA GROUP	1,161.93	941.06	1,079	79,583	ガス
ARISTOCRAT LEISU	531.68	453.23	1,683	124,142	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,067.89	1,805.73	1,226	90,399	保険
TPG TELECOM LTD	287.19	287.19	231	17,066	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32.75	32.75	127	9,409	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	460.91	339.26	1,034	76,291	建設資材
ORICA LTD	253.08	278.65	625	46,082	化学
CIMIC GROUP LTD	87.09	87.09	238	17,587	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD	—	429.74	766	56,493	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	369.41	369.41	522	38,539	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	851.3	851.3	730	53,853	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	282.5	247.65	3,679	271,295	資本市場
WORLEY LTD	358.28	277.72	392	28,953	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	1,079.13	1,047.83	1,317	97,111	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,341.96	2,264.21	6,192	456,581	銀行
NEWCREST MINING LTD	696.38	620.8	1,737	128,114	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,388.06	1,054.7	682	50,312	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,364.26	1,364.26	421	31,081	化学
QANTAS AIRWAYS LIMITED	—	622.82	400	29,526	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,294.36	1,078.2	1,525	112,486	保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	457.07	457.07	461	34,036	各種金融サービス
SANTOS LTD	1,338.62	1,328.62	1,088	80,228	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	430.41	346.84	1,097	80,885	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	44.66	99	7,356	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	1,942.74	1,485.35	690	50,924	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	968.21	860.51	3,928	289,628	複合小売り
ALUMINA LIMITED	1,846.13	1,846.13	407	30,081	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM LTD	791.15	759.44	2,493	183,826	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,175.57	956.47	4,126	304,225	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	99.95	736	54,289	資本市場

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	
			千オーストラリア・ドル	千円			
(オーストラリア)	百株	百株					
SEEK LTD	258.99	258.99	612	45,141			専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	45.81	—	—	—			ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	288	21,237			電力
AGL ENERGY LTD	606.49	496.44	1,026	75,694			総合公益事業
BRAMBLES LTD	1,440.62	1,266.93	1,602	118,164			商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	391	28,831			ホテル・レストラン・レジャー
AURIZON HOLDINGS LTD	1,909.69	1,501.5	822	60,666			陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	691.79	576.67	651	48,002			飲料
MEDIBANK PVT LTD	2,734.24	2,069.1	631	46,529			保険
SOUTH32 LTD(AUD)	4,431.6	3,575.25	940	69,327			金属・鉱業
COLES GROUP LTD	968.21	816.08	1,385	102,167			食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	—	80	232	17,134			ソフトウェア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	65,230.79 61銘柄	57,763.33 62銘柄	110,579	8,153,048	—	<2.2%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円			
ASM PACIFIC TECH	327	191	2,183	30,847			半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	2,984	42,175			不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,536.6	1,038.6	1,819	25,711			銀行
CLP HOLDINGS LTD	1,495	1,210	9,982	141,052			電力
PCCW LTD	3,310	3,310	1,585	22,402			各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	490	495	2,734	38,643			電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,024.4	944.4	25,461	359,764			資本市場
MTR CORP	1,500	1,260	5,701	80,562			陸運・鉄道
HANG LUNG GROUP LTD	630	—	—	—			不動産管理・開発
HANG SENG BANK LTD	654	577	9,457	133,627			銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,322.28	1,154.5	4,294	60,684			不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,230	1,015	5,785	81,749			電力
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	957.5	—	—	—			不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	8,370.5	7,767.55	11,822	167,047			ガス
HYSAN DEVELOPMENT CO	500	—	—	—			不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,030	1,570	8,980	126,893			ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES LTD	735	735	1,804	25,496			不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,240	2,750	7,672	108,412			銀行
NWS HOLDINGS LTD	1,350	1,350	1,401	19,800			コングロマリット
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	505	505	1,060	14,984			繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	6,052.66	4,842.66	5,055	71,437			不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,040	—	—	—			ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO	2,554	2,554	2,829	39,985			不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,350	1,250	14,437	204,001			不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	475	305	2,269	32,063			不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,135	1,135	8,047	113,706			機械
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	700	2,159	30,513			食品
WHEELOCK & CO LTD	860	640	3,132	44,266			不動産管理・開発
MINITH GROUP LTD	440	—	—	—			自動車部品
SJM HOLDINGS LTD	1,560	1,560	1,500	21,205			ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	1,244	2,169	30,655			ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD	648	—	—	—			ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD	10,630.27	9,356.27	75,458	1,066,226			保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,820	2,890	3,450	48,757			各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	2,328	1,992	8,057	113,854			ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,636	37,250			不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	957.5	957.5	4,059	57,364			不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,805	25,511			電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	—	1,019	2,379	33,620			飲料
WH GROUP LTD	7,015	7,425	6,103	86,240			食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,428.32	2,088.32	14,795	209,063			コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,228.32	1,983.32	10,283	145,306			不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	81,955.35 40銘柄	72,797.12 36銘柄	275,363	3,890,888	—	<1.1%>

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	
SINGAPORE TECH ENG	1,250	1,250	537	42,419	航空宇宙・防衛
SEMBCORP INDUSTRIES	814	814	166	13,105	コングロマリット
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,237	1,237	253	20,012	メディア
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,921.4	—	—	—	食品
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,581	1,419	3,625	286,128	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	290	364	406	32,087	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	59.44	59.44	173	13,678	販売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	901	478	211	16,711	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	689	635	50,134	資本市場
CAPITALAND LTD	1,924.15	2,045.15	760	60,042	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	4,164	4,164	368	29,083	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,684	1,011	679	53,617	コングロマリット
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,779	1,779	387	30,606	陸連・鉄道
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,670.53	2,515.53	2,782	219,569	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,343.22	6,071.22	1,954	154,283	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	475	475	409	32,313	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,205	952	2,499	197,221	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	405	333	26,305	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	210	210	358	28,307	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,423	1,423	583	46,044	食品
YANGZHIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	1,888	1,888	187	14,825	機械
小計	株数 38,913.74 銘柄数 21	株数 29,249.34 銘柄数 20	17,314	1,366,497	
			—	<0.4%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,145.5	852.45	711	50,259	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	298.94	298.94	509	36,010	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	550.91	876	61,889	食品
FISHER & PAYKEL	426.78	431.84	1,048	74,035	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	641.04	641.04	335	23,672	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	1,596.23	760	53,706	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	—	617.34	329	23,233	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	901.73	756.56	422	29,808	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数 5,561.13 銘柄数 7	株数 5,745.31 銘柄数 8	4,993	352,616	
			—	<0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	463.24	317.98	276	39,524	金属・鉱業
ASHTREAD GROUP	421.54	366.89	982	140,751	商社・流通業
SEVERN TRENT PLC	255.3	182.17	475	68,060	水道
BHP GROUP PLC	1,823.43	1,612.84	2,701	386,901	金属・鉱業
BARCLAYS PLC	15,069.06	13,428.31	2,362	338,244	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,037.64	822.83	716	102,582	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	7,604.43	6,307.77	968	138,652	各種電気通信サービス
BUNZL PLC	278.38	278.38	538	77,136	商社・流通業
EASYJET PLC	136.28	136.28	204	29,243	旅客航空輸送業
AVIVA PLC	3,504.51	3,146.91	1,293	185,166	保険
CRODA INTERNATIONAL	106.45	103.91	525	75,292	化学
DIAGEO PLC	2,129.15	1,828.12	5,629	806,172	飲料
SCHROEDERS PLC	109.32	109.32	369	52,928	資本市場
DCC PLC	97.53	78.98	493	70,709	コングロマリット
NATIONAL GRID PLC	2,937.75	2,646.42	2,752	394,126	総合公益事業
KINGFISHER PLC	1,656.8	1,656.8	359	51,412	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	2,689.2	2,486.72	1,599	229,042	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,009.84	1,772.72	5,933	849,647	タバコ
HALMA PLC	—	279.01	613	87,819	電子装置・機器・部品
NEXT PLC	120.64	100.18	714	102,256	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	843.12	716.56	1,307	187,265	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	150.17	150.17	397	56,900	化学

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価価額		
			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	
ANGLO AMERICAN PLC	967.27	789.81	1,653	236,776	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,394.09	1,195.6	2,320	332,318	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	17,450.53	15,612.12	9,125	1,306,740	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,084.63	4,527.58	1,441	206,434	保険
CENTRICA PLC	4,713.4	4,713.4	335	48,057	総合公益事業
UNILEVER PLC	1,003.06	855.86	3,941	564,446	パーソナル用品
MEGGITT PLC	621.81	621.81	401	57,521	航空宇宙・防衛
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	2,305.51	1,686.76	306	43,888	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	544.87	544.87	551	78,961	水道
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	808.64	808.64	464	66,537	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	302.4	255.47	681	97,640	食品
PEARSON PLC	650.09	650.09	370	53,081	メディア
PERSIMMON PLC	260.85	260.85	842	120,652	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,219.79	2,049.4	3,025	433,314	保険
RIO TINTO PLC	996.24	874.36	3,669	525,499	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	23,320.41	20,437.18	3,065	438,990	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	582.78	544.64	3,451	494,316	家庭用品
RELX PLC	1,736.66	1,475.23	3,058	437,927	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	-	1,406.17	691	99,010	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,389.93	1,392.68	943	135,055	航空宇宙・防衛
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	4,494.43	3,974.34	846	121,280	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	611.91	376.85	447	64,110	資本市場
SSE PLC	844.79	746.84	1,239	177,425	電力
BP PLC	17,559.46	15,740.09	7,190	1,029,618	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	852.71	871.11	682	97,773	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	317.2	317.2	551	78,945	コングロメリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	-	55.18	511	73,288	機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,583.66	2,183.29	1,386	198,593	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	61,338.35	53,939.91	3,052	437,189	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	2,530.22	2,522.87	584	83,743	家庭用耐久財
TESCO PLC	8,771.57	7,573.16	1,937	277,409	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	886.62	766.43	893	127,971	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	749.03	680.27	1,237	177,197	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,360.21	3,862.19	6,444	922,845	医薬品
WEIR GROUP	183.36	191.61	264	37,878	機械
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	262.66	246.6	2,027	290,273	資本市場
BABCOCK INT'L GROUP	213.02	-	-	-	商業サービス・用品
WPP PLC	1,074.94	951.48	929	133,145	メディア
FERGUSON PLC	210.79	-	-	-	商社・流通業
ASTRAZENECA PLC	1,112.61	1,015.56	7,413	1,061,625	医薬品
WHITBREAD PLC	156.39	98.14	467	66,979	ホテル・レストラン・レジャー
CARNIVAL PLC	164.92	133.5	413	59,186	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,202.9	1,767.3	324	46,515	複合小売り
JOHN WOOD GROUP PLC	489.88	-	-	-	エネルギー設備・サービス
INTERTEK GROUP PLC	143.35	120.83	712	102,017	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	387.27	316.86	633	90,680	繊維・アパレル・贅沢品
INVESTEC PLC	506.55	-	-	-	資本市場
INTERCONTINENTAL HOTELS	151.25	124.6	595	85,270	ホテル・レストラン・レジャー
ITV PLC	3,709.08	2,543.08	345	49,526	メディア
SAINSBURY (J) PLC	1,372.15	1,372.15	282	40,477	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	1,222.5	1,222.5	245	35,187	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	158.93	369	52,936	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	107.26	82.33	438	62,768	家庭用耐久財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,047.66	3,336.87	6,420	919,363	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,247.53	2,863.67	5,518	790,219	石油・ガス・消耗燃料
TUI AG-DI	450.43	298.24	267	38,326	ホテル・レストラン・レジャー
AVEVA GROUP PLC	-	57.04	301	43,168	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,147.15	2,011.44	654	93,785	資本市場
EXPERIAN PLC	803.95	698.42	1,971	282,338	専門サービス
MONDI PLC	283.18	397.67	661	94,673	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	212.9	209.27	353	50,630	資本市場
FRESNILLO PLC NPR	156.39	—	—	—	金属・鉱業
OCADO GROUP PLC	—	310.11	361	51,801	インターネット販売・通信販売
INFORMA PLC	1,024.75	1,024.75	797	114,196	メディア
GLENCORE PLC	9,828.06	8,664.21	2,026	290,203	金属・鉱業
GVC HOLDINGS PLC	496.18	496.18	415	59,442	ホテル・レストラン・レジャー
EVRAZ PLC	—	487.65	187	26,920	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	81.49	81.49	63	9,043	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	56,159	保険
COCA-COLA HBC AG	194.47	152.08	431	61,849	飲料
CONVATEC GROUP PLC	1,184	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
ROYAL MAIL PLC	550.6	—	—	—	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	500.37	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
FERGUSON PLC	—	171.28	1,294	185,328	商社・流通業
M&G PLC	—	2,049.4	510	73,075	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	—	320.86	278	39,854	専門小売り
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	323.42	261	209	29,974	ソフトウェア
AUTO TRADER GROUP PLC	763.48	763.48	449	64,395	インターネット・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,176.2	3,647.35	866	124,046	電気設備
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	260,125.86 92銘柄	232,616.39 93銘柄	138,461 —	19,827,669 <5.4%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	784.28	797.54	2,280	72,965	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,280.49	1,063.99	2,597	83,110	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	1,882.3	—	—	—	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	17.6	17.6	952	30,486	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	—	1,021.34	1,581	50,593	銀行
ISRAEL CHEMICALS LTD	494.11	494.11	684	21,898	化学
NICE LTD	60.65	49.02	3,015	96,487	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	104.44	104.44	994	31,816	銀行
AZRIELI GROUP	44.28	22.91	641	20,527	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,668.15 8銘柄	3,570.95 8銘柄	12,746 —	407,884 <0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,180.4	1,914.83	2,576	288,067	資本市場
NESTLE SA-REGISTERED	2,679.67	2,303.64	24,777	2,770,422	食品
CIE FINANCIER RICHEMONT	465.47	409.15	3,047	340,724	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	613.98	544.32	18,539	2,072,905	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	36.07	28.96	701	78,392	機械
SIKA INHABER	112.91	102.09	1,903	212,883	化学
SGS SA-REG	4.84	4.24	1,125	125,819	専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS	1,875.05	1,662.22	15,894	1,777,124	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R	41.27	32.52	590	66,030	保険
BARRY CALLEBAUT AG	1.44	2.65	581	65,066	食品
CLARIANT AG-REG	194.96	122.82	290	32,532	化学
SWISSCOM AG-REG	22.8	19.6	1,119	125,133	各種電気通信サービス
ABB LTD	1,623.58	1,408.52	3,350	374,660	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	123.41	129.44	755	84,433	専門サービス
GEBERIT AG	32.43	29.01	1,520	170,029	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG	62.28	57.93	2,415	270,032	ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDT & SPRUENGLI PART	1.05	0.79	661	73,976	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.09	0.09	822	91,974	食品
GIVAUDAN-REG	7.71	7.42	2,470	276,266	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	130.46	115.58	5,005	559,695	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	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
LAFARGEHOLCIM LTD	406.15	379.97	1,888	211,147	建設資材
TEMENOS GROUP	45.21	47.3	792	88,610	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG	53.19	45.84	1,172	131,055	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG	51.05	40.18	638	71,363	海運業
STRAUMANN HOLDING AG	7.82	7.94	766	85,723	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	26.91	21.34	539	60,366	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	45.92	221	24,819	繊維・アパレル・贅沢品
SCHINDLER NAMEN	16.63	16.63	390	43,621	機械
SWISS LIFE HOLDING AG	31.19	24.58	1,270	142,086	保険
VIFOR PHARMA AG	45.83	34.65	652	73,009	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING	9.04	6.33	407	45,614	化学
SWISS PRIME SITE AG	59.9	59.9	739	82,646	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING PORTEUR	30	30	242	27,085	各種金融サービス
DUFREY GROUP	23.9	31.38	268	30,033	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	15.05	15.05	1,419	158,716	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	178.49	178.49	897	100,303	資本市場
SWISS RE LTD	276.09	225.97	2,607	291,566	保険
ALCON INC	-	320.32	1,969	220,154	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG	3,364.64	3,016.86	3,911	437,329	資本市場
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	108,947 -	12,181,428 <3.3%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
CARLSBERG AS-B	96.44	84.41	8,656	137,807	飲料
A P MOLLER A/S	6.04	4.91	4,212	67,067	海運業
AP MOLLER MAERSK A	2.73	2.73	2,200	35,030	海運業
DANSKE BANK A/S	611.14	510.34	6,203	98,754	銀行
GENMAB A/S	56.22	50.14	8,187	130,350	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS	191.11	155.33	5,874	93,523	化学
NOVO NORDISK A/S-B	1,596.6	1,369.25	59,706	950,521	医薬品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	158.08	139.63	9,723	154,803	電気設備
COLOPLAST-B	112.12	97.29	9,230	146,955	ヘルスケア機器・用品
DSV PANALPINA A S	171.23	176.26	13,713	218,311	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	65.37	72.44	1,682	26,778	ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S	48.4	48.4	1,260	20,072	医薬品
TRYG A/S	111.07	111.07	2,303	36,673	保険
PANDORA A/S	82.51	82.51	2,813	44,792	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	77.08	75.39	4,108	65,411	化学
ISS A/S	162.4	111.07	1,882	29,971	商業サービス・用品
ORSTED A/S	172.49	150.9	11,211	178,492	電力
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	152,972 -	2,435,317 <0.7%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
MOWI ASA	330	351.83	7,895	93,714	食品
DNB ASA	797.83	713.52	12,504	148,427	銀行
NORSK HYDRO ASA	1,371.9	931.39	2,748	32,625	金属・鉱業
TELENOR ASA	620.76	547.66	8,883	105,441	各種電気通信サービス
ORKLA ASA	848.09	649.38	5,747	68,217	食品
EQUINOR ASA	983.97	810.22	13,028	154,646	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	160	121.71	4,607	54,696	化学
AKER BP ASA	85.52	85.52	2,197	26,078	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	166.83	3,461	41,090	保険
SCHIBSTED ASA	74.45	74.45	1,935	22,976	メディア
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	63,008 -	747,914 <0.2%>	
(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	571.91	522.84	19,679	222,577	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	383.14	287.68	9,525	107,728	機械

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	
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ERICSSON LM-B SHS	2,717.83	2,361.6	20,829	235,579	通信機器
LUNDBERGS B	73.82	73.82	3,284	37,153	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	371.98	288.12	5,493	62,125	機械
SANDVIK AB	967.46	877.84	16,187	183,079	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,475.88	1,308.27	13,121	148,409	銀行
SKANSKA AB-B SHS	325.47	244	5,824	65,872	建設・土木
SWEDBANK AB	824.1	719.58	11,293	127,732	銀行
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,265.39	1,121.06	12,281	138,900	銀行
VOLVO AB-B SHS	1,416.08	1,192.27	20,668	233,755	機械
SWEDISH MATCH AB	164.88	129.41	7,686	86,939	タバコ
TELE2 AB-B SHS	448.76	346.18	5,085	57,515	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN C	114.03	114.03	2,884	32,628	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	191.91	4,277	48,380	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	240.98	240.98	3,577	40,459	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	376.57	351.8	19,813	224,089	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	777.79	602.83	12,327	139,428	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	883.27	810.88	19,550	221,114	建設関連製品
TELIA CO AB	2,318.55	2,318.55	9,603	108,614	各種電気通信サービス
LUNDIRN PETROLEUM AB	167.9	121.46	3,655	41,348	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	218.55	218.55	5,100	57,691	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	233.43	233.43	5,926	67,031	機械
KINNEVIK AB-B	183.1	183.1	4,255	48,126	各種金融サービス
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	53.32	78.44	3,556	40,223	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	59.2	59.2	2,362	26,715	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	336.92	2,466	27,893	家庭用耐久財
HEXAGON AB	220.37	211.45	11,959	135,263	電子装置・機器・部品
EPIROC AB-A	633.58	489.55	5,837	66,026	機械
EPIROC AB-B	308.99	308.99	3,627	41,027	機械
ESSITY AB-B	525.22	466.4	14,714	166,425	家庭用品
NORDEA BANK ABP	2,678.38	2,592.68	22,229	251,417	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	308,689	3,491,276	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	713.94	619.9	2,217	263,779	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	62.46	62.46	636	75,714	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	138.65	122.58	1,430	170,173	食品
KINGSPAN GROUP PLC	147.56	117.68	706	83,995	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	173.97	173.97	606	72,103	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,063.63	822.56	339	40,334	銀行
AIB GROUP PLC	523.22	413.52	99	11,796	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	6,034	717,896	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	515.53	451.22	5,859	697,051	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	151.11	137.16	1,586	188,700	化学
ING GROEP NV-CVA	3,412.95	3,045.08	3,261	387,961	銀行
RANDSTAD NV	120.61	90.74	500	59,563	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,096.41	890.26	2,063	245,488	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	230.51	195.82	2,033	241,915	飲料
AKZO NOBEL	187.86	174.91	1,524	181,356	化学
ASML HOLDING NV	360.62	330.53	9,682	1,151,874	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,503.49	1,503.49	572	68,072	保険
UNILEVER NV-CVA	1,348.83	-	-	-	パーソナル用品
KONINKLIJKE PHILIPS NV	832.6	719.25	3,204	381,178	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	250.51	206.87	1,446	172,018	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	556.11	556.11	1,609	191,518	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	173.87	179.74	616	73,297	ライフサイエンス・ツール/サービス

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…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOPAK (KON.)	53.64	53.64	272	32,428	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV	2,910.29	2,910.29	727	86,586	各種電気通信サービス
HEINEKEN HOLDING NV-A	97.91	97.91	907	107,971	飲料
UNILEVER NV	—	1,131.34	6,205	738,194	パーソナル用品
FERRARI NV	108.95	89.34	1,427	169,780	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	943.17	779.51	683	81,306	機械
PROSUS NV	—	368.71	2,651	315,365	インターネット販売・通信販売
NN GROUP NV	285.28	217.2	784	93,301	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	899.77	790.84	969	115,358	自動車
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	—	90	846	100,693	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ABN AMRO BANK NV	342.51	342.51	520	61,871	銀行
EXOR NV	77.26	79.71	595	70,870	各種金融サービス
ALTICE EUROPE NV	—	567.63	370	44,107	メディア
ADYEN NV	—	8.18	722	85,982	情報技術サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	51,646	6,143,817	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	191.09	141.15	635	75,543	化学
KBC GROUPE	208.03	185.77	1,346	160,130	銀行
SOLVAY SA	70.86	55.63	542	64,536	化学
AGEAS	179.04	143.65	756	89,954	保険
UCB SA	112.67	90.95	816	97,093	医薬品
COLRUYT NV	46.73	46.73	216	25,793	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	84.48	66.89	627	74,638	各種金融サービス
PROXIMUS	142.83	142.83	376	44,805	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	—	34.26	820	97,650	バイオテクノロジー
TELENET GROUP HOLDING NV	36.34	36.34	150	17,845	メディア
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	658.58	587.31	3,979	473,344	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	10,266	1,221,337	
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELOR MITTAL (NL)	581.89	467.14	748	89,046	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	7.94	8.99	423	50,371	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	369.59	369.59	355	42,339	エネルギー設備・サービス
SES FDR	342.68	288.47	318	37,919	メディア
RTL GROUP SA	34.46	—	—	—	メディア
AROUNDTOWN SA	717.83	717.83	630	74,975	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	2,476	294,652	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	370.92	363.17	5,040	599,653	化学
AXA	1,652.52	1,481.6	3,772	448,735	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	496.32	444.49	1,246	148,318	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	2.74	1.63	177	21,174	航空宇宙・防衛
DANONE	540.23	488.33	3,541	421,281	食品
SAFRAN SA	292.68	258.98	3,755	446,719	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	160	122.77	472	56,242	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	222.76	175.72	678	80,729	建設・土木
BNP PARIBAS	969.88	864.34	4,639	551,947	銀行
THALES SA	98.83	85.49	820	97,630	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	137.59	125.15	1,438	171,135	情報技術サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	42.64	42.64	157	18,676	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	43.34	43.34	593	70,633	電子装置・機器・部品
NATIXIS	701.66	701.66	305	36,317	資本市場
EIFFAGE	59.49	64.61	713	84,930	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	182.22	151.98	621	73,981	メディア
FAURECIA	61.17	61.17	263	31,304	自動車部品

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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IMERYS SA	22.56	—	—	—	建設資材
L'OREAL	215.81	195.54	5,244	623,871	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	244.37	214.86	8,915	1,060,601	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	713.47	713.47	268	31,929	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	150.18	124.22	1,351	160,776	自動車部品
PERNOD-RICARD	184.79	167.19	2,775	330,156	飲料
PEUGEOT SA	500.87	439.05	850	101,168	自動車
RENAULT SA	177.86	149.17	514	61,221	自動車
REMY COINTREAU	18.6	18.6	186	22,170	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	443.31	394.36	1,415	168,370	建設関連製品
SEB SA	14.05	15.51	185	22,122	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	697.92	611.81	1,941	230,933	銀行
VINCI S.A.	438.89	392.37	4,151	493,835	建設・土木
SODEXO	86.39	70.75	706	84,012	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	480.32	436.56	4,234	503,751	電気設備
VIVENDI SA	935.6	679.89	1,720	204,625	娯楽
TOTAL SA	2,125.19	1,860.2	8,417	1,001,334	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	247.98	196.53	534	63,614	自動車部品
ORANGE	1,726.54	1,512.46	2,020	240,376	各種電気通信サービス
HERMES INTL	27.03	24.83	1,750	208,241	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	24.78	—	—	—	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	109.13	99.53	1,545	183,876	ソフトウェア
KERING	66.09	58.3	3,377	401,835	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	235	28,003	保険
CARREFOUR SA	510.94	510.94	810	96,368	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	88.16	73.04	590	70,240	情報技術サービス
SANOFI	977.88	871.69	8,040	956,494	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	59.11	59.35	443	52,712	娯楽
TELEPERFORMANCE	53.63	43.83	1,058	125,970	専門サービス
EURAZEO	47.25	27.48	180	21,444	各種金融サービス
JC DECAUX SA	60.58	60.58	139	16,546	メディア
ESSILORLUXOTTICA	241.21	217.61	3,032	360,733	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	999.73	862.05	1,162	138,339	銀行
WENDEL	22.2	22.2	278	33,169	各種金融サービス
ILIAD SA	21.02	21.02	283	33,682	各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	32.48	32.48	302	35,933	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	28.81	18.84	341	40,655	ライフサイエンス・ツール/サービス
ENGIE	1,597.35	1,392.72	2,247	267,321	総合公益事業
ALSTOM	120.46	157.12	763	90,838	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	125.42	125.42	154	18,336	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	538	538	692	82,336	電力
IPSEN SA	36.46	36.46	249	29,688	医薬品
ARKEMA SA	52.3	50.33	432	51,502	化学
LEGRAND SA	233.08	206.73	1,573	187,149	電気設備
ADP	23.13	23.13	390	46,418	運送インフラ
SCOR SE	138.75	101.16	376	44,802	保険
REXEL SA	232.45	—	—	—	商社・流通業
BUREAU VERITAS SA	214.8	231.79	591	70,423	専門サービス
GETLINK	376.46	376.46	627	74,609	運送インフラ
SUEZ SA	383.31	266.2	399	47,500	総合公益事業
EDENRED	226.52	191.88	948	112,874	情報技術サービス
WORLDLINE SA	—	77.58	573	68,247	情報技術サービス
AMUNDI SA	38.94	41.19	316	37,656	資本市場
小計	株数	株数	金額	金額	
	23,307.02	20,629.42	107,584	12,798,244	
	69銘柄	67銘柄	—	<3.5%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	163.56	139	4,008	476,882	繊維・アパレル・贅沢品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価価額		
			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	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	303.04	252.51	1,663	197,834	自動車
COMMERZBANK AG	831.18	831.18	549	65,357	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA	346.4	314.63	1,529	181,901	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	305	36,289	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	55.46	233	27,735	化学
HANNOVER RUECK SE	48.68	48.68	934	111,186	保険
GEA GROUP AG	118.38	118.38	328	39,121	機械
CONTINENTAL AG	95.28	83.12	920	109,558	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	866.63	760.32	2,528	300,783	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	77.92	-	-	-	メディア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	132.49	126.49	822	97,807	自動車
MERCK KGAA	111.93	98.5	1,205	143,364	医薬品
RWE AG	459.05	464.89	1,550	184,436	総合公益事業
SAP SE	864.71	760.71	9,671	1,150,541	ソフトウェア
E.ON SE	1,974.27	1,813.17	2,013	239,507	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	93	75.85	629	74,936	家庭用品
SIEMENS AG-REG	671.82	591.13	6,304	750,041	コンプロマリット
PUMA AG	6	73.51	528	62,918	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	817.67	720.11	5,571	662,784	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	153.5	137.59	1,283	152,710	家庭用品
DAIMLER AG	807.58	694.81	2,992	355,952	自動車
BASF SE	798.36	705.54	4,410	524,652	化学
BEIERSDORF AG	83.71	83.71	885	105,357	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	17.07	17.07	192	22,905	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	141.26	120.31	764	90,967	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	184.94	162.14	1,207	143,658	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE	374.94	329.44	7,618	906,272	保険
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	176.02	-	-	-	メディア
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	249.26	160.96	244	29,123	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	129.66	110.91	3,130	372,462	保険
VOLKSWAGEN AG	35.45	26.45	453	53,899	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	153.82	144.01	2,454	292,022	自動車
THYSSENKRUPP AG	378.94	271.1	303	36,087	金属・鉱業
1&1 DRILLISCH AG	31.49	-	-	-	無線通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,719.85	1,493.84	1,521	181,012	資本市場
BMW VORZUG	41.16	41.16	215	25,583	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,887.79	2,635.92	4,119	490,108	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG	27.12	27.12	627	74,589	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	990.68	990.68	2,235	265,990	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG	-	37.71	410	48,852	ヘルスケア機器・用品
DEUTSCHE BOERSE AG	169.13	145.25	2,235	265,922	資本市場
FRAPORT AG	31.49	31.49	217	25,930	運送インフラ
WIRECARD AG	98.91	89.63	1,244	148,100	情報技術サービス
LANXESS AG	68.56	68.56	392	46,700	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	48.59	41.68	1,172	139,525	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN	306.89	269.47	1,048	124,698	不動産管理・開発
SYMRISE AG	115.48	99.88	987	117,462	化学
BRENTAG AG	123.53	123.53	614	73,108	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	227.84	171.16	463	55,138	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	615.41	615.41	158	18,909	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG -ORD	52.18	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
OSRAM LICHT AG	70.17	-	-	-	電気設備
KION GROUP AG	46.86	45.67	271	32,347	機械
VONOVIA SE	407.75	386.17	2,053	244,302	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	-	44.92	443	52,816	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	152.54	114.68	459	54,644	ヘルスケア機器・用品
METRO AG	107.74	107.74	135	16,117	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	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	
INNOGY SE-TEMPORARY	97.69	—	—	—	総合公益事業
ZALANDO SE	143.53	99.64	472	56,267	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	158.02	127.08	496	59,109	化学
UNIPER SE	138.97	142.52	420	50,048	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	72.38	80.81	640	76,193	インターネット販売・通信販売
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	90,303	10,742,544	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	195.17	195.17	329	39,156	食品・生活必需品小売り
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,420.94	2,016.06	950	113,032	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	522.32	400.88	560	66,621	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	1,839	218,809	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	5,323.01	4,772.67	5,180	616,300	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	144.26	158.85	247	29,393	電気設備
REPSOL SA	1,267.23	1,149.98	1,454	173,054	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	4,153.79	3,677.55	2,297	273,294	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	293.14	234.17	587	69,920	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	232.16	201.37	629	74,883	建設・土木
BANKINTER S.A.	579.6	579.6	363	43,189	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,956.67	5,235.94	2,745	326,569	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	290.1	236.12	564	67,188	ガス
BANCO SANTANDER SA	14,112.32	12,640.63	4,958	589,913	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	345.96	345.96	658	78,277	電力
BANCO SABADELL	5,633.71	4,136.31	352	41,923	銀行
INDITEX	967.34	838.83	2,636	313,631	専門小売り
MAPFRE SA	844.74	844.74	204	24,308	保険
ENAGAS	180.95	180.95	463	55,170	ガス
GRIFOLS SA	235.18	235.18	776	92,352	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	468.31	386.66	1,154	137,393	建設・土木
CAIXABANK	2,972.24	2,972.24	834	99,249	銀行
AMADEUS IT GROUP SA	384.92	338.91	2,468	293,667	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	447.47	—	—	—	旅客航空輸送業
BANKIA SA	1,006.75	1,006.75	169	20,180	銀行
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION-RTS	231.8	—	—	—	建設・土木
AENA SME SA	61.75	53.38	898	106,903	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	—	197.8	937	111,557	各種電気通信サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	30,584	3,638,321	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	1,040.14	870.3	1,629	193,809	保険
INTESA SANPAOLO	13,499.21	11,576.31	2,902	345,243	銀行
UNICREDIT SPA	1,701.44	1,557.18	2,162	257,227	銀行
ENI SPA	2,222.05	1,978.38	2,550	303,410	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	620.22	416.39	399	47,582	銀行
ENEL SPA	6,744.93	6,323.33	5,233	622,615	電力
LEONARDO SPA	262.69	283.16	324	38,653	航空宇宙・防衛
SNAM SPA	1,997.02	1,691.63	844	100,517	ガス
TELECOM ITALIA SPA	11,584.73	7,626.75	394	46,906	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	4,975.96	254	30,248	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	436.88	373.65	853	101,477	運送インフラ
TERNA SPA	1,126.86	1,136.54	738	87,800	電力
RECORDATI SPA	68.59	68.59	276	32,923	医薬品
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	557.25	397.52	356	42,370	飲料
PRYSMIAN SPA	294.18	214.52	509	60,659	電気設備
MONCLER SPA	143.53	143.53	546	65,053	繊維・アパレル・贅沢品

銘柄	期首(前期末)		当 期		業 種 等
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
FINECOBANK SPA	-	450.48	491	58,519	銀行
POSTE ITALIANE SPA	400.15	400.15	438	52,124	保険
PIRELLI & C SPA	340.86	340.86	154	18,328	自動車部品
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	48,016.69 18銘柄	40,825.23 19銘柄	21,061 -	2,505,470 <0.7%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ	349.35	349.35	390	46,441	機械
NOKIAN RENKAAT OYJ	93.99	93.99	255	30,378	自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	493.71	399.09	1,199	142,712	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	423.03	419.15	512	61,006	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	394.03	361.41	1,492	177,562	保険
FORTUM OYJ	374.52	374.52	830	98,773	電力
NOKIA OYJ	4,959.75	4,308	1,698	202,019	通信機器
ELISA OYJ	141.76	107.87	610	72,579	各種電気通信サービス
METSO OYJ	85.85	85.85	285	33,947	機械
NESTE OYJ	108.4	329.31	1,287	153,212	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	291.24	265.02	1,533	182,476	機械
ORION OYJ	80.51	80.51	315	37,524	医薬品
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,796.14 12銘柄	7,174.07 12銘柄	10,412 -	1,238,634 <0.3%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	128.17	128.17	563	67,041	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	67.78	49.08	238	28,387	電力
VOEST-ALPINE AG	98.75	98.75	225	26,877	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	251.17	209.43	742	88,294	銀行
ANDRITZ AG	62.65	62.65	222	26,502	機械
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	96.41	96.41	217	25,839	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	704.93 6銘柄	644.49 6銘柄	2,210 -	262,942 <0.1%>
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	975,274.54 1,245銘柄	858,545.81 1,254銘柄	-	350,796,430 <94.7%>

(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) < >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		末	
	口 数	口 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9.644	8.646	1,512	166,066	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	13.309	12.027	1,770	194,426	0.1	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	-	17.771	787	86,479	0.0	
SL GREEN	7.097	7.097	674	74,059	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	125.554	108.247	1,127	123,847	0.0	
PROLOGIS INC	55.164	56.079	5,470	600,661	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12.353	10.491	2,387	262,094	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	8.062	8.062	958	105,242	0.0	
EQUINIX INC	6.964	6.522	4,230	464,508	0.1	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13.649	13.649	778	85,483	0.0	
DUKE REALTY TRUST	32.954	27.278	1,049	115,252	0.0	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	35.534	31.583	5,241	575,552	0.2	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5.653	5.075	1,645	180,638	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	32.976	27.869	2,409	264,569	0.1	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6	6	763	83,819	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
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	39.277	40.162	1,498	164,529		0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	10.277	8.778	2,586	283,952		0.1
WELLTOWER INC	33.309	32.099	2,867	314,805		0.1
KIMCO REALTY	32.98	32.98	635	69,744		0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	11.649	—	—	—		—
IRON MOUNTAIN INC	23.977	23.977	794	87,246		0.0
THE MACERICH COMPANY	9.014	—	—	—		—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	13.626	1,025	112,569		0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	64.001	55.116	932	102,334		0.0
MID AMERICA	10.258	8.834	1,285	141,140		0.0
REALTY INCOME CORP	26.616	23.491	1,885	206,989		0.1
REGENCY CENTERS CORP	13.023	11.403	730	80,156		0.0
UDR INC	21.658	22.345	1,124	123,459		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	26.5	23.306	3,237	355,496		0.1
PUBLIC STORAGE	13.721	12.188	2,837	311,569		0.1
SUN COMMUNITIES INC	—	7.418	1,246	136,827		0.0
VENTAS INC	30.244	29.505	1,762	193,569		0.1
VORNADO REALTY TRUST	15.346	12.472	846	92,970		0.0
WEYERHAEUSER CO	63.699	57.621	1,766	193,979		0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	11.885	9.261	1,068	117,375		0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	18.388	15.605	2,052	225,315		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	—	39.953	962	105,635		0.0
AGNC INVESTMENT CORP	44.741	44.741	865	95,008		0.0
VEREIT INC	93.429	82.604	828	90,971		0.0
AMERICAN TOWER CORP	38.497	34.213	8,767	962,625		0.3
WP CAREY INC	15.148	13.039	1,119	122,881		0.0
INVITATION HOMES INC	30.427	42.384	1,379	151,479		0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19.124	—	—	—		—
VICI PROPERTIES INC	—	34.2	961	105,557		0.0
小計	1,082.101	1,077.717	75,873	8,330.894		—
	39銘柄<2.1%>	41銘柄<2.2%>	—	—		2.2
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	9.288	3.067	96	7,989		0.0
CANADIAN APT PPTYS REIT	—	7.819	459	38,082		0.0
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10.748	10.748	230	19,129		0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	—	17.676	385	31,972		0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9.675	13.467	372	30,876		0.0
小計	29.711	52.777	1,545	128,051		—
	3銘柄<0.0%>	5銘柄<0.0%>	—	—		0.0
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		%
MIRVAC GROUP	295.783	329.418	1,083	79,907		0.0
GPT GROUP	144.955	158.232	987	72,798		0.0
LENDLEASE GROUP	60.871	—	—	—		—
STOCKLAND	194.018	194.018	975	71,953		0.0
DEXUS	80.596	84.575	1,114	82,186		0.0
GOODMAN GROUP	147.572	132.051	2,170	160,061		0.0
VICINITY CENTRES	270.443	270.443	673	49,650		0.0
SCENTRE GROUP	476.956	420.268	1,584	116,818		0.0
小計	1,671.194	1,589.005	8,590	633,377		—
	8銘柄<0.2%>	7銘柄<0.2%>	—	—		0.2
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円		%
LINK REIT	185.5	157.9	12,426	175,589		0.0
小計	185.5	157.9	12,426	175,589		—
	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	—	—		0.0
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		%
CAPITALAND MALL TRUST	199	199	501	39,576		0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	200.806	200.806	662	52,297		0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206.3	206.3	429	33,864		0.0
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	192.1	345	27,288		0.0

銘	柄	期				末
		首(前期末)	当	期	末	
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST		—	192.3	449	35,512	0.0
小計	□ 数 銘 柄 数<比 率>	798,206 4銘柄<0.0%>	990,506 5銘柄<0.1%>	2,389	188,540	—
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC		71.871	69.819	410	58,768	0.0
HAMMERSON PLC		58.616	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		59.062	55.843	556	79,631	0.0
SEGRO PLC		82.914	87.247	815	116,816	0.0
小計	□ 数 銘 柄 数<比 率>	272,463 4銘柄<0.1%>	212,909 3銘柄<0.1%>	1,782	255,216	—
(オランダ)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		12.061	10.898	1,383	164,581	0.0
小計	□ 数 銘 柄 数<比 率>	12,061 1銘柄<0.1%>	10,898 1銘柄<0.0%>	1,383	164,581	—
(フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		3.67	3.67	666	79,239	0.0
ICADE		2.234	2.234	234	27,877	0.0
KLEPIERRE		17.042	17.042	532	63,313	0.0
COVIVIO		4.675	4.265	472	56,266	0.0
小計	□ 数 銘 柄 数<比 率>	27,621 4銘柄<0.1%>	27,211 4銘柄<0.1%>	1,905	226,697	—
合計	□ 数 銘 柄 数<比 率>	4,078,857 64銘柄<2.6%>	4,118,923 67銘柄<2.7%>	—	10,102,948	—
						2.7

(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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当		末
			買	建 額	
外国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T			百万円 7,276	百万円 —
	S & P / T S E 6 0 I X F U T			370	—
	S P I 2 0 0 F U T U R E S			221	—
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E			569	—
	D J E U R O S T O X X 5 0			1,679	—

(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

2020年2月17日現在

項	目	当		末
		評 価 額	比 率	
株	式	千円	%	
		350,796,430	94.6	
	投資信託受益証券、投資証券	10,102,948	2.7	
	コール・ローン等、その他	9,740,489	2.6	
	投資信託財産総額	370,639,867	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、370,367,645千円、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、2020年2月17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.80円、1カナダ・ドル=82.86円、1オーストラリア・ドル=73.73円、1香港・ドル=14.13円、1シンガポール・ドル=78.92円、1ニュージーランド・ドル=70.61円、1イギリス・ポンド=143.20円、1イスラエル・シェケル=32.00円、1スイス・フラン=111.81円、1デンマーク・クローネ=15.92円、1ノルウェー・クローネ=11.87円、1スウェーデン・クローナ=11.31円、1ユーロ=118.96円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月17日)現在

項	目	当 期 末
(A)	資 産	371,336,825,866円
	株 券 等	6,549,317,097
	一 般 債 券 (評 価 額)	350,796,430,193
	信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	821,917,447
	資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	9,281,030,671
	未 収 入 金	981,917,778
	未 差 入 委 託 証 拠	425,800,789
(B)	負 債	2,480,411,891
	未 払 金	916,378,668
	未 払 金	704,679,668
(C)	純 資 産 総 額 (A - B)	370,420,447,198
(D)	元 本 金 数	88,590,932,378
	受 取 益 権 総 額 (C / D)	281,829,514,820
	1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	88,590,932,378円
		41,812円

(注1)	期首元本額	101,602,311,525円	リスク抑制世界8資産バランスファンド	668,936,157円
	追加設定元本額	23,968,777,744円	ワールドアセットバランス (基本コース)	439,823,625円
	一部解約元本額	36,980,156,891円	ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,662,660,975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-2045)	1,709,520円
	D I A M 外国株式パッシブ・ファンド	3,405,331,645円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	1,370,366円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,265,172円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)	565,992円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6,568,890円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	1,592,751円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	9,804,082円	4資産分散投資・スタンダード<D C年金>	11,750,393円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	31,959,861円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	563,321,995円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	25,017,559円	9資産分散投資・スタンダード<D C年金>	144,219,671円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	13,341,477円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	261,455円
	たわらノーロード 先進国株式	12,358,698,257円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	222,668円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	181,844,047円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	257,387円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,666,506,602円	4資産分散投資・マイルクラス<D C年金>	65,132円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	215,144,281円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	25,533,156円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	21,417,034円	M S C I コクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	259,123,350円
	たわらノーロード バランス (標準型)	170,820,437円	D I A M 外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	85,286,421円
	たわらノーロード バランス (積極型)	210,567,034円	D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	2,001,550,769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)	679,207円	D I A M 先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	9,249,815,085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)	87,148,596円	外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	205,960,997円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (安成成長型)	220,238,898円	D I A M ワールドバランス25V A (適格機関投資家限定)	14,470,386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)	147,447,694円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	17,813,512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)	270,535,285円	D I A M グローバル・バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	59,958,854円
	たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	64,582円	D I A M グローバル・バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	135,238,394円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,015,608円	D I A M 国際分散バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	8,631,553円
	たわらノーロード 最適化バランス (安成成長型)	2,220,065円	D I A M 国際分散バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	48,605,100円
	たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,516,202円	D I A M 国内重視バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	4,643,533円
	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	4,637,207円	D I A M 国内重視バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	4,877,279円
	たわらノーロード 全世界株式	43,988,328円	D I A M 世界バランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	17,536,269円
	D I A M 外国株式インデックスファンド<D C年金>	42,514,197,886円	D I A M 世界バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	54,685,027円
	One D C 先進国株式インデックスファンド	189,412,832円	D I A M バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	375,124,662円
	D I A M バランス・ファンド<D C年金> 1 安定型	176,623,075円	D I A M バランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定)	492,768,252円
	D I A M バランス・ファンド<D C年金> 2 安定・成長型	878,800,098円	D I A M バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	1,604,220,114円
	D I A M バランス・ファンド<D C年金> 3 成長型	1,066,933,587円	D I A M グローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	579,217,915円
	D I A M D C バランス30インデックスファンド	117,048,457円	D I A M グローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	95,885,349円
	D I A M D C バランス50インデックスファンド	341,782,574円	D I A M アフタ グローバル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	618,117,607円
	D I A M D C バランス70インデックスファンド	300,493,482円	D I A M 世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	27,550,457円
	マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	27,606,178円	D I A M 世界バランスファンド55V A (適格機関投資家限定)	6,905,718円
	マネックス資産設計ファンド (育成型)	792,953,460円	D I A M 世界バランスファンド35V A (適格機関投資家限定)	9,443,862円
	マネックス資産設計ファンド エポクリューション	186,919,230円	D I A M 世界アセットバランスファンド2V A (適格機関投資家限定)	214,153,029円
	D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	206,435,395円	D I A M 世界アセットバランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	24,495,642円
	D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	158,994,799円	D I A M 世界アセットバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	88,530,403円
	D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	277,906,766円	D I A M 世界アセットバランスファンド3V A (適格機関投資家限定)	152,767,521円
	投資のソムリエ	1,161,944,551円	D I A M 世界アセットバランスファンド4V A (適格機関投資家限定)	444,738,720円
	クルーズコントロール	194,095,583円	D I A M バランス20V A (適格機関投資家限定)	22,591,432円
	投資のソムリエ<D C年金>	110,373,729円	D I A M バランス40V A (適格機関投資家限定)	206,560円
	D I A M 8資産バランスファンドN<D C年金>	175,641,805円	D I A M バランス60V A (適格機関投資家限定)	242,312円
	4資産分散投資・ハイクラス<D C年金>	100,302,518円	期末元本合計	88,590,932,378円
	クルーズコントロール<D C年金>	196,533円		
	D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	553,382円		
	D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	2,320,962円		
	投資のソムリエ<D C年金>リスク抑制型	63,170,120円		

■損益の状況

当期 自2019年2月16日 至2020年2月17日

項	目	当	期
(A)	配当受取金の利益	7,745,119,922円	
	受取利息	7,694,676,622	
	受取利息	12,104,811	
	支払利息	38,840,064	
		△501,575	
(B)	有価証券売買損益	59,213,874,771	
	買収益	74,270,892,711	
	売却損	△15,057,017,940	
(C)	先物取引等取引損益	1,575,644,220	
	取引益	1,915,607,176	
	取引損	△339,962,956	
(D)	その他費用	△122,413,484	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	68,412,225,429	
(F)	前期繰越損益金	248,087,509,699	
(G)	解約差損益金	△99,035,323,364	
(H)	追加信託差損益金	64,365,103,056	
(I)	合計(E+F+G+H)	281,829,514,820	
	前期繰越損益金(I)	281,829,514,820	

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2020年2月21日）

（計算期間 2019年2月22日～2020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。 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。 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） （ベンチマーク）	騰落率			
13期（2016年2月22日）	17,881	△5.0	ポイント 111,769.89	% △5.0	% 97.6	% -	百万円 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
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803

（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）。

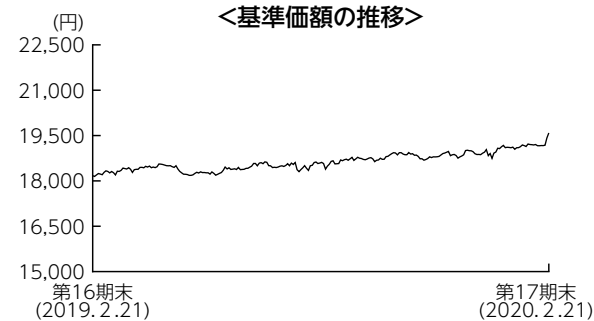
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019 年 2 月 21 日	円 18,170	% -	ポイント 113,733.36	% -	% 98.1	% -
2 月 末	18,204	0.2	113,937.65	0.2	98.1	-
3 月 末	18,446	1.5	115,474.58	1.5	97.9	-
4 月 末	18,395	1.2	115,213.50	1.3	97.4	-
5 月 末	18,249	0.4	114,188.44	0.4	98.1	-
6 月 末	18,486	1.7	115,685.41	1.7	97.5	-
7 月 末	18,542	2.0	115,950.32	1.9	97.6	-
8 月 末	18,666	2.7	116,876.64	2.8	97.5	-
9 月 末	18,755	3.2	117,408.61	3.2	97.5	-
10 月 末	18,937	4.2	118,313.83	4.0	97.6	-
11 月 末	18,947	4.3	118,546.99	4.2	97.4	-
12 月 末	19,033	4.7	118,980.17	4.6	96.6	-
2020 年 1 月 末	19,188	5.6	120,069.31	5.6	96.8	-
(期 末) 2020 年 2 月 21 日	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-

(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（2019年2月22日から2020年2月21日まで）

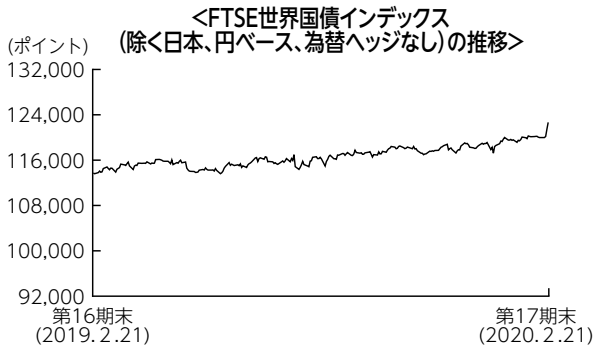


基準価額の推移

当ファンドの基準価額は19,586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

米国債、ドイツ債の利回りは、ともに低下（価格は上昇）しました。米中貿易摩擦やブレグジット（英国のEU離脱）等の不透明感があり、FRB（米連邦準備理事会）が政策金利を引き下げ、ECB（欧州中央銀行）も追加的に金融緩和したことから、利回りは低下しました。その後、米中貿易協議やブレグジット交渉の進展見込みから利回りは上昇（価格は下落）に転じる場面もありましたが、新型コロナウイルス感染症の流行による世界的な景気減速懸念もあり、利回りは低下しました。これらを主因に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、ドイツ債の利回りは、ともに低下しました。米中貿易摩擦やブレグジット等の不透明感があり、FRBが政策金利を引き下げ、ECBも追加的に金融緩和したことから、利回りは低下しました。その後、米中貿易協議やブレグジット交渉の進展見込みから利回りは上昇に転じる場面もありましたが、新型コロナウイルス感染症の流行による世界的な景気減速懸念もあり、利回りは低下しました。

為替市場ではドル/円は円安ドル高に、ユーロ/円は円高ユーロ安となりました。ドル/円は、米中貿易摩擦の激化やFRBによる政策金利の引き下げから、円高ドル安が進む展開となりました。しかし米中貿易摩擦が一時緩和し、堅調な労働市場や底堅い個人消費などを背景として緩やかに景気拡大していることから、前期末比では円安ドル高となりました。ユーロ/円は、景気減速懸念からECBが追加的な金融緩和策を実施し円高ユーロ安となりました。

ポートフォリオについて

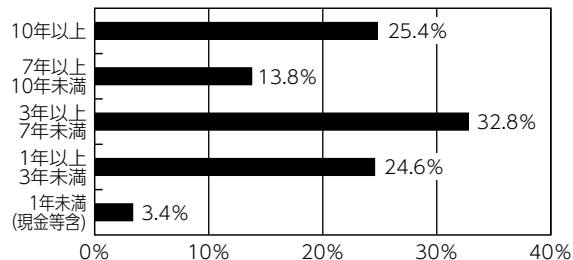
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

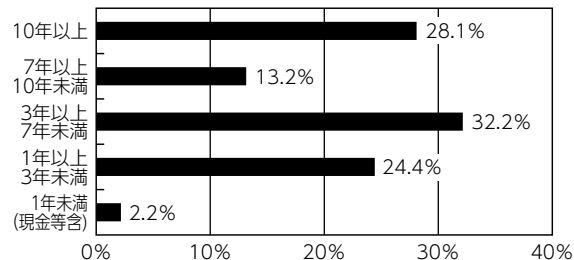
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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	45.6%	45.9%	△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%	-

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	48.3%	48.8%	△0.5%
カナダ	1.8%	1.9%	△0.1%
計	50.1%	50.7%	△0.6%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.9%	△0.1%
計	0.7%	0.9%	△0.1%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	0.0%
ベルギー	2.3%	2.4%	△0.1%
フィンランド	0.5%	0.6%	△0.1%
フランス	9.5%	9.8%	△0.3%
ドイツ	5.7%	6.2%	△0.5%
アイルランド	0.7%	0.7%	0.0%
イタリア	8.9%	8.8%	0.1%
オランダ	1.8%	1.8%	0.0%
スペイン	5.3%	5.5%	△0.2%
ユーロ計	36.1%	37.2%	△1.1%
デンマーク	0.4%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.3%	△0.1%
英国	6.2%	6.4%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.6%	△0.1%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.1%
計	43.7%	45.4%	△1.8%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.8%	1.9%	0.0%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.5%	0.1%
計	2.8%	2.8%	0.0%
アフリカ			
南アフリカ	0.5%	0.5%	0.0%
計	0.5%	0.5%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

(注) 世界国債インデックスとはF T S E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7.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.06%と、ベンチマークにはほぼ連動したパフォーマンスとなりました。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こと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	0.012%
（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(18,642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（2019年2月22日から2020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 107,300	千アメリカ・ドル 405,150
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 188	千カナダ・ドル 19,520
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 3,427	千オーストラリア・ドル 25,741
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル -	千シンガポール・ドル 2,415
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 2,451	千イギリス・ポンド 44,126
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ -	千デンマーク・クローネ 25,089
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ -	千ノルウェー・クローネ 10,045
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 14,936	千スウェーデン・クローナ 47,435
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 8,060	千メキシコ・ペソ 117,770
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット -	千マレーシア・リンギット 2,205
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド -	千南アフリカ・ランド 42,074
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 1,276	千ポーランド・ズロチ 15,660
国	ユーロ圏	アイルランド	千ユーロ 833	千ユーロ 6,664
		オランダ	1,643	14,408
		ベルギー	1,491	17,459
		フランス	13,545	74,730
		ドイツ	5,785	51,063
		スペイン	3,915	41,082
		イタリア	9,222	62,374
		フィンランド	380	5,630
オーストリア	1,021	10,482		

(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（2019年2月22日から2020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 B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 526,820	千アメリカ・ドル 563,002	千円 63,118,202	% 48.3	% -	% 21.3	% 16.2	% 10.7
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 24,880	千カナダ・ドル 28,099	千円 2,377,248	1.8	-	0.9	0.5	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 27,560	千オーストラリア・ドル 32,336	千円 2,399,708	1.8	-	1.4	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 5,480	千シンガポール・ドル 5,986	千円 479,318	0.4	-	0.2	0.1	-
イギリス	千イギリス・ポンド 41,680	千イギリス・ポンド 56,394	千円 8,145,652	6.2	-	5.1	1.1	-
デンマーク	千デンマーク・クローネ 26,340	千デンマーク・クローネ 35,998	千円 582,823	0.4	-	0.4	0.1	-
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 19,810	千ノルウェー・クローネ 20,550	千円 247,224	0.2	-	0.1	0.1	-
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 19,610	千スウェーデン・クローナ 23,326	千円 266,391	0.2	-	0.2	-	-
メキシコ	千メキシコ・ペソ 145,488	千メキシコ・ペソ 161,587	千円 961,447	0.7	-	0.5	0.2	-
マレーシア	千マレーシア・リンギット 27,550	千マレーシア・リンギット 29,527	千円 789,861	0.6	-	0.4	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 103,700	千南アフリカ・ランド 95,743	千円 710,419	0.5	-	0.5	0.0	-
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 22,900	千ポーランド・ズロチ 24,360	千円 688,666	0.5	-	0.2	0.3	-
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	6,250	7,364	890,608	0.7	-	0.5	0.1	-
オランダ	16,070	19,688	2,380,903	1.8	-	1.2	0.4	0.2
ベルギー	19,580	25,047	3,029,029	2.3	-	1.7	0.5	0.1
フランス	83,180	102,810	12,432,844	9.5	-	6.5	2.5	0.5
ドイツ	50,000	61,740	7,466,249	5.7	-	3.4	1.9	0.4
スペイン	45,890	57,054	6,899,589	5.3	-	3.8	1.2	0.3
イタリア	81,140	96,539	11,674,496	8.9	-	5.3	2.4	1.2
フィンランド	4,710	5,396	652,595	0.5	-	0.4	0.1	-
オーストリア	11,670	14,712	1,779,149	1.4	-	0.9	0.3	0.1
合 計	-	-	千円 127,972,430	97.8	-	55.0	28.6	14.2

(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) 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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,180	2,329	261,202	2026/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	350	361	40,575	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	4,980	5,034	564,457	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	3,890	4,059	455,085	2024/01/31
US T N/B 2.5 01/15/22	国債証券	2.5000	3,850	3,928	440,373	2022/01/15
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	3,280	3,280	367,806	2025/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	840	1,062	119,172	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,380	1,682	188,591	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,440	1,754	196,702	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,970	2,175	243,891	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	900	1,149	128,819	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	490	644	72,276	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,000	1,386	155,491	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	730	1,017	114,058	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,200	1,804	202,260	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	2,790	3,680	412,658	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,070	3,768	422,451	2049/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	8,470	8,570	960,884	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	550	774	86,816	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	750	1,103	123,758	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	4,180	4,228	474,074	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,840	3,129	350,903	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	2,540	3,086	346,071	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	3,110	3,794	425,422	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	5,320	5,605	628,389	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	5,300	5,458	611,915	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	5,130	5,610	628,952	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,370	4,789	536,960	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	4,370	4,451	499,068	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	4,670	4,916	551,244	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,300	1,338	150,035	2024/02/29
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,550	2,708	303,681	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	3,510	3,743	419,668	2025/02/28
US T N/B 1.875 02/28/22	国債証券	1.8750	1,680	1,696	190,139	2022/02/28
US T N/B 2.5 02/15/22	国債証券	2.5000	1,070	1,092	122,530	2022/02/15
US T N/B 1.125 02/28/21	国債証券	1.1250	3,680	3,667	411,114	2021/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	4,080	4,202	471,166	2024/03/31
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	6,990	7,042	789,587	2022/03/31
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2.2500	9,760	9,842	1,103,425	2021/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,150	2,281	255,762	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,090	3,239	363,172	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	1,020	1,055	118,309	2023/03/31
US T N/B 2.25 04/30/21	国債証券	2.2500	8,170	8,244	924,346	2021/04/30
US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	1.3750	11,210	11,197	1,255,329	2021/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,760	1,858	208,397	2026/04/30

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	2,490	2,597	291,170	2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,417	383,142	2024/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	710	1,027	115,233	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,300	1,859	208,492	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,040	1,496	167,722	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	980	1,171	131,360	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	810	1,134	127,196	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,720	3,188	357,493	2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	2,420	3,078	345,131	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	2,500	3,007	337,162	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	2,350	2,857	320,369	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	2,790	3,083	345,702	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,660	3,323	372,556	2048/05/15
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	5,400	5,444	610,360	2022/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,700	4,443	498,157	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	700	1,000	112,209	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	5,990	6,063	679,723	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	6,240	6,529	731,975	2024/05/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.1250	8,000	8,160	914,922	2021/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	5,150	5,341	598,792	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,430	4,906	550,075	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	4,840	5,196	582,630	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	3,100	3,295	369,452	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	500	745	83,578	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	4,290	4,339	486,512	2026/05/15
US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	2.0000	10,130	10,197	1,143,260	2021/05/31
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	2,900	2,924	327,887	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	4,770	4,893	548,635	2024/05/31
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,050	2,135	239,395	2026/05/31
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,414	382,781	2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	2,530	2,720	305,021	2025/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	3,460	3,462	388,233	2023/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	6,530	6,642	744,718	2022/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	790	845	94,773	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	720	739	82,894	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	1,820	1,895	212,472	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,361	152,621	2024/06/30
US T N/B 1.75 06/15/22	国債証券	1.7500	830	837	93,847	2022/06/15
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	3,390	3,652	409,506	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,370	2,434	272,903	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	3,690	3,749	420,408	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,422	383,640	2023/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,165	130,695	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	410	544	61,058	2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	650	858	96,253	2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,110	1,493	167,452	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,800	2,068	231,925	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,830	3,465	388,483	2044/08/15

銘柄	当	期	未	額						
				種	利	率	評		額	償還年月日
							額	面		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円					
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,141	127,937			2039/08/15		
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,670	2,198	246,491			2043/08/15		
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	2,090	2,464	276,266			2045/08/15		
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	5,180	5,344	599,195			2025/08/15		
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	770	896	100,453			2047/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	2,400	2,548	285,754			2049/08/15		
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.1250	11,000	11,108	1,245,397			2021/08/15		
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,498	504,322			2023/08/15		
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	6,110	6,376	714,906			2024/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,720	2,867	321,496			2046/08/15		
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,210	3,927	440,366			2048/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,690	2,840	318,421			2027/08/15		
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	4,290	4,306	482,793			2026/08/15		
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	4,680	5,194	582,348			2028/08/15		
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	3,980	4,005	449,038			2022/08/15		
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,757	197,046			2025/08/31		
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	4,380	4,419	495,453			2029/08/15		
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	3,680	3,726	417,721			2022/08/31		
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	3,120	3,188	357,434			2024/08/31		
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,273	254,834			2023/08/31		
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	1,210	1,213	136,050			2022/08/15		
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	1,095	122,848			2026/08/31		
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,440	2,427	272,116			2024/08/31		
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,410	1,531	171,659			2025/09/30		
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	8,840	8,935	1,001,814			2021/09/30		
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,930	3,028	339,491			2024/09/30		
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	3,100	3,101	347,676			2023/09/30		
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,250	5,300	594,279			2022/09/30		
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	840	884	99,167			2023/09/30		
US T N/B 1.5 09/15/22	国債証券	1.5000	750	752	84,348			2022/09/15		
US T N/B 1.5 09/30/21	国債証券	1.5000	5,120	5,125	574,608			2021/09/30		
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,920	2,086	233,967			2025/10/31		
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	3,690	3,889	436,050			2023/10/31		
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,350	2,376	266,484			2026/10/31		
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	6,000	6,673	748,202			2021/11/15		
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	1,111	124,626			2028/11/15		
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	900	1,209	135,598			2027/11/15		
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	2,290	2,749	308,278			2044/11/15		
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,110	1,567	175,716			2040/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	2,110	2,423	271,683			2042/11/15		
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	760	925	103,748			2041/11/15		
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	2,620	3,515	394,077			2043/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,640	3,074	344,689			2047/11/15		
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	1,630	1,965	220,386			2045/11/15		
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	2,220	2,633	295,258			2046/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	4,690	4,878	546,909			2024/11/15		
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	410	584	65,525			2039/11/15		
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,330	4,359	488,736			2048/11/15		

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 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	3,022	338,809	2049/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	10,400	10,504	1,177,648	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,190	5,430	608,761	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,840	5,481	614,550	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	5,620	5,657	634,316	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	6,020	6,323	708,963	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	4,140	4,286	480,525	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	6,590	6,702	751,387	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	4,040	4,270	478,755	2027/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	3,480	3,762	421,780	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	5,640	5,951	667,274	2023/11/30
US T N/B 2.875 11/15/21	国債証券	2.8750	4,880	5,000	560,624	2021/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,400	2,448	274,445	2029/11/15
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	4,830	4,991	559,597	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,203	359,190	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,446	274,261	2025/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	9,160	9,279	1,040,325	2021/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	5,520	5,636	631,949	2022/12/31
US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	2.6250	3,770	3,851	431,751	2021/12/15
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	740	754	84,588	2026/12/31
小計	—	—	526,820	563,002	63,118,202	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	548	46,416	2024/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	1,160	1,171	99,128	2023/03/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	800	808	68,387	2026/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	230	335	28,371	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,100	1,519	128,577	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	720	1,101	93,205	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	870	1,347	114,029	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,600	1,676	141,799	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	880	1,293	109,452	2041/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	4,700	4,801	406,168	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	2,240	2,305	195,010	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,214	102,704	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	1,020	1,073	90,824	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,500	1,570	132,873	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	800	781	66,143	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	659	55,814	2029/06/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	600	593	50,204	2021/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	740	755	63,915	2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	800	791	66,974	2022/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	1,020	1,473	124,634	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	980	1,285	108,783	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	420	483	40,925	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	507	42,903	2064/12/01
小計	—	—	24,880	28,099	2,377,248	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	870	1,138	84,513	2047/03/21

銘柄	種類	当	利率	額面金額	期		末	
					評価額			償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)								
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	2025/04/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券		3.2500	1,520	1,711	127,029	2025/04/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券		4.7500	1,670	2,120	157,348	2027/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券		2.7500	1,980	2,145	159,213	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券		4.2500	2,010	2,425	179,994	2026/04/21	
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券		5.5000	1,710	1,966	145,970	2023/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券		3.2500	2,820	3,381	250,929	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券		4.5000	1,130	1,602	118,923	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券		3.7500	850	1,170	86,859	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券		2.2500	1,740	1,925	142,877	2028/05/21	
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券		2.5000	1,200	1,374	102,011	2030/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券		3.2500	720	946	70,214	2039/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券		2.7500	530	644	47,800	2035/06/21	
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券		5.7500	1,180	1,321	98,048	2022/07/15	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券		2.7500	2,080	2,392	177,546	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券		2.7500	1,330	1,511	112,141	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券		2.7500	1,560	1,819	134,996	2029/11/21	
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券		2.2500	890	927	68,866	2022/11/21	
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券		2.0000	1,770	1,811	134,421	2021/12/21	
小計	—	—	—	27,560	32,336	2,399,708	—	
(シンガポール)								
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券		3.5000	730	823	65,903	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券		2.7500	420	483	38,690	2046/03/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券		2.7500	380	437	35,066	2042/04/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券		2.3750	340	354	28,402	2025/06/01	
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券		2.1250	210	217	17,396	2026/06/01	
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券		2.8750	200	221	17,712	2029/07/01	
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券		2.2500	200	213	17,062	2036/08/01	
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券		3.0000	550	586	46,927	2024/09/01	
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券		3.1250	1,600	1,664	133,300	2022/09/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券		2.8750	370	412	33,018	2030/09/01	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券		3.3750	480	572	45,836	2033/09/01	
小計	—	—	—	5,480	5,986	479,318	—	
(イギリス)								
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券		3.2500	1,540	2,254	325,670	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券		3.5000	1,280	1,965	283,925	2045/01/22	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券		4.0000	990	1,995	288,250	2060/01/22	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券		1.7500	580	680	98,318	2049/01/22	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券		5.0000	1,610	1,974	285,167	2025/03/07	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券		4.0000	1,040	1,114	160,977	2022/03/07	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券		4.2500	1,130	1,700	245,625	2036/03/07	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券		1.0000	820	838	121,090	2024/04/22	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券		4.2500	1,110	1,573	227,233	2032/06/07	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券		1.5000	1,450	1,604	231,722	2047/07/22	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券		3.7500	1,120	1,968	284,348	2052/07/22	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券		1.7500	1,020	1,273	183,998	2057/07/22	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券		2.5000	1,130	1,785	257,902	2065/07/22	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券		3.5000	890	1,780	257,218	2068/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券		1.5000	900	960	138,739	2026/07/22	

銘柄	種類	当	利率	額面金額	期		末	
					評価額			償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券		1.2500	960	1,014	146,584	2027/07/22	
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券		0.5000	1,920	1,922	277,671	2022/07/22	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券		0.7500	1,560	1,575	227,575	2023/07/22	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券		4.2500	920	1,458	210,728	2039/09/07	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券		2.2500	1,180	1,254	181,220	2023/09/07	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券		2.7500	1,380	1,522	219,923	2024/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券		2.0000	790	858	124,071	2025/09/07	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券		4.5000	900	1,356	195,903	2034/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券		1.7500	1,540	1,739	251,221	2037/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券		1.7500	1,530	1,580	228,255	2022/09/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券		1.6250	510	603	87,188	2054/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券		1.6250	580	754	108,964	2071/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券		1.6250	1,830	2,002	289,220	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券		0.8750	430	441	63,841	2029/10/22	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券		6.0000	760	1,118	161,619	2028/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券		4.7500	990	1,642	237,229	2038/12/07	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券		4.5000	1,080	1,842	266,174	2042/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券		4.2500	1,170	2,042	295,031	2046/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券		4.2500	1,000	1,987	287,074	2055/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券		4.2500	970	1,250	180,594	2027/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券		4.2500	960	1,545	223,177	2040/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券		4.7500	1,120	1,605	231,852	2030/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券		4.2500	990	1,802	260,337	2049/12/07	
小計	—	—	—	41,680	56,394	8,145,652	—	
(デンマーク)			%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券		4.5000	8,390	16,295	263,824	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券		1.7500	5,320	6,049	97,935	2025/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券		1.5000	5,500	5,948	96,302	2023/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券		0.5000	7,130	7,706	124,761	2027/11/15	
小計	—	—	—	26,340	35,998	582,823	—	
(ノルウェー)			%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券		1.5000	3,770	3,809	45,824	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券		1.7500	3,970	4,079	49,074	2027/02/17	
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券		3.0000	6,200	6,611	79,537	2024/03/14	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券		1.7500	3,800	3,880	46,678	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券		2.0000	2,070	2,170	26,109	2028/04/26	
小計	—	—	—	19,810	20,550	247,224	—	
(スウェーデン)			%	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	3,270	5,206	59,461	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券		0.7500	3,740	4,035	46,082	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券		2.5000	6,180	7,111	81,214	2025/05/12	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券		1.0000	4,250	4,623	52,795	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券		0.7500	2,170	2,349	26,836	2029/11/12	
小計	—	—	—	19,610	23,326	266,391	—	
(メキシコ)			%	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	14,326	85,245	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券		8.5000	15,109	17,164	102,129	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券		7.7500	10,000	10,921	64,981	2031/05/29	

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	
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	19,118	113,752	2027/06/03
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	14,643	16,258	96,736	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	5,000	5,744	34,181	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	11,125	13,202	78,554	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	8,085	10,775	64,116	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	7,732	46,010	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	27,596	31,618	188,129	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,724	87,610	2023/12/07
小 計	—	—	145,488	161,587	961,447	—
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	850	22,746	2027/03/15
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,247	33,363	2023/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,323	88,891	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	2,016	53,928	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,850	2,025	54,192	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,297	34,697	2033/04/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	2,570	2,669	71,418	2027/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,111	56,472	2028/06/15
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.1600	4,000	4,073	108,964	2021/07/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,569	68,728	2024/07/15
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	3,050	81,596	2022/08/15
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,600	1,871	50,056	2028/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,422	64,803	2043/09/30
小 計	—	—	27,550	29,527	789,861	—
(南アフリカ)		%	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	10,900	10,307	76,481	2030/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	10,000	8,856	65,712	2044/01/31
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9.0000	4,860	4,442	32,966	2040/01/31
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	8,820	7,850	58,250	2037/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	16,040	14,065	104,363	2048/02/28
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	3,570	2,491	18,490	2041/02/28
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7.7500	3,600	3,719	27,600	2023/02/28
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	7,030	6,033	44,771	2031/02/28
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8.8750	8,410	7,892	58,560	2035/02/28
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	6,590	6,119	45,404	2032/03/31
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	7,460	5,363	39,800	2036/03/31
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	16,420	18,601	138,019	2026/12/21
小 計	—	—	103,700	95,743	710,419	—
(ポーランド)		%	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	1,384	39,139	2023/01/25
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,896	53,615	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	1,900	1,990	56,265	2028/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	4,000	4,060	114,798	2022/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,361	66,765	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,440	2,513	71,059	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,547	72,005	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,280	2,348	66,396	2027/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	1,720	1,900	53,732	2022/09/23

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	
(ポーランド)			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 4.0 10/25/23		国債証券	4.0000	3,100	3,356	94,888	2023/10/25
小計		—	—	22,900	24,360	688,666	—
(ユーロ…アイルランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45		国債証券	2.0000	540	735	88,985	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31		国債証券	1.3500	210	242	29,371	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24		国債証券	3.4000	510	591	71,487	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25		国債証券	5.4000	800	1,037	125,413	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23		国債証券	3.9000	240	272	32,992	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22		国債証券	0.8000	370	380	45,966	2022/03/15
IRISH 1.5 05/15/50		国債証券	1.5000	270	336	40,687	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33		国債証券	1.3000	260	302	36,586	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30		国債証券	2.4000	690	868	105,056	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28		国債証券	0.9000	580	634	76,699	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29		国債証券	1.1000	340	380	45,955	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26		国債証券	1.0000	680	736	89,057	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37		国債証券	1.7000	320	397	48,104	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35		国債証券	0.4000	220	225	27,266	2035/05/15
IRISH 10/18/22		国債証券	0.0000	220	223	26,976	2022/10/18
小計		—	—	6,250	7,364	890,608	—
(ユーロ…オランダ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42		国債証券	3.7500	960	1,755	212,343	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47		国債証券	2.7500	900	1,553	187,844	2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23		国債証券	3.7500	300	338	40,988	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28		国債証券	5.5000	850	1,255	151,883	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37		国債証券	4.0000	950	1,613	195,141	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33		国債証券	2.5000	910	1,234	149,258	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40		国債証券	0.5000	340	374	45,257	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/22		国債証券	0.0000	460	465	56,288	2022/01/15
NETHERLANDS 01/15/24		国債証券	0.0000	1,230	1,259	152,362	2024/01/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21		国債証券	3.2500	1,860	1,960	237,138	2021/07/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23		国債証券	1.7500	1,110	1,201	145,262	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26		国債証券	0.5000	940	1,001	121,097	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22		国債証券	2.2500	880	941	113,864	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24		国債証券	2.0000	820	914	110,641	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25		国債証券	0.2500	1,020	1,065	128,793	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28		国債証券	0.7500	750	825	99,771	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27		国債証券	0.7500	1,000	1,090	131,925	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29		国債証券	0.2500	790	835	101,042	2029/07/15
小計		—	—	16,070	19,688	2,380,903	—
(ユーロ…ベルギー)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/22		国債証券	4.0000	1,080	1,185	143,365	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28		国債証券	5.5000	1,240	1,832	221,578	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41		国債証券	4.2500	1,070	1,921	232,388	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26		国債証券	4.5000	790	1,031	124,724	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32		国債証券	4.0000	530	792	95,865	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35		国債証券	5.0000	1,210	2,100	254,045	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33		国債証券	1.2500	510	594	71,901	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45		国債証券	3.7500	630	1,131	136,882	2045/06/22

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	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	640	821	99,325	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	390	513	62,072	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	320	489	59,163	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	320	495	59,882	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	720	784	94,912	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	1,050	1,194	144,444	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	810	910	110,132	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	160	175	21,199	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	880	959	115,974	2028/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	610	674	81,571	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	470	669	80,915	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	590	763	92,374	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	900	961	116,295	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	650	704	85,255	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	150	181	21,917	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	240	245	29,737	2030/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.2500	1,240	1,336	161,629	2021/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,190	1,341	162,252	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	530	555	67,147	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	660	678	82,072	2023/10/22
小計	-	-	19,580	25,047	3,029,029	-
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,720	2,785	336,795	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	1,270	1,302	157,570	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	1,900	1,936	234,128	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,030	1,332	161,114	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	2,800	3,489	422,036	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,270	4,233	511,908	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	960	1,994	241,217	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	790	1,732	209,548	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	2,540	3,907	472,479	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	2,850	3,076	372,075	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,650	2,823	341,495	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	1,640	2,751	332,771	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,490	2,078	251,312	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	1,560	1,973	238,667	2050/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	650	924	111,751	2066/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	1,980	2,221	268,616	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	2,770	3,543	428,519	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	2,610	2,844	344,009	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	2,290	2,712	328,057	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	2,620	2,762	334,053	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	2,190	2,344	283,550	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	1,740	2,040	246,778	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,070	2,193	265,246	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	1,650	1,817	219,783	2027/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	1,930	2,079	251,529	2023/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	1,990	2,340	283,029	2036/05/25

銘	柄	当				期		末									
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日		
									外	貨						建	金
(ユーロ…フランス)				%		千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
FRANCE OAT 05/25/22		国	債	証	券	0.0000	3,000		3,043		368,002			2022/05/25			
FRANCE OAT 05/25/21		国	債	証	券	0.0000	2,510		2,528		305,825			2021/05/25			
FRANCE OAT 1.75 06/25/39		国	債	証	券	1.7500	1,280		1,643		198,741			2039/06/25			
FRANCE OAT 4.25 10/25/23		国	債	証	券	4.2500	3,500		4,131		499,630			2023/10/25			
FRANCE OAT 6.0 10/25/25		国	債	証	券	6.0000	1,800		2,472		298,974			2025/10/25			
FRANCE OAT 2.75 10/25/27		国	債	証	券	2.7500	2,700		3,357		406,048			2027/10/25			
FRANCE OAT 4.0 10/25/38		国	債	証	券	4.0000	1,770		3,003		363,187			2038/10/25			
FRANCE OAT 3.25 10/25/21		国	債	証	券	3.2500	2,980		3,174		383,851			2021/10/25			
FRANCE OAT 5.75 10/25/32		国	債	証	券	5.7500	2,120		3,699		447,366			2032/10/25			
FRANCE OAT 2.25 10/25/22		国	債	証	券	2.2500	3,030		3,265		394,870			2022/10/25			
FRANCE OAT 1.75 11/25/24		国	債	証	券	1.7500	2,680		2,976		359,967			2024/11/25			
FRANCE OAT 1.0 11/25/25		国	債	証	券	1.0000	1,720		1,867		225,874			2025/11/25			
FRANCE OAT 0.25 11/25/26		国	債	証	券	0.2500	1,380		1,442		174,397			2026/11/25			
FRANCE OAT 0.75 11/25/28		国	債	証	券	0.7500	2,140		2,338		282,736			2028/11/25			
FRANCE OAT 0.0 11/25/29		国	債	証	券	0.0000	610		622		75,322			2029/11/25			
小	計	-	-	-	-	-	83,180		102,810		12,432,844			-			
(ユーロ…ドイツ)				%		千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24		国	債	証	券	6.2500	840		1,067		129,067			2024/01/04			
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28		国	債	証	券	5.6250	1,100		1,646		199,120			2028/01/04			
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30		国	債	証	券	6.2500	710		1,192		144,230			2030/01/04			
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31		国	債	証	券	5.5000	1,240		2,059		249,010			2031/01/04			
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37		国	債	証	券	4.0000	1,500		2,590		313,214			2037/01/04			
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22		国	債	証	券	2.0000	1,650		1,732		209,565			2022/01/04			
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25		国	債	証	券	0.5000	1,360		1,439		174,074			2025/02/15			
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26		国	債	証	券	0.5000	1,260		1,346		162,775			2026/02/15			
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29		国	債	証	券	0.2500	1,670		1,785		215,972			2029/02/15			
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23		国	債	証	券	1.5000	970		1,033		124,989			2023/02/15			
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28		国	債	証	券	0.5000	1,430		1,552		187,720			2028/02/15			
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24		国	債	証	券	1.7500	1,500		1,646		199,107			2024/02/15			
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27		国	債	証	券	0.2500	1,800		1,907		230,666			2027/02/15			
BUNDESOWL 04/08/22		国	債	証	券	0.0000	1,340		1,358		164,301			2022/04/08			
BUNDESOWL 04/14/23		国	債	証	券	0.0000	1,130		1,153		139,552			2023/04/14			
BUNDESOWL 04/05/24		国	債	証	券	0.0000	630		647		78,283			2024/04/05			
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24		国	債	証	券	1.5000	1,010		1,103		133,488			2024/05/15			
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23		国	債	証	券	1.5000	850		910		110,091			2023/05/15			
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27		国	債	証	券	6.5000	710		1,085		131,313			2027/07/04			
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28		国	債	証	券	4.7500	600		871		105,369			2028/07/04			
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39		国	債	証	券	4.2500	840		1,570		189,868			2039/07/04			
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42		国	債	証	券	3.2500	900		1,579		191,063			2042/07/04			
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44		国	債	証	券	2.5000	1,660		2,696		326,082			2044/07/04			
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40		国	債	証	券	4.7500	920		1,852		224,006			2040/07/04			
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21		国	債	証	券	3.2500	1,150		1,211		146,466			2021/07/04			
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22		国	債	証	券	1.7500	1,540		1,628		196,902			2022/07/04			
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34		国	債	証	券	4.7500	1,370		2,391		289,210			2034/07/04			
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46		国	債	証	券	2.5000	1,730		2,882		348,631			2046/08/15			
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48		国	債	証	券	1.2500	1,040		1,401		169,533			2048/08/15			
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25		国	債	証	券	1.0000	670		731		88,450			2025/08/15			
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27		国	債	証	券	0.5000	1,600		1,730		209,317			2027/08/15			

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	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,710	1,778	215,069	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,440	1,536	185,855	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	1,500	1,641	198,478	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,441	174,277	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	430	449	54,383	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	330	324	39,275	2050/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	1,070	1,117	135,138	2021/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	1,650	1,741	210,627	2022/09/04
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,164	140,846	2024/10/18
BUNDESUBL 10/07/22	国債証券	0.0000	1,400	1,424	172,246	2022/10/07
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,311	158,601	2023/10/13
小計	—	—	50,000	61,740	7,466,249	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	1,810	2,032	245,755	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,580	2,406	291,001	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,357	164,175	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,340	2,118	256,163	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,460	1,709	206,752	2023/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,660	1,815	219,536	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,270	1,487	179,929	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,210	1,340	162,157	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,530	1,724	208,525	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,240	1,375	166,283	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,370	1,532	185,326	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	1,570	1,599	193,380	2022/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	850	873	105,609	2030/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,170	1,620	195,948	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,170	2,084	252,032	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,070	1,891	228,758	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	760	1,330	160,940	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,729	209,141	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,650	1,941	234,775	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,220	2,027	245,212	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,140	1,422	172,021	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,540	1,703	206,047	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	490	582	70,479	2035/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	1,700	1,730	209,274	2021/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	340	347	42,051	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,120	1,146	138,689	2023/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,757	212,542	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	880	1,259	152,348	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	830	1,610	194,782	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,040	1,506	182,234	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	860	1,215	146,998	2048/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,580	1,786	216,081	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,480	1,641	198,521	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,070	1,167	141,229	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,080	1,123	135,865	2029/10/31

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	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	1,430	1,679	203,140	2023/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	1,340	1,371	165,872	2022/10/31
小 計	—	—	45,890	57,054	6,899,589	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	1,978	239,244	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	970	1,338	161,865	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,390	1,532	185,297	2028/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,020	1,211	146,562	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,377	166,608	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,090	1,280	154,875	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	660	794	96,095	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,209	267,250	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	1,700	1,877	227,105	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	2,023	244,660	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	640	681	82,416	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	520	649	78,546	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	970	1,233	149,193	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,640	2,047	247,556	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	1,070	1,101	133,160	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	920	946	114,448	2023/03/01
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	1,660	1,712	207,105	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	770	792	95,779	2022/04/01
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,040	1,084	131,121	2030/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,000	3,050	368,909	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,599	193,423	2023/05/01
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国債証券	3.7500	2,300	2,409	291,434	2021/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	1,610	1,723	208,462	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,540	1,629	197,066	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,500	1,606	194,274	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,690	1,793	216,838	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	520	578	69,976	2027/06/01
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国債証券	0.4500	910	918	111,049	2021/06/01
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	130	143	17,312	2026/07/15
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	3,200	3,383	409,145	2021/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,610	2,397	289,923	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,330	2,091	252,883	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,207	266,897	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,600	1,764	213,360	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	780	932	112,826	2029/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	980	1,004	121,450	2022/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	940	1,146	138,591	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	970	1,540	186,262	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	990	1,288	155,851	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	750	998	120,709	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,440	2,274	275,070	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	700	786	95,096	2050/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	2,470	2,657	321,427	2021/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,100	1,269	153,514	2033/09/01

銘	柄	当				期		末								
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日	
									外	貨						建
(ユーロ…イタリア)					%	千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円			
ITALY	BTPS	3.75	09/01/24	国	債	証	券	3.7500	1,900	2,201	266,175					2024/09/01
ITALY	BTPS	3.85	09/01/49	国	債	証	券	3.8500	740	1,066	128,979					2049/09/01
ITALY	BTPS	5.5	09/01/22	国	債	証	券	5.5000	1,150	1,311	158,652					2022/09/01
ITALY	BTPS	2.25	09/01/36	国	債	証	券	2.2500	1,020	1,147	138,767					2036/09/01
ITALY	BTPS	1.45	09/15/22	国	債	証	券	1.4500	1,500	1,559	188,540					2022/09/15
ITALY	BTPS	0.65	10/15/23	国	債	証	券	0.6500	980	1,001	121,096					2023/10/15
ITALY	BTPS	9.0	11/01/23	国	債	証	券	9.0000	1,190	1,580	191,151					2023/11/01
ITALY	BTPS	7.25	11/01/26	国	債	証	券	7.2500	1,080	1,556	188,214					2026/11/01
ITALY	BTPS	6.5	11/01/27	国	債	証	券	6.5000	1,790	2,568	310,648					2027/11/01
ITALY	BTPS	5.25	11/01/29	国	債	証	券	5.2500	2,030	2,854	345,155					2029/11/01
ITALY	BTPS	5.5	11/01/22	国	債	証	券	5.5000	1,960	2,253	272,494					2022/11/01
ITALY	BTPS	1.45	11/15/24	国	債	証	券	1.4500	1,040	1,099	132,941					2024/11/15
ITALY	BTPS	2.5	11/15/25	国	債	証	券	2.5000	550	615	74,385					2025/11/15
ITALY	BTPS	0.35	11/01/21	国	債	証	券	0.3500	1,700	1,716	207,544					2021/11/01
ITALY	BTPS	2.0	12/01/25	国	債	証	券	2.0000	970	1,058	128,015					2025/12/01
ITALY	BTPS	1.25	12/01/26	国	債	証	券	1.2500	1,350	1,415	171,157					2026/12/01
ITALY	BTPS	2.5	12/01/24	国	債	証	券	2.5000	970	1,073	129,785					2024/12/01
ITALY	BTPS	2.8	12/01/28	国	債	証	券	2.8000	1,400	1,640	198,340					2028/12/01
ITALY	BTPS	2.15	12/15/21	国	債	証	券	2.1500	1,680	1,751	211,796					2021/12/15
小	計	-	-	-	-	-	-	-	81,140	96,539	11,674,496					-
(ユーロ…フィンランド)					%	千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円			
FINLAND	2.0	04/15/24	国	債	証	券	2.0000	280	280	310	37,537					2024/04/15
FINLAND	0.75	04/15/31	国	債	証	券	0.7500	380	419	50,722						2031/04/15
FINLAND	1.375	04/15/47	国	債	証	券	1.3750	130	169	20,476						2047/04/15
FINLAND	0.5	04/15/26	国	債	証	券	0.5000	300	317	38,438						2026/04/15
FINLAND	1.125	04/15/34	国	債	証	券	1.1250	230	267	32,369						2034/04/15
FINLAND	1.5	04/15/23	国	債	証	券	1.5000	170	181	21,932						2023/04/15
FINLAND	04/15/22	国	債	証	券	0.0000	320	324	39,228							2022/04/15
FINLAND	4.0	07/04/25	国	債	証	券	4.0000	430	536	64,824						2025/07/04
FINLAND	2.75	07/04/28	国	債	証	券	2.7500	380	479	58,015						2028/07/04
FINLAND	2.625	07/04/42	国	債	証	券	2.6250	350	541	65,528						2042/07/04
FINLAND	0.5	09/15/29	国	債	証	券	0.5000	270	289	35,043						2029/09/15
FINLAND	0.875	09/15/25	国	債	証	券	0.8750	300	323	39,082						2025/09/15
FINLAND	0.5	09/15/28	国	債	証	券	0.5000	240	257	31,089						2028/09/15
FINLAND	0.5	09/15/27	国	債	証	券	0.5000	300	320	38,704						2027/09/15
FINLAND	1.625	09/15/22	国	債	証	券	1.6250	400	423	51,178						2022/09/15
FINLAND	09/15/23	国	債	証	券	0.0000	230	235	28,422							2023/09/15
小	計	-	-	-	-	-	-	-	4,710	5,396	652,595					-
(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	250	250	571	69,171					2062/01/26
AUSTRIA	1.5	02/20/47	国	債	証	券	1.5000	370	485	58,758						2047/02/20
AUSTRIA	0.5	02/20/29	国	債	証	券	0.5000	340	364	44,050						2029/02/20
AUSTRIA	0.75	02/20/28	国	債	証	券	0.7500	820	892	107,980						2028/02/20
AUSTRIA	4.85	03/15/26	国	債	証	券	4.8500	590	782	94,684						2026/03/15
AUSTRIA	4.15	03/15/37	国	債	証	券	4.1500	890	1,509	182,536						2037/03/15
AUSTRIA	3.65	04/20/22	国	債	証	券	3.6500	280	305	36,999						2022/04/20
AUSTRIA	0.5	04/20/27	国	債	証	券	0.5000	520	553	66,980						2027/04/20
AUSTRIA	2.4	05/23/34	国	債	証	券	2.4000	480	645	78,117						2034/05/23

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	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	460	781	94,447	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	670	1,004	121,476	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	350	357	43,178	2023/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	1,420	1,511	182,745	2021/09/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	330	643	77,778	2117/09/20
AUSTRIA 09/20/22	国債証券	0.0000	470	477	57,767	2022/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	540	596	72,076	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	580	625	75,686	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	640	701	84,885	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	750	815	98,569	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	180	262	31,776	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	740	822	99,484	2022/11/22
小 計	—	—	11,670	14,712	1,779,149	—
合 計	—	—	—	—	127,972,430	—

■投資信託財産の構成

2020年2月21日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 127,972,430	% 97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,017,425	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	130,989,855	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、130,489,048千円、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2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.11円、1カナダ・ドル=84.60円、1オーストラリア・ドル=74.21円、1シンガポール・ドル=80.07円、1イギリス・ポンド=144.44円、1デンマーク・クローネ=16.19円、1ノルウェー・クローネ=12.03円、1スウェーデン・クローナ=11.42円、1メキシコ・ペソ=5.95円、1マレーシア・リンギット=26.75円、1南アフリカ・ランド=7.42円、1ポーランド・ズロチ=28.27円、1ユーロ=120.93円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	130,989,855,521円
コ ー ル ・ ク ー ン 等	2,138,894,536
公 社 債(評価額)	127,972,430,109
未 収 利 息	869,632,019
前 払 費 用	8,898,857
(B) 負 債	185,938,200
未 払 解 約 金	185,938,200
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	130,803,917,321
元 本	66,784,593,799
次 期 繰 越 損 益	64,019,323,522
(D) 受 益 権 総 口 数	66,784,593,799口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	19,586円

(注1) 期首元本額	108,789,722,301円
追加設定元本額	14,409,786,591円
一部解約元本額	56,414,915,093円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I A M 外国債券パッシブ・ファンド	8,874,003,827円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	5,775,654円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	22,123,281円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	25,741,467円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	80,085,833円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	83,655,608円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	35,465,308円
たわらノーロード 先進国債券	6,509,607,053円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	149,495,926円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	479,712,374円
たわらノーロード バランス (堅実型)	11,707,903円
たわらノーロード バランス (標準型)	55,613,057円
たわらノーロード バランス (積極型)	11,564,861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)	1,913,072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)	134,211,407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)	176,522,766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)	60,240,852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)	36,378,986円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	68,332円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,616,898円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	4,040,132円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,282,053円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,349,638円
D I A M 外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,832,006,477円
One D C 先進国債券インデックスファンド	639,979円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型	585,714,796円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	1,821,374,172円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型	1,899,253,523円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	367,533,477円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	797,283,999円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	632,041,626円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	20,946,445円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	607,750,277円
マネックス資産設計ファンド エポリユーション	22,230,425円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	125,271,635円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	89,691,387円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	147,541,325円
クルーズコントロール	1,255,331,264円

D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	109,167,362円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	177,161,233円
クルーズコントロール<DC年金>	1,269,534円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	1,786,439円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	7,504,090円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	38,912,796円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,359,994円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	139,662円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	1,165,889,077円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	818,056円
D I A M 指替フルヘルツ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	6,588,503,236円
D I A M 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	3,322,079,347円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,199,859,662円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	6,073,392,201円
D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	71,552,724円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	255,255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)	606,183,336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)	455,700,977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)	42,453,454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)	68,261,200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)	19,577,030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)	5,136,190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)	55,431,781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)	76,799,804円
D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,762,682,039円
D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,924,647,331円
D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,376,447,915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)	604,894,639円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	234,213,008円
D I A M アクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,604,999,197円
D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家向け)	639,500,550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)	4,781,172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)	91,625,774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)	449,766,733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)	644,060,493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)	1,151,182,638円
D I A M 世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	73,750,748円
D I A M バランス20VA (適格機関投資家限定)	44,525,537円
D I A M バランス40VA (適格機関投資家限定)	364,076円
D I A M バランス60VA (適格機関投資家限定)	170,414円
期末元本合計	66,784,593,799円

■損益の状況

当期 自2019年2月22日 至2020年2月21日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		3,956,180,646円
受 取 利 息		3,956,709,728
支 払 利 息		△529,082
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		7,416,281,605
売 買 益		12,399,227,471
売 買 損		△4,982,945,866
(C) そ の 他 費 用		△19,454,538
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		11,353,007,713
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		88,880,284,980
(F) 解 約 差 損 益 金		△48,712,391,980
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		12,498,422,809
(H) 合 計(D + E + F + G)		64,019,323,522
次 期 繰 越 損 益 金(H)		64,019,323,522

(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。

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12期（決算日 2020年4月20日）

（計算期間 2019年4月19日～2020年4月20日）

エマージング株式パッシブ・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	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。 ※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。 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 受益証券・ 投資証券 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	（円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率				
8期(2016年4月18日)	円 8,600	% △24.6	ポイント 189,749.05	% △24.2	% 92.8	% 6.1	% 1.0	百万円 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
12期(2020年4月20日)	9,723	△20.7	225,442.54	△18.4	64.7	34.8	0.4	41,166

（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

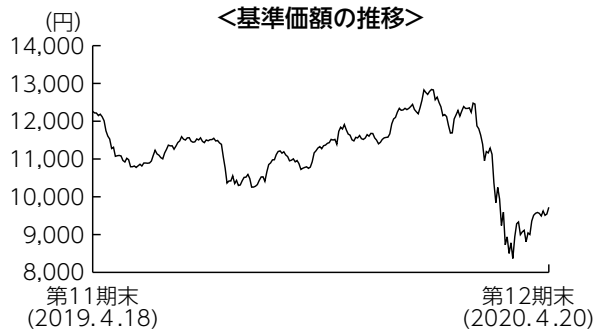
年 月 日	基 準 価 額		M S C I エ マ ー ジ ン グ ・ マ ー ケ ッ ト ・ イ ン デ ッ ク ス		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券、 投 資 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率		(円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2019年 4 月 18 日	円 12,260	% -	ポ ン ト 276,323.22	% -	% 94.4	% 4.4	% 0.6
4 月 末	12,012	△2.0	270,962.63	△1.9	89.9	8.6	0.5
5 月 末	10,861	△11.4	245,572.57	△11.1	90.0	8.2	0.5
6 月 末	11,437	△6.7	258,203.62	△6.6	88.8	9.0	1.8
7 月 末	11,428	△6.8	258,772.93	△6.4	88.5	9.5	1.7
8 月 末	10,433	△14.9	236,418.66	△14.4	88.1	8.4	2.9
9 月 末	10,926	△10.9	248,035.72	△10.2	91.9	6.6	1.0
10 月 末	11,519	△6.0	260,565.89	△5.7	86.0	12.9	1.0
11 月 末	11,675	△4.8	264,578.11	△4.3	88.1	10.9	1.0
12 月 末	12,446	1.5	282,689.73	2.3	89.1	10.4	1.0
2020年 1 月 末	11,890	△3.0	269,975.47	△2.3	87.8	11.2	1.0
2 月 末	11,393	△7.1	260,455.14	△5.7	83.3	15.1	0.8
3 月 末	9,074	△26.0	209,688.40	△24.1	76.5	39.1	0.5
(期 末) 2020年 4 月 20 日	9,723	△20.7	225,442.54	△18.4	64.7	34.8	0.4

(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（2019年4月19日から2020年4月20日まで）

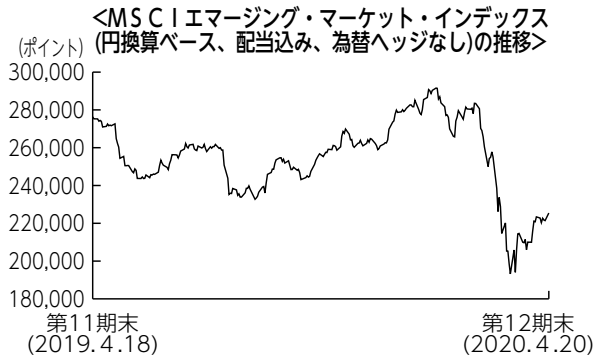


基準価額の推移

当期末の基準価額は9,723円となり、前期末比で20.7%下落しました。

基準価額の主な変動要因

株式市場では台湾など一部の市場は上昇したものの、新型コロナウイルスや原油価格下落の影響が懸念された多くの市場が下落したうえ、為替市場においてほとんどの通貨に対して円高になったことから、基準価額は下落しました。



投資環境

新興国株式市場は米国による対中追加関税に対する不透明感などから弱含む展開となりましたが、2019年10月中旬以降は米中通商協議の進展期待から反発する動きとなりました。2020年に入ってから米中通商協議の第一段階の合意署名を受け上昇傾向が続きましたが、2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大と、原油価格下落による経済への影響が懸念され大きく下落しました。3月下旬以降はいくぶん回復しましたが、前期末と比べて大きく値下がりして期末を迎えました。

為替市場では、米ドルは米中通商協議を巡る混乱からドル安円高が進行したものの、2019年8月に対中追加関税の一部発動延期等をきっかけとしてドル高円安基調となりました。2020年2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され為替は乱高下し、期末時点では前期末と比べてドル安円高となりました。こうした市場環境を背景に、ほとんどの新興国通貨は対円で下落し、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	16.8%
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

期末

No.	業種	組入比率
1	銀行	9.9%
2	小売	7.2
3	メディア・娯楽	5.7
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.5
5	半導体・半導体製造装置	4.6
6	素材	4.4
7	エネルギー	3.8
8	電気通信サービス	2.8
9	保険	2.4
10	食品・飲料・タバコ	2.4



(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18.4%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを2.3%下回りましたが、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、配当課税の要因を除くと、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	15円	0.134%
(株 式)	(13)	(0.112)
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)
(先物・オプション)	(2)	(0.020)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)
(投 資 証 券)	(0)	(0.000)
(b) 有価証券取引税	21	0.186
(株 式)	(21)	(0.186)
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)
(投 資 証 券)	(0)	(0.000)
(c) その他費用	22	0.201
(保 管 費 用)	(16)	(0.147)
(そ の 他)	(6)	(0.053)
合 計	58	0.520

(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(11,180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 (2019年4月19日から2020年4月20日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	16,856.16 (146.86)	千アメリカ・ドル 51,386 (-)	27,934.82	千アメリカ・ドル 77,877
	香 港	554,549.5 (938)	千香港・ドル 581,838 (△305)	992,284.5	千香港・ドル 992,235
	台 湾	208,375.58 (1,865.75)	千台湾・ドル 1,126,428 (△1,378)	357,090	千台湾・ドル 2,042,558
	イ ギ リ ス	182.62 (-)	千イギリス・ポンド 189 (-)	312.4	千イギリス・ポンド 334
	ト ル コ	9,122.31 (209.16)	千トルコ・リラ 10,315 (-)	17,342.1	千トルコ・リラ 19,368
	メ キ シ コ	33,335.95 (△2,143)	千メキシコ・ペソ 114,920 (△12,997)	62,660.9	千メキシコ・ペソ 213,460
	フ ィ リ ピ ン	24,771.25 (191.22)	千フィリピン・ペソ 175,653 (-)	62,556.72	千フィリピン・ペソ 306,962
	チ リ	129,062.57 (8,941.39)	千チリ・ペソ 2,098,587 (-)	320,395.49	千チリ・ペソ 3,500,006
	コ ロ ン ビ ア	2,915.21 (-)	千コロンビア・ペソ 3,972,626 (-)	7,626.67	千コロンビア・ペソ 7,804,073
	カ タ ー ル	8,712.05 (18,556.38)	千カタル・リアル 11,648 (-)	18,546.81	千カタル・リアル 17,574

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	サ ウ ジ ア ラ ビ ア	16,494.48 (77.55)	千サウジアラビア・リアル 59,534 (-)	8,312.54	千サウジアラビア・リアル 28,127
	イ ン ド	50,337.27 (1,309.58)	千インド・ルピー 2,322,225 (-)	76,161.37	千インド・ルピー 3,635,329
	パ キ ス タ ン	978.68 (-)	千パキスタン・ルピー 12,229 (-)	2,122	千パキスタン・ルピー 29,010
	イ ン ド ネ シ ア	204,703 (23,972)	千インドネシア・ルピア 93,495,095 (-)	346,444.16	千インドネシア・ルピア 165,267,725
	ア ラ ブ 首 長 国 連 邦	9,635.31 (-)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 6,878 (-)	19,636.15	千アラブ首長国連邦・ディルハム 11,658
	ブ ラ ジ ル	37,577.79 (827.9)	千ブラジル・リアル 102,312 (△4,702)	61,468.12	千ブラジル・リアル 168,820
	チ ェ コ	681.48 (-)	千チェコ・コルナ 8,961 (-)	1,118.36	千チェコ・コルナ 17,327
	韓 国	9,608.49 (21.69)	千韓国・ウォン 45,418,797 (△2,181)	16,134.78	千韓国・ウォン 81,506,176
	中 国	161,751.14 (349.4)	千オフショア・人民元 178,257 (-)	121,032.2	千オフショア・人民元 133,546
	マ レ ー シ ア	45,839 (-)	千マレーシア・リンギット 26,788 (-)	83,268.48	千マレーシア・リンギット 46,889
	南 ア フ リ カ	26,475.81 (△5,801.19)	千南アフリカ・ランド 252,464 (△46,237)	42,859.94	千南アフリカ・ランド 436,794
	タ イ	109,850 (8,194.21)	千タイ・バーツ 363,305 (△75)	145,855.88	千タイ・バーツ 467,777
	ポ ー ラ ン ド	2,471.48 (-)	千ポーランド・ズロチ 11,979 (-)	5,605.51	千ポーランド・ズロチ 20,962
	ハ ン ガ リ ー	509.73 (-)	千ハンガリー・フォリント 303,954 (-)	834.9	千ハンガリー・フォリント 524,424
ユ ー ロ	27 (-)	千ユーロ 51 (-)	-	-	
ロ ギ ー	3,454.74 (-)	千ユーロ 906 (-)	3,636.23	千ユーロ 1,323	

(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 -	千タイ・バーツ -	証券 112,163	千タイ・バーツ 41
		(62,595)	(75)	(-)	(-)

(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 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
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA CAPPED UCITS ETF	3,088.04 (-)	14,666 (-)	3,088.04 (-)	13,482 (-)
メキシコ	千□	千メキシコ・ペソ	千□	千メキシコ・ペソ
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	113.9 (-)	18,990 (-)	202.2 (-)	34,354 (-)
GRUPO TELEvisa SAB	67.1 (147.2)	2,312 (5,435)	110.5 (-)	3,897 (-)
CEMEX SAB DE CV	1,216.9 (-)	7,668 (-)	2,013.8 (-)	13,677 (-)
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	17.7 (27.4)	1,113 (2,493)	20.1 (-)	1,284 (-)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	137.3 (-)	3,252 (△242)	278.5 (-)	7,951 (-)
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	10.1 (39.7)	976 (4,843)	26.5 (-)	2,907 (-)
ブラジル	千□	千ブラジル・レアル	千□	千ブラジル・レアル
SUL AMERICA SA	10.7 (17.869)	568 (561)	12.3 (-)	646 (-)
BANCO SANTANDER BRASIL SA	- (34.6)	- (1,507)	21 (-)	818 (-)
ENERGISA SA	5.1 (16)	281 (719)	15 (-)	810 (-)
KLABIN SA	16.9 (62)	356 (975)	53.7 (-)	1,049 (-)
BANCO BTG PACTUAL SA	4 (18.5)	279 (876)	15.3 (-)	906 (-)
南アフリカ	千□	千南アフリカ・ランド	千□	千南アフリカ・ランド
REDEFINE PROPERTIES LTD	145.422 (279.94)	1,175 (2,538)	272.494 (-)	1,494 (-)
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	143.934 (184.218)	2,517 (4,439)	132.389 (-)	2,386 (-)
HYPROP INVESTMENTS LTD	- (-)	- (-)	22.174 (-)	1,499 (-)
FORTRESS REIT LTD	- (117.482)	- (2,344)	62.964 (-)	1,174 (-)
FORTRESS REIT LTD-B	- (-)	- (-)	57.784 (-)	603 (-)
RESILIENT REIT LTD	- (0.698)	- (-)	29.298 (-)	1,655 (-)

(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 83,453	百万円 71,156	百万円 -	百万円 -

(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	100,666,358	千円
(b)	期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	44,319,711	千円
(c)	売 買 高 比 率 (a)／(b)	2.27	

(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4月19日から2020年4月20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		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	
TRIP.COM GROUP LTD ADR	390.58	236.39	563	60,827	インターネット販売・通信販売
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	170	100.55	71	7,702	金属・鉱業
SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	699	242.1	120	12,981	石油・ガス・消耗燃料
CREDICORP LTD	64.94	34.47	496	53,560	銀行
SINA CORP	58.7	37.64	129	13,994	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	527.53	297.41	242	26,151	無線通信サービス
NETEASE INC-ADR	74.21	35.13	1,224	132,140	娯楽
GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	—	33.43	24	2,643	銀行
SOUTHERN COPPER CORP	72.48	42.94	129	14,018	金属・鉱業
TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	—	37.89	29	3,164	各種電気通信サービス
YPF SA ADR	—	15.94	6	667	石油・ガス・消耗燃料
LUKOIL SPON ADR	467	208.53	1,299	140,209	石油・ガス・消耗燃料
GAZPROM PAO ADR	5,196.69	2,639.51	1,302	140,480	石油・ガス・消耗燃料
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	1,570.79	787.21	307	33,123	銀行
INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	1,058	940	61	6,602	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	1,028.8	547.36	42	4,635	不動産管理・開発
SURGUTNEFTEGAZ ADR	775.37	432.84	198	21,388	石油・ガス・消耗燃料
51JOB INC ADR	23	15.26	109	11,773	専門サービス
X5 RETAIL GROUP NV GDR	126.36	68.74	196	21,151	食品・生活必需品小売り
NOVATEK PJSC GDR	88.33	46.01	593	64,035	石油・ガス・消耗燃料
BAIDU INC -SPON ADR	263.13	135.55	1,423	153,557	インタラクティブ・メディアおよびサービス
NOVOLIPETSK STEEL GDR	136.17	81.7	138	14,993	金属・鉱業
BANCO MACRO SA ADR	—	32.36	53	5,722	銀行
MMC NORILSK NICKEL ADR	635.43	315.94	841	90,738	金属・鉱業
ROSNEFT OIL CO GDR	1,151	615.61	258	27,855	石油・ガス・消耗燃料
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	136.49	70.71	795	85,809	各種消費者サービス
SEVERSTAL GDR	247.28	122.6	142	15,383	金属・鉱業
TATNEFT ADR	246.84	130.78	549	59,233	石油・ガス・消耗燃料
MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	237.48	147.36	99	10,747	金属・鉱業
VTB BANK OJSC GDR	1,720	820	75	8,165	銀行
DP WORLD PLC	152.19	60.42	93	10,104	運送インフラ
MAGNIT PJSC GDR	356.89	201.42	190	20,590	食品・生活必需品小売り
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	424.34	222.33	396	42,793	インターネット販売・通信販売
TAL EDUCATION GROUP-ADR	339.86	190.58	984	106,221	各種消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD ADR	27	16.3	40	4,320	資本市場
SBERBANK ADR	2,588.17	1,341.38	1,385	149,497	銀行
PHOSAGRO PJSC GDR	137.84	92.54	108	11,701	化学
HUAZHU GROUP LTD ADR	126.76	55.08	170	18,433	ホテル・レストラン・レジャー
JOYY INC-ADR	43.98	31.62	196	21,233	インタラクティブ・メディアおよびサービス
GDS HOLDINGS LTD ADR	56	32.56	192	20,726	情報技術サービス
ZAI LAB LTD ADR	—	16.93	107	11,593	バイオテクノロジー
BEST INC ADR	—	85.74	47	5,171	航空貨物・物流サービス
HUYA INC ADR	—	15.6	25	2,785	娯楽
NIO INC ADR	—	234.28	75	8,113	自動車
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	81.15	46.89	51	5,509	娯楽
58.COM INC ADR	91.17	51.12	262	28,293	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AUTOHOME INC ADR	56.56	30.96	246	26,615	インタラクティブ・メディアおよびサービス
LUCKIN COFFEE INC ADR	—	30.29	13	1,434	ホテル・レストラン・レジャー
WEIBO CORP ADR	54.27	19.47	71	7,707	インタラクティブ・メディアおよびサービス
JD.COM INC ADR	697.18	362.26	1,671	180,373	インターネット販売・通信販売
GLOBANT SA	—	19.17	197	21,307	ソフトウェア
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	1,230.79	850.33	17,814	1,921,997	インターネット販売・通信販売
MOMO INC SPON ADR	140.47	63.37	150	16,278	インタラクティブ・メディアおよびサービス

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BAOZUN INC-SPN ADR	34	20.7	64	6,907	インターネット販売・通信販売
PINDUODUO INC ADR	184.17	96.03	426	46,063	インターネット販売・通信販売
YUM CHINA HOLDINGS INC	343.85	176.25	799	86,273	ホテル・レストラン・レジャー
IQIYI INC ADR	111.09	69.53	134	14,463	娯楽
POLYUS PJSC GDR	60.12	25.09	198	21,384	金属・鉱業
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	47.46	37.6	72	7,768	医薬品
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	306.96	158.27	455	49,161	航空貨物・物流サービス
小計	株数 24,857.87 銘柄数 50	株数 13,926.07 銘柄数 60	38,171	4,118,284	
			-	<10.0%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
JIANGXI COPPER CO LTD	1,240	380	287	3,998	金属・鉱業
JIANGSU EXPRESS	1,280	360	316	4,399	運送インフラ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	1,260	580	203	2,825	旅客航空輸送業
ANGANG STEEL CO LTD-H	1,040	-	-	-	金属・鉱業
CHINA MOBILE LIMITED	5,825	2,995	18,059	251,393	無線通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	1,060	615	3,533	49,181	建設資材
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	2,880	1,000	109	1,517	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING ENTERPRISES	515	190	515	7,180	ガス
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	4,360	2,500	672	9,361	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	3,400	1,820	3,024	42,105	ヘルスケア・テクノロジー
YANZHOU COAL MINING CO LTD	1,720	700	433	6,031	石油・ガス・消耗燃料
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	700	365	2,412	33,584	パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,440	380	90	1,258	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	1,240	800	236	3,285	旅客航空輸送業
CNOOC LTD	16,970	8,790	7,374	102,657	石油・ガス・消耗燃料
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	2,700	1,700	1,193	16,612	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	4,520	2,340	3,837	53,419	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	3,651.2	1,871.2	4,893	68,113	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,648.88	1,568.88	5,036	70,102	不動産管理・開発
CITIC LTD	5,620	2,800	2,214	30,830	コンプロマリット
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	1,980	-	-	-	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	1,620	940	514	7,157	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	6,980	3,800	1,664	23,168	コンピュータ・周辺機器
PETRO CHINA CO LTD	19,820	10,700	2,953	41,108	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	5,927.42	2,567.42	1,283	17,869	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	1,599.9	993.9	1,302	18,123	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	24,092	12,912	4,996	69,557	石油・ガス・消耗燃料
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	540	-	-	-	医薬品
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	940	370	509	7,086	情報技術サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	2,320	1,010	1,137	15,830	ソフトウェア
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	755	396	3,177	44,236	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	2,880	1,700	768	10,696	ガス
TOWNGAS CHINA CO LTD	910	100	35	498	ガス
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,520	800	318	4,432	運送インフラ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	6,340	4,200	613	8,535	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	1,240	880	797	11,098	運送インフラ
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD	3,740	1,460	232	3,231	金属・鉱業
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	800	-	-	-	資本市場
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	-	610	893	12,431	不動産管理・開発
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	1,040	610	890	12,397	運送インフラ
CHINA EVERBRIGHT LTD	1,060	620	734	10,218	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,710	922	2,143	29,839	ガス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	635	425	836	11,642	電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	4,780	2,600	3,042	42,344	自動車
SHENZHEN INVESTMENT LTD	3,060	1,480	356	4,964	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	820	440	1,768	24,621	ガス
BYD CO LTD	575	270	1,186	16,518	自動車

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	
CHINA TELECOM CORP LTD	13,400	7,000	1,778	24,749	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	1,720	580	348	4,844	エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,300	9,100	864	12,033	娯楽
SINOTRANS LTD	1,900	2,480	453	6,317	航空貨物・物流サービス
MAANSHAN IRON & STEEL	1,720	160	37	518	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	3,375.92	1,925.92	853	11,876	商業サービス・用品
MMG LTD	2,200	-	-	-	金属・鉱業
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	1,360	700	350	4,872	紙製品・林産品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	6,617.88	3,477.88	2,584	35,970	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	1,890	1,580	467	6,510	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	1,912	1,012	935	13,016	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	3,125	1,190	595	8,282	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	7,150	3,560	5,724	79,684	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	5,610	3,070	1,013	14,102	金属・鉱業
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	700	-	-	-	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,760	1,040	1,148	15,982	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,747	1,567	2,356	32,806	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD	1,764.4	814.4	1,162	16,188	機械
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	1,000	340	159	2,214	石油・ガス・消耗燃料
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	3,730	2,930	606	8,442	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL	460	170	215	3,000	コンプロマリット
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD	-	540	439	6,111	運送インフラ
TINGYI HOLDING CORP	1,780	860	1,111	15,466	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	340	160	692	9,632	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	2,820	1,300	2,061	28,700	水道
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	2,080	1,480	504	7,025	医薬品
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	1,413.33	733.33	2,705	37,667	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	1,460	740	388	5,407	運送インフラ
SINO BIOPHARMACEUTICAL	6,755	3,455	3,987	55,500	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,650	1,390	3,912	54,466	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	5,426	2,804	114,851	1,598,737	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	4,920	2,695	21,182	294,863	保険
LI NING CO LTD	-	1,015	2,461	34,262	繊維・アパレル・贅沢品
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	5,080	3,280	1,000	13,925	水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	9,702.4	4,352.4	317	4,422	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	3,500	2,100	317	4,414	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	1,640	540	285	3,968	旅客航空輸送業
ZTE CORP	712.88	430.88	1,027	14,304	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	2,500	1,260	280	3,911	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	3,340	1,750	2,492	34,688	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	2,485	690	146	2,036	海運業
BANK OF COMMUNICATIONS	8,102.05	3,792.05	1,827	25,442	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	1,862.5	1,162.5	702	9,773	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	720	390	1,528	21,280	電子装置・機器・部品
CHINA CONSTRUCTION BANK	91,385.3	46,635.3	28,540	397,287	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	726	384	3,603	50,165	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,700	1,740	890	12,401	自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	1,580	640	545	7,590	不動産管理・開発
SSY GROUP LTD	1,440	980	596	8,307	医薬品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	1,710	600	468	6,514	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	3,920	1,660	1,538	21,420	建設資材
BANK OF CHINA LTD	75,282	37,952	11,309	157,430	銀行
SHUI ON LAND LTD	3,355	3,880	516	7,183	不動産管理・開発
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,130	600	1,854	25,807	不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	820	-	-	-	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	800	804	810	11,281	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	3,709.7	1,824.7	6,441	89,661	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	
IND & COMM BK OF CHINA - H	65,902.35	31,332.35	16,104	224,179	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	960	355	299	4,175	金属・鉱業
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	1,040	565	416	5,804	電子装置・機器・部品
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	2,276	1,196	688	9,589	建設・土木
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	4,420	1,990	1,040	14,487	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	1,780	430	92	1,280	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	540	400	552	7,683	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	510	170	394	5,490	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	1,150	560	1,150	16,019	家庭用耐久財
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	1,910	-	-	-	食品
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	7,271.42	3,851.42	3,766	52,432	不動産管理・開発
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	3,690	1,320	314	4,373	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	8,798	3,848	1427	19,872	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	1,210	445	504	7,024	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	687	362	4,090	56,941	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,040	550	3,517	48,960	繊維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL	2,610.28	1,265.28	1,213	16,890	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	5,140	2,860	1,527	21,259	不動産管理・開発
CHINA AOYUAN GROUP LTD	-	410	376	5,244	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	2,535	1,340	274	3,823	不動産管理・開発
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	-	1,500	292	4,071	繊維・アパレル・贅沢品
SOHO CHINA LTD	1,725	1,115	404	5,634	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	760	450	1,190	16,568	ソフトウェア
SINOTRUK HONG KONG LTD	645	385	591	8,231	機械
CHINA RAILWAY GROUP LTD	3,380	2,050	906	12,612	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	1,220	540	399	5,562	食品
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	525	250	410	5,707	通信機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	1,650	870	748	10,414	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,880	2,670	1,503	20,924	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	2,518	1,336	3,266	45,469	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	2,500	980	1,342	18,688	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD - H	3,374.5	1,934.5	793	11,040	機械
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	1,260	770	733	10,203	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,115	1,260	1,512	21,047	食品・生活必需品小売り
BBMG CORP	2,220	460	91	1,274	建設資材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	1,452	236	43	604	金属・鉱業
SINOPHARM GROUP CO	1,076	616	1,232	17,149	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	1,340	1,301	18,111	建設資材
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	2,760	80	10	151	建設・土木
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	2,745.27	1,265.27	832	11,589	自動車
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,995	845	301	4,199	金属・鉱業
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	2,680	600	190	2,647	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	2,720	1,880	733	10,206	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	737	305	418	5,824	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	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	3,250	-	-	-	医薬品
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,330	1,230	4,225	58,812	不動産管理・開発
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	1,660	860	283	3,950	不動産管理・開発
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	-	566	358	4,987	機械
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,440	885	3,367	46,874	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	846	353	896	12,480	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	5,926.56	3,021.56	1,713	23,848	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	2,030	1,260	379	5,279	不動産管理・開発
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	848	68	51	710	電気設備
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	-	680	703	9,787	建設関連製品
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,690	1,240	378	5,264	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	27,910	13,380	4,161	57,923	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	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	550	310	926	12,902	専門小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,990	1,450	884	12,312	各種金融サービス
CITIC SECURITIES CO LTD	2,025	915	1,363	18,977	資本市場
SEAZEN GROUP LIMITED	1,720	780	556	7,741	不動産管理・開発
HAITONG SECURITIES CO LTD	2,920	1,220	875	12,193	資本市場
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	7,890	4,610	1,170	16,299	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	460	320	870	12,115	医薬品
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	3,340	1,640	970	13,514	不動産管理・開発
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	1,215	1,235	433	6,034	建設・土木
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	3,285	1,955	762	10,613	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	850	200	90	1,255	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	720	672	9,360	商業サービス・用品
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	940	-	-	-	不動産管理・開発
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	598	260	295	4,118	資本市場
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	7,170	3,700	1,739	24,206	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	430	200	1,196	16,648	食品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	740	320	411	5,728	ライフサイエンス・ツール/サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	1,180	630	2,119	29,509	商業サービス・用品
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	-	630	311	4,340	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	-	167	1,603	22,316	ヘルスケア・テクノロジー
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	3,080	-	-	-	自動車部品
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	-	190	199	2,777	各種消費者サービス
A-LIVING SERVICES CO LTD	-	160	628	8,752	商業サービス・用品
CHINA TOWER CORP LTD	38,060	21,000	3,633	50,571	各種電気通信サービス
XIAOMI CORP	3,356	5,190	5,397	75,134	コンピュータ・周辺機器
WUXI APPTCE CO LTD	-	96	1,008	14,044	ライフサイエンス・ツール/サービス
MEITUAN DIANPING	294	502	5,020	69,878	インターネット販売・通信販売
HAIDLIAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	-	100	320	4,454	ホテル・レストラン・レジャー
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY-RTS	114	-	-	-	電気設備
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,760	2,200	1,036	14,423	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	-	400	1,334	18,569	バイオテクノロジー
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,960	4,560	674	9,394	資本市場
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	1,340	640	819	11,403	不動産管理・開発
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	1,480	825	2,945	40,997	機械
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	-	280	372	5,183	各種消費者サービス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	-	720	683	9,511	専門小売り
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	-	160	467	6,503	医薬品
CHINA VANKE CO LTD-H	1,208.61	645.61	1,649	22,961	不動産管理・開発
LUYE PHARMA GROUP LTD	1,080	530	203	2,832	医薬品
CAR INC	680	-	-	-	陸運・鉄道
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	390	240	387	5,398	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD	9,810	5,450	1,040	14,490	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
FULLSHARE HOLDINGS LTD	6,950	-	-	-	電気設備
BAIC MOTOR CORP LTD	1,635	820	269	3,755	自動車
GF SECURITIES CO LTD	1,120	756	637	8,871	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	512	216	368	5,129	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	1,458	726	930	12,955	資本市場
3SBIO INC	1,290	780	679	9,456	バイオテクノロジー
LEGEND HOLDINGS CORP	315	135	127	1,781	コンピュータ・周辺機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	1,605	1,040	500	6,963	医薬品
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	9,040	5,210	463	6,454	資本市場
CHINA LITERATURE LTD	240	60	186	2,589	メディア
DALI FOODS GROUP CO LTD	1,880	780	373	5,200	食品
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	1,410	270	104	1,458	電子装置・機器・部品
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	5,250	4,850	446	6,211	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	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
MEITU INC	1,525	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
BOC AVIATION LTD	194	131	650	9,053	商社・流通業
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	230	87	227	3,172	保険
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	960	768	907	12,636	資本市場
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	445	390	4,543	63,245	ライフサイエンス・ツール/サービス
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	20,960	—	—	—	インターネット販売・通信販売
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数	459,608	6,397,743	
	892,466.75 207銘柄	455,669.75 207銘柄	—	<15.5%>	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	—	210	4,326	15,530	通信機器
ACER INC	2,785.32	1,405.32	2,213	7,946	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	675.54	365.54	7,237	25,983	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	456.16	256.16	5,904	21,197	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	1,949.28	939.28	4,085	14,668	建設資材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	310	170	3,289	11,809	電子装置・機器・部品
TAIWAN BUSINESS BANK	3,714.57	3,627.79	3,809	13,674	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	850	410	2,796	10,038	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	650	250	2,325	8,346	コンピュータ・周辺機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	549.75	399.75	3,269	11,739	コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC	2,608.58	1,358.58	8,531	30,629	コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	920.7	320.7	1,324	4,754	不動産管理・開発
EVA AIRWAYS CORP	1,962.69	841.25	866	3,110	旅客航空輸送業
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	627.6	337.6	7,325	26,300	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,123.45	2,347.71	4,765	17,109	銀行
CHINA AIRLINES	2,321.56	681.56	488	1,754	旅客航空輸送業
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	1,961.69	1,241.69	4,109	14,754	自動車部品
CHINA STEEL CORP	12,110.58	5,780.58	11,416	40,985	金属・鉱業
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	2,649.94	1,779.94	3,533	12,684	保険
ADVANTECH CO LTD	298.89	138.89	3,875	13,911	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	3,913.04	2,393.04	4,474	16,065	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,976.63	966.63	13,001	46,674	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,080	670	4,093	14,696	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,573.27	1,753.27	19,022	68,292	各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	8,731.94	3,911.94	2,883	10,350	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,468	778	8,246	29,606	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	1,982.76	988.2	1,012	3,636	海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	3,218.24	1,788.24	4,443	15,953	コングロメリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	298.25	203.07	2,964	10,643	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	153.22	73.22	2,050	7,360	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	512.85	242.85	4,492	16,128	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	4,246.33	2,166.33	18,023	64,705	化学
FORMOSA TAFFETA CO LTD	950	190	606	2,175	繊維・アパレル・贅沢品
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	3,355.94	1,755.94	12,484	44,820	化学
GIANT MANUFACTURING	301.51	111.51	1,577	5,664	レジャー用品
MEDIATEK INC	1,435.07	745.07	27,418	98,432	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	6,319.36	3,249.36	13,192	47,360	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	6,342.32	3,994.59	7,449	26,745	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	260	150	7,515	26,978	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	1,440	690	4,547	16,324	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	8,761.41	5,141.41	8,663	31,101	各種金融サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,749.2	3,769.41	14,399	51,692	保険
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	12,234.03	7,584.03	6,522	23,414	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,361.68	5,255.45	13,821	49,620	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	12,492.25	6,082.25	46,103	165,511	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	10,264.95	5,214.95	15,149	54,386	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	92.2	52.2	20,097	72,148	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	9,785.89	4,285.93	5,250	18,848	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	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	9,430.61	4,830.61	4,077	14,636	保険
INVENTEC CO LTD	2,060.05	1,460.05	3,445	12,370	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,848.45	938.45	4,030	14,470	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	10,584.43	4,714.43	5,610	20,140	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	16,720.48	9,120.48	17,876	64,175	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,322.2	5,028.52	10,559	37,910	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	855.6	355.6	3,449	12,383	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	4,898.28	2,528.28	15,194	54,549	化学
WISTRON CORP	2,669.16	1,359.16	3,540	12,710	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	2,289.9	1,459.9	4,168	14,963	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	4,622.97	2,402.97	16,292	58,488	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	543.92	293.92	8,435	30,283	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,084.8	484.8	4,004	14,375	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	126.58	56.58	1,530	5,494	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	543.93	283.93	1,186	4,260	不動産管理・開発
RUENTEX INDUSTRIES LTD	338.29	118.29	785	2,819	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	955.88	455.88	2,484	8,919	電子装置・機器・部品
STANDARD FOODS CORP	346.39	256.39	1,681	6,038	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	1,518.99	478.99	1,841	6,611	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT CORP	4,445.61	2,496.84	10,486	37,647	建設資材
TATUNG CO LTD	1,640	610	1,381	4,960	家庭用耐久財
TAIWAN SEMICONDUCTOR	23,370.83	12,020.83	368,438	1,322,693	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	11,565.25	5,665.25	8,526	30,609	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	3,180	2,170	2,886	10,361	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORP	231.6	131.6	4,467	16,039	電子装置・機器・部品
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	2,030	1,090	3,515	12,619	運送インフラ
INNOLUX CORPORATION	8,203.45	5,143.45	3,214	11,540	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	1,432.03	722.03	2,725	9,785	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	190.73	86.45	2,118	7,603	機械
TAIMED BIOLOGICS INC	180	-	-	-	バイオテクノロジー
PEGATRON CORP	1,925.54	1,025.54	6,676	23,967	コンピュータ・周辺機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	90	40	1,988	7,136	機械
WIN SEMICONDUCTORS CORP	310	140	3,836	13,771	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,117.37	650.29	6,470	23,228	各種金融サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	453.85	223.85	2,294	8,237	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	8,394.12	4,516.74	8,988	32,268	銀行
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	2,990	1,769.93	7,557	27,131	銀行
WIWYNN CORP	-	30	1,989	7,140	コンピュータ・周辺機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	3,329.03	1,779.03	11,883	42,663	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	190	90	3,415	12,261	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	150	60	1,263	4,534	家庭用耐久財
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	311,006.96 87銘柄	164,158.29 88銘柄	949,323 -	3,408,070 <8.3%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	227.56	97.78	148	20,040	金属・鉱業
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	227.56 1銘柄	97.78 1銘柄	148 -	20,040 <0.0%>	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
AKBANK TAS	2,958.91	1,660.79	961	15,029	銀行
ANADOLU EFES BIRACLIK VE MALT SANAYII AS	197.24	35.73	65	1,028	飲料
ARCELIK	189.02	8.01	12	192	家庭用耐久財
AELSAN ELEKTRONIK SANAYI	317.66	91.92	249	3,896	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	1,259.6	887.23	730	11,412	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	59.19	46.68	270	4,224	自動車
KOC HOLDING AS	673.25	302.17	453	7,093	コンピュータ・周辺機器
PETKIM PETROKIMYA HOLDING	881.74	-	-	-	化学
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	543.97	-	-	-	コンピュータ・周辺機器

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	金額			
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円			
TURK HAVA YOLLARI	490.81	430.05	452	7,071			旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	931.18	549.66	730	11,417			無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI AS	2,383.94	1,316.2	1,104	17,260			銀行
TURKIYE IS BANKASI	1,510.63	694.78	343	5,375			銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	106.81	72.64	633	9,900			石油・ガス・消耗燃料
HACI OMER SABANCI HOLDING AS	1,091.14	213.6	166	2,597			各種金融サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	190.11	191.76	1,069	16,709			食品・生活必需品小売り
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	137.35	30.4	61	955			運送インフラ
TURKIYE HALK BANKASI AS	619.7	-	-	-			銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	7,304	114,164	-	-	<0.3%>
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円			
ALFA SAB DE CV	2,641	861	872	3,916			コングロマリット
EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	191	106	720	3,236			複合小売り
GRUPO TELEVISIA SAB	2,389	-	-	-			メディア
GRUPO BIMBO SAB DE CV	1,626	720	2,409	10,820			食品
GRUMA SAB DE CV	216.4	103.85	2,155	9,677			食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	202.6	77.6	1,183	5,312			運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	376	92	446	2,003			コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	2,484	1,332	8,454	37,959			銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	940.25	327.25	895	4,020			化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	161.55	75.55	1,320	5,929			金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	1,343	910	3,179	14,276			家庭用品
ALSEA SAB DE CV	437	294	489	2,197			ホテル・レストラン・レジャー
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	204.65	100.75	2,419	10,862			運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	3,389.52	1,747.52	7,804	35,041			金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE CV	32,125.78	16,379.78	21,654	97,226			無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	1,988	1,521	2,441	10,961			銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	426	258	2,522	11,325			飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	4,962	2,535	14,685	65,936			食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	312	198.4	2,729	12,255			運送インフラ
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	274	-	-	-			メディア
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	544	187	1,270	5,702			ガス
BANCO SANTANDER MEXICO SA	1,545.9	-	-	-			銀行
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	515	-	-	-			飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	77,653	348,663	-	-	<0.8%>
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円			
AYALA LAND INC	7,186	3,801	11,992	25,423			不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,798.9	1,096.3	4,829	10,237			コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	855.7	248.2	1,511	3,204			銀行
AYALA CORP	244.33	154.33	9,213	19,532			コングロマリット
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	3,077	-	-	-			コングロマリット
DMCI HOLDINGS INC	3,518.5	-	-	-			コングロマリット
GLOBE TELECOM INC	27.85	15.55	3,467	7,351			無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	814.2	620.8	4,997	10,594			運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,892.4	1,519.9	8,177	17,335			コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP	437.2	289.3	4,194	8,893			ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,449.97	1,186.75	4,942	10,478			銀行
BDO UNIBANK INC	1,925.83	912.73	9,583	20,317			銀行
MEGAWORLD CORP	9,620	1,980	554	1,175			不動産管理・開発
PLDT INC	86	47.05	5,354	11,351			無線通信サービス
ROBINSONS LAND CORP	2,187.22	940	1,434	3,041			不動産管理・開発
SECURITY BANK CORP	234.2	113.1	1,181	2,505			銀行
SM PRIME HOLDINGS INC	9,700.75	4,911.75	15,693	33,269			不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	791.3	414.9	5,260	11,153			食品
SM INVESTMENTS CORP	219.38	106.38	9,148	19,395			コングロマリット

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	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	11,489	3,529	952	2,019	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	1,282	510	1,366	2,897	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY	234.3	148	3,981	8,440	電力
GT CAPITAL HOLDINGS INC	91.37	24.11	1,181	2,504	コンプロマリット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	109,019 -	231,121 <0.6%>	
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	64,144.7	27,996.58	91,828	11,597	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	47.7	33.79	96,301	12,162	銀行
BANCO DE CHILE	22,134.93	25,958.42	184,564	23,310	銀行
EMPRESAS CMPC SA	1,115.77	390.74	63,897	8,070	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	376.73	180.31	92,336	11,662	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	130.24	53.63	35,663	4,504	飲料
ENTEL CHILE SA	135.72	66.1	28,489	3,598	無線通信サービス
ENEL AMERICAS SA	28,187.18	19,544.64	266,784	33,694	電力
COLBUN SA	8,191.36	2,568.74	29,861	3,771	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AGUAS ANDINAS SA	2,240.14	868.53	22,581	2,852	水道
EMBOTELLADORA ANDINA SA	404.01	200.26	37,849	4,780	飲料
LATAM AIRLINES GROUP SA	306.55	38.99	12,355	1,560	旅客航空輸送業
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	106.24	40.1	76,049	9,605	化学
FALABELLA SA	674.78	514.1	113,102	14,284	複合小売り
ITAU CORPBANCA	132,369.77	12,369.77	2,981	376	銀行
CENCOSUD SA	1,511.41	732.05	71,382	9,015	食品・生活必需品小売り
ENEL CHILE SA	28,910.6	17,039.55	111,609	14,096	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	1,337,638 -	168,943 <0.4%>	
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	441.5	216.75	390,150	10,690	電力
ECOPETROL SA	4,555.98	2,603.36	507,655	13,909	石油・ガス・消耗燃料
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	101.38	-	-	-	各種金融サービス
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	3,418.31	1,960.73	185,288	5,076	銀行
CEMENTOS ARGOS SA	377.2	-	-	-	建設資材
GRUPO ARGOS SA	282.17	148.97	168,336	4,612	建設資材
BANCOLOMBIA SA	209.47	67.47	178,795	4,898	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	449.76	275.34	758,286	20,777	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	240.67	92.36	222,772	6,103	各種金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	2,411,284 -	66,069 <0.2%>	
(カタール)	百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR INSURANCE CO SAQ	144.17	822.82	177	5,248	保険
QATAR NATIONAL BANK	429.98	2,186.04	3,869	114,260	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	182.02	758.09	304	8,990	銀行
OOREDOO QSC	67.6	534.59	327	9,659	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	-	292.53	492	14,555	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	50.5	326.18	482	14,255	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	-	286.75	230	6,810	銀行
INDUSTRIES QATAR QSC	174.05	940.11	644	19,030	コンプロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	114.06	589.69	893	26,381	銀行
MASRAF AL RAYAN	365.35	1,604.22	601	17,755	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	167.63	1,000.55	276	8,163	不動産管理・開発
EZDAN HOLDING GROUP QSC	694.16	-	-	-	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	-	1,769.57	326	9,646	化学
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	8,627 -	254,757 <0.6%>	
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	-	124.66	536	15,445	化学
JARIR MARKETING CO	-	21.89	301	8,681	専門小売り

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		
(サウジアラビア)	百株	百株	千円	千円		
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	—	20.3	130	3,756	保険	
ETIHAD ETISALAT CO	—	207.81	516	14,856	無線通信サービス	
SAUDI BRITISH BANK	—	365.42	778	22,400	銀行	
AL RAJHI BANK	—	578.93	3,085	88,806	銀行	
ARAB NATIONAL BANK	—	303.9	561	16,163	銀行	
BANK ALBILAD	—	210.92	434	12,492	銀行	
BANK AL-JAZIRA	—	294.76	333	9,586	銀行	
BANQUE SAUDI FRANSI	—	273.61	746	21,497	銀行	
RIYAD BANK	—	594.73	915	26,359	銀行	
SAMBA FINANCIAL GROUP	—	487.48	1,011	29,097	銀行	
SAUDI TELECOM CO	—	190.84	1,742	50,145	各種電気通信サービス	
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	—	86.58	557	16,047	化学	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	—	353.28	2,691	77,475	化学	
SAUDI CEMENT CO	—	27.73	141	4,062	建設資材	
SAUDI ELECTRICITY CO	—	407.14	676	19,474	電力	
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	—	76.5	130	3,742	化学	
SAVOLA GROUP	—	140.14	574	16,536	食品	
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	—	284.89	273	7,871	化学	
ALMARAI CO JSC	—	130.48	626	18,043	食品	
EMAAR ECONOMIC CITY	—	153.95	107	3,105	不動産管理・開発	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	—	249.29	346	9,972	化学	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	—	37.51	164	4,728	化学	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	—	484.81	387	11,162	化学	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	—	208.3	169	4,879	不動産管理・開発	
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	—	60.66	86	2,479	石油・ガス・消耗燃料	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	—	7.18	73	2,107	保険	
ALINMA BANK	—	500.3	755	21,741	銀行	
SAUDI ARABIAN MINING CO	—	225.49	795	22,908	金属・鉱業	
SAUDI AIRLINES CATERING CO	—	31.19	221	6,373	ホテル・レストラン・レジャー	
SAUDI ARABIAN OIL CO	—	545.76	1,645	47,356	石油・ガス・消耗燃料	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	—	573.06	2,011	57,889	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	8,259.49	23,531	677,245	
		百株	33銘柄	—	<1.6%>	
(インド)	百株	百株	千円	千円		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	2,705.06	1,400.2	171,384	243,365	石油・ガス・消耗燃料	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	729.4	282.46	10,171	14,443	石油・ガス・消耗燃料	
ASIAN PAINTS LTD	278.04	144.6	25,395	36,061	化学	
EICHER MOTORS LTD	12.23	5.58	8,241	11,703	自動車	
GRASIM INDUSTRIES LTD	326.39	134.74	7,350	10,438	建設資材	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	721.96	405.49	14,727	20,912	自動車	
SHREE CEMENT LTD	8.46	5.11	9,681	13,748	建設資材	
ICICI BANK LTD	2,271.54	2,368.52	88,949	126,308	銀行	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	584.63	202.28	4,403	6,253	石油・ガス・消耗燃料	
STATE BANK OF INDIA LTD	1,709.63	945.52	18,272	25,946	銀行	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	189.35	66.92	2,522	3,581	陸運・鉄道	
LIC HOUSING FINANCE LTD	262.42	144.36	4,009	5,693	貯蓄・抵当・不動産金融	
TATA STEEL LTD	301.06	138.26	4,055	5,759	金属・鉱業	
TATA MOTORS LTD	1,561.48	581.68	4,470	6,347	自動車	
JSW STEEL LTD	834.15	381.77	6,768	9,611	金属・鉱業	
TATA POWER CO LTD	1,004.83	371.95	1,279	1,816	電力	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	57.51	33.56	9,504	13,496	食品	
NESTLE INDIA LTD	22.5	11.92	20,650	29,323	食品	
GAIL INDIA LTD	700.27	979.27	8,784	12,473	ガス	
VEDANTA LTD	1,150.72	874.77	7,356	10,446	金属・鉱業	
AXIS BANK LTD	1,810.46	1,059.19	50,714	72,013	銀行	
TITAN COMPANY LTD	276.48	163.05	15,905	22,585	繊維・アパレル・贅沢品	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,226.55	1,078.1	8,225	11,680	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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	—	20.97	2,890	4,104	パーソナル用品
LUPIN LTD	224.53	123.45	10,150	14,413	医薬品
BAJAJ FINANCE LTD	165.95	94.3	21,765	30,907	消費者金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,555.5	808.64	135,900	192,978	貯蓄・抵当・不動産金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	438.7	311.62	4,367	6,201	メディア
INFOSYS LTD	3,320.56	1,672.84	105,179	149,355	情報技術サービス
WIPRO LTD	1,346.1	491.1	9,183	13,040	情報技術サービス
INDIAN OIL CORP LTD	1,682.52	728.1	6,261	8,891	石油・ガス・消耗燃料
HINDUSTAN UNILEVER LTD	615.5	400.78	95,586	135,732	家庭用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	518.18	551.59	25,111	35,657	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	515.6	229.89	11,266	15,999	パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	45.09	41.43	7,606	10,800	自動車
DR REDDYS LABORATORIES LTD	103.89	58.8	23,105	32,810	医薬品
BHARTI AIRTEL LTD	1,351.06	1,217.56	61,176	86,870	無線通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	292.61	175.15	9,283	13,183	飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	813.13	362.94	16,589	23,557	医薬品
DIVI'S LABORATORIES LTD	77.03	43.4	10,121	14,372	ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	101.11	54.52	30,013	42,618	自動車
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	136.89	—	—	—	医薬品
AUROBINDO PHARMA LTD	262.23	114.18	6,196	8,799	医薬品
HAVELLS INDIA LTD	264.92	156.33	8,263	11,734	電気設備
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	950.48	426.76	3,704	5,260	自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	138.34	37.77	3,029	4,301	消費者金融
PETRONET LNG LTD	528.75	418.74	8,860	12,581	石油・ガス・消耗燃料
CIPLA LTD/INDIA	318.7	187.92	11,237	15,957	医薬品
LARSEN & TOUBRO LTD	456.02	262.27	24,467	34,743	建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	93.55	53.62	18,949	26,908	建設資材
ASHOK LEYLAND LTD	1,108.86	500.57	2,447	3,475	機械
BOSCH LTD	6.87	2.22	2,384	3,385	自動車部品
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	853.92	439.12	79,313	112,625	情報技術サービス
NTPC LTD	2,100.66	1,142.12	10,907	15,488	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	74.74	55.89	4,989	7,084	医薬品
YES BANK LTD	1,622.58	—	—	—	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	546.35	468.06	8,095	11,495	建設資材
BHARAT FORGE LTD	184.21	76.44	2,169	3,080	自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,161.35	561.31	6,968	9,895	金属・鉱業
ITC LTD	3,281.99	1,760.58	33,116	47,025	タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	116.66	71.98	10,588	15,035	化学
UNITED PHOSPHORUS LTD	348.38	301.31	10,946	15,544	化学
SIEMENS INDIA LTD	—	26.78	3,207	4,554	コンピュータソフト
INFO EDGE INDIA LTD	—	21.51	5,348	7,594	インタラクティブ・メディアおよびサービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	328.23	156.95	8,675	12,319	パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	455.27	204.62	10,432	14,814	情報技術サービス
VODAFONE IDEA LTD	1,965.27	—	—	—	無線通信サービス
MARICO LTD	456.6	282.57	8,481	12,043	パーソナル用品
PAGE INDUSTRIES LTD	5.28	1.91	3,272	4,646	繊維・アパレル・贅沢品
DLF LTD	—	240.13	3,287	4,668	不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,710.78	959.97	16,103	22,866	電力
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	508.92	354.33	9,501	13,491	運送インフラ
REC LTD	551.73	263.09	2,512	3,567	各種金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD	37.23	21.74	10,869	15,434	保険
BAJAJ AUTO LTD	79.67	33.92	8,070	11,459	自動車
COAL INDIA LTD	1,124.57	544.64	8,101	11,504	石油・ガス・消耗燃料
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	289.33	86.21	1,550	2,201	消費者金融
BHARTI INFRASTRUCTURE LTD	322.96	140.7	2,367	3,362	各種電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	254.66	—	—	—	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	23.33	23.33	77	109	金属・鉱業

銘柄	株数	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)	百株	百株	千円	千円		
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	—	216.72	10,738	15,248	保険	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	25.14	6,729	9,556	資本市場	
BANDHAN BANK LTD	—	99.23	2,146	3,047	銀行	
BERGER PAINTS INDIA LTD	—	79.54	4,102	5,825	化学	
CADILA HEALTHCARE LTD	169.62	—	—	—	医薬品	
AVENUE SUPERMARTS LTD	112.16	65.1	14,400	20,449	食品・生活必需品小売り	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	—	79.31	9,512	13,507	保険	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	—	115.66	4,278	6,075	保険	
INTERGLOBE AVIATION LTD	83	36.35	3,883	5,514	旅客航空輸送業	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	—	149.7	10,515	14,932	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	54,947.24 79銘柄	30,432.72 85銘柄	1,513,188 —	2,148,727 <5.2%>	
(パキスタン)	百株	百株	千円	千円		
MCB BANK LTD	390	124	1,909	1,241	銀行	
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	745	218.68	2,106	1,369	石油・ガス・消耗燃料	
HABIB BANK LTD	544	193	2,035	1,322	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,679 3銘柄	535.68 3銘柄	6,051 —	3,933 <0.0%>	
(インドネシア)	百株	百株	千円	千円		
BARITO PACIFIC TBK PT	—	14,625	1,447,875	10,135	化学	
UNITED TRACTORS TBK PT	1,670.01	1,039.01	1,800,084	12,600	石油・ガス・消耗燃料	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	4,588	2,769	1,730,625	12,114	食品	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,375	3,608	2,480,500	17,363	家庭用品	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	19,392	10,655	4,048,900	28,342	自動車	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	47,363	24,831	8,020,413	56,142	各種電気通信サービス	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	6,756	2,440	1,034,560	7,241	食品	
GUDANG GARAM TBK PT	448	158	726,800	5,087	タバコ	
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	7,955	4,563	746,050	5,222	タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	1,803	1,098	1,205,055	8,435	建設資材	
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	2,620	1,428	742,560	5,197	紙製品・林産品	
BUKIT ASAM TBK PT	2,567	2,300	455,400	3,187	石油・ガス・消耗燃料	
BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	2,613.16	—	—	—	銀行	
BANK MANDIRI	17,900	9,617	4,212,246	29,485	銀行	
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	980	868	457,870	3,205	紙製品・林産品	
BANK RAKYAT INDONESIA	52,904	27,728	7,847,024	54,929	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	10,641	4,772	398,462	2,789	ガス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	7,244	4,400	1,830,400	12,812	銀行	
KALBE FARMA TBK PT	18,222	13,344	1,594,608	11,162	医薬品	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	2,765	1,009	653,327	4,573	建設資材	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	9,338	4,753	12,892,512	90,247	銀行	
XL AXIATA TBK PT	—	355	85,200	596	無線通信サービス	
JASA MARGA PERSERO TBK PT	2,001.25	416.25	121,545	850	運送インフラ	
BUMI SERPONG DAMAI PT	7,465	6,631	527,164	3,690	不動産管理・開発	
ADARO ENERGY PT	14,345	6,845	708,457	4,959	石油・ガス・消耗燃料	
PAKUWON JATI TBK	16,599	2,185	92,644	648	不動産管理・開発	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	2,385	774	789,480	5,526	食品	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	1,808	—	—	—	各種電気通信サービス	
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	4,803	1,579	151,584	1,061	銀行	
ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	—	1,104	147,936	1,035	専門小売り	
PT SURYA CITRA MEDIA TBK	5,113	—	—	—	メディア	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	273,663.42 28銘柄	155,894.26 28銘柄	56,949,284 —	398,644 <1.0%>	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千円	千円		
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	1,361.45	630.16	218	6,433	銀行	
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	1,648.45	876.04	1,289	37,937	各種電気通信サービス	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	2,010.06	1,545.32	673	19,822	銀行	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,589.74	1,363.91	1,579	46,466	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	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千円		
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,431.66	2,271.65	572	16,841	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	3,561.42	1,419.95	214	6,308	不動産管理・開発
EMAAR DEVELOPMENT PJSC	774.63	—	—	—	不動産管理・開発
EMAAR MALLS PJSC	1,781.66	953.55	107	3,170	不動産管理・開発
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	1,902.35	—	—	—	不動産管理・開発
小計	19,061.42	9,060.58	4,655	136,979	
	株数・金額 銘柄数<比率>	9銘柄	7銘柄	<0.3%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
BRF SA	474.92	325.92	620	12,790	食品
VALE SA	3,005.21	1,557.21	6,851	141,145	金属・鉱業
RAIA DROGASIL SA	206	120	1,246	25,686	食品・生活必需品小売り
TIM PARTICIPACOES SA	763	483	628	12,954	無線通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	238.5	94.5	277	5,711	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	198	178	461	9,515	電力
BANCO DO BRASIL SA	847	439	1,298	26,750	銀行
INVESTIMENTOS ITAU SA	4,323.6	2,183.6	1,995	41,113	銀行
LOJAS AMERICANAS SA	770.74	318.74	693	14,281	複合小売り
GERDAU SA	1,010.3	495.3	609	12,549	金属・鉱業
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	158.06	—	—	—	食品・生活必需品小売り
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	—	65.06	416	8,577	食品・生活必需品小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,782.1	1,839.1	3,071	63,268	石油・ガス・消耗燃料
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	328	382	703	14,487	専門小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	3,774.12	2,056.12	3,316	68,320	石油・ガス・消耗燃料
COGNA EDUCACAO	1,373.68	642.47	323	6,670	各種消費者サービス
CCR SA	1,214.2	539.2	684	14,095	運送インフラ
WEG SA	900.72	424.72	1,633	33,649	電気設備
BANCO BRADESCO SA PREF	3,505.5	2,168.85	4,415	90,965	銀行
BANCO BRADESCO SA	997.41	600.25	1,132	23,333	銀行
NATURA COSMETICOS SA	198	—	—	—	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	617.06	195.06	148	3,049	金属・鉱業
SUZANO SA	523.75	282.75	1,013	20,875	紙製品・林産品
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4,639.47	2,352.47	5,462	112,526	銀行
PORTO SEGURO SA	88	46	214	4,428	保険
B2W CIA DIGITAL	162	91	562	11,585	インターネット販売・通信販売
BRASKEM SA	157.3	103.3	216	4,468	化学
ENGIE BRASIL SA	211.87	110.87	444	9,147	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LOCALIZA RENT A CAR	584.8	272.89	874	18,005	陸運・鉄道
TELEFONICA BRASIL S.A.	434.28	228.28	1,092	22,511	各種電気通信サービス
LOJAS RENNER SA	713.7	433.37	1,625	33,477	複合小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	358.52	442.04	621	12,793	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	162	101	540	11,131	石油・ガス・消耗燃料
EQUATORIAL ENERGIA SA	177	417	792	16,321	電力
EMBRAER SA	656.6	211.6	202	4,162	航空宇宙・防衛
M DIAS BRANCO SA	104	—	—	—	食品
BR MALLS PARTICIPACOES SA	765.65	294.65	282	5,820	不動産管理・開発
JBS SA	900	453	965	19,886	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	794.49	549.49	557	11,477	電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	338.98	182.98	771	15,895	水道
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	344.4	206.4	432	8,907	不動産管理・開発
SUL AMERICA SA	178.69	—	—	—	保険
HYPERA SA	365	211	661	13,630	医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	1,987.16	1,013.16	4,005	82,503	資本市場
MAGAZINE LUIZA SA	75	375	1,672	34,445	複合小売り
BANCO SANTANDER BRASIL SA	408	—	—	—	銀行
CIELO SA	1,113.07	465.07	210	4,339	情報技術サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	689	296	767	15,804	保険
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	—	251	1,395	28,748	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	
(ブラジル)	百株	百株	千円	千円	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	—	122	13,169	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	373	163	6,849	—	食品・生活必需品小売り
AMBEV SA	4,481.95	2,326.95	55,604	2,699	飲料
KLABIN SA	648	—	—	—	容器・包装
NATURA & CO HOLDING SA	—	345	23,694	1,150	パーソナル用品
RUMO SA	1,080	571	23,807	1,155	陸運・鉄道
IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	137	250	6,138	298	保険
小計	株数 銘柄数<比率>	51,338.8 52銘柄	28,276.37 50銘柄	62,188 —	1,281,077 <3.1%>
(チェコ)	百株	百株	千円	千円	
KOMERCNI BANKA AS	71.13	46.48	10,692	2,486	銀行
CEZ	150.14	80.01	16,170	3,760	電力
MONETA MONEY BANK AS	551.83	209.73	4,725	1,098	銀行
小計	株数 銘柄数<比率>	773.1 3銘柄	336.22 3銘柄	7,346 —	31,588 <0.1%>
(韓国)	百株	百株	千円	千円	
CHEIL WORLDWIDE INC	75.51	33.54	5,042	56,850	メディア
HANMI SCIENCE CO LTD	11.87	—	—	—	医薬品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	31.24	15.15	8,506	95,899	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	29.4	13.75	23,355	263,312	保険
DB INSURANCE CO LTD	48.71	16.28	5,444	61,375	保険
COWAY CO LTD	50.7	27.6	15,104	170,292	家庭用耐久財
KT&G CORP	113.07	59.33	41,048	462,774	タバコ
S-1 CORPORATION	14.44	4.87	3,615	40,761	商業サービス・用品
KOREA GAS CORP	24.69	26.07	6,220	70,128	ガス
CJ CORP	16.95	3.09	1,978	22,309	コングロマリット
KAKAO CORP	48.62	25.98	39,636	446,856	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	5.63	5,618	63,337	インターネット販売・通信販売
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	26.34	31.83	4,686	52,837	機械
KMW CO LTD	—	8.63	4,960	55,922	通信機器
SK TELECOM CO LTD	18.59	10.13	17,880	201,587	無線通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO	26.49	16.47	11,497	129,618	建設・土木
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	403.22	223.72	10,795	121,703	資本市場
NCSOFT CORPORATION	16.88	8.24	47,434	534,776	娯楽
LG UPLUS CORP	96.56	115.51	12,448	140,344	各種電気通信サービス
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	135.4	50.23	1,494	16,852	建設・土木
POSCO INTERNATIONAL CORP	36	16.34	1,920	21,650	商社・流通業
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	8.96	4.74	52,512	592,026	パーソナル用品
LG CHEM LTD	43.91	22.58	72,603	818,525	化学
LG CHEM LTD	7.26	3.54	5,432	61,242	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	2.01	0.78	4,670	52,650	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	407.81	225.41	56,982	642,418	銀行
S-OIL CORP	43.83	25.95	15,467	174,384	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	82.89	32.34	4,130	46,569	化学
MERITZ SECURITIES CO LTD	—	134.12	3,586	40,437	資本市場
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	59.97	25.6	6,551	73,856	資本市場
POSCO CHEMICAL CO LTD	21.26	6.83	3,156	35,584	建設資材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	16.77	8.37	14,402	162,378	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	28.26	10.53	7,257	81,818	専門小売り
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	38.44	18.35	13,346	150,470	機械
HYUNDAI MOBIS	64.84	32.73	52,111	587,503	自動車部品
SK HYNIX INC	554.2	267.27	199,374	2,247,740	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	74.08	42.68	12,549	141,484	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	19.54	7.44	3,966	44,714	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	135.32	76.24	67,963	766,212	自動車
HYUNDAI STEEL CO	71.94	44.76	7,841	88,401	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	226.06	158.08	11,049	124,567	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
KCC CORP	5.54	4.02	57,888	5,134	化学
KIA MOTORS CORP	251.7	132.1	394,979	35,034	自動車
KOREA ZINC CO LTD	8.38	4.27	172,508	15,301	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	247.64	129.26	266,275	23,618	電力
HANWHA CORP	37.85	18.37	33,708	2,989	コングロマリット
KOREAN AIR CO LTD	43.87	8.79	18,371	1,629	旅客航空輸送業
OCI COMPANY LTD	18.29	5.28	20,882	1,852	化学
CJ LOGISTICS	8.6	4.33	63,867	5,665	陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	15.09	12.71	84,140	7,463	化学
KT CORP	20.48	-	-	-	各種電気通信サービス
HLB INC	29.94	17.32	182,206	16,161	レジャー用品
LG ELECTRONICS INC	102.93	46.01	250,754	22,241	家庭用耐久財
LOTTE CORP	28.1	21.83	59,923	5,315	コングロマリット
LG CORP	92.19	46.92	291,373	25,844	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	133.62	51.45	46,870	4,157	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	60.04	25.23	59,795	5,303	建設・土木
NAVER CORP	133.74	68.85	1,232,415	109,315	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	12.49	2.34	15,420	1,367	複合小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	42.91	21.33	104,730	9,289	資本市場
OTTOGI CORP	1.12	1.21	64,856	5,752	食品
AMOREPACIFIC GROUP	27.61	8.4	52,500	4,656	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	106.55	65.2	162,674	14,429	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	74.46	38.29	673,904	59,775	金属・鉱業
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	144.49	47.34	54,204	4,807	建設・土木
SAMSUNG SDI CO LTD	52.65	27.24	780,426	69,223	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	54.55	28.89	329,346	29,212	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,532.55	2,336.06	12,007,348	1,065,051	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	391.72	242.94	105,314	9,341	機械
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	782.05	403.27	1,776,404	157,567	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	6.46	4.13	104,282	9,249	複合小売り
YUHAN CORP	9.51	27.09	126,510	11,221	医薬品
HANON SYSTEMS	171.56	110.87	101,113	8,968	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	56.67	30.18	74,091	6,571	保険
GS HOLDINGS CORP	47.51	21.16	82,100	7,282	石油・ガス・消耗燃料
LG DISPLAY CO LTD	228.49	108.38	124,637	11,055	電子装置・機器・部品
CELLTRION INC	79.64	46.63	983,893	87,271	バイオテクノロジー
HELIXMITH CO LTD	11.9	9.58	81,621	7,239	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL GROUP	289.14	154.1	381,397	33,829	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	18	7.41	77,434	6,868	航空貨物・物流サービス
CELLTRION PHARM INC	14.57	-	-	-	医薬品
LOTTE SHOPPING CO	10.03	5.5	47,630	4,224	複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	67.76	37.37	181,431	16,092	保険
AMOREPACIFIC CORP	31.23	16.57	299,088	26,529	パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	8.48	3.68	23,588	2,092	パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	28.77	8.75	25,375	2,250	消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	61.75	24.96	243,859	21,630	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	8.58	4.84	114,708	10,174	食品
STX PAN OCEAN CO LTD	183.95	215.02	70,096	6,217	海運業
LG INNOTEK CO LTD	14.4	6.98	92,485	8,203	電子装置・機器・部品
SK HOLDINGS CO LTD	30.8	15.27	287,839	25,531	コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	380.76	196.69	636,292	56,439	銀行
MEDY-TOX INC	4.21	2.29	43,739	3,879	バイオテクノロジー
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	66.02	45.7	103,282	9,161	航空宇宙・防衛
BNK FINANCIAL GROUP INC	249.23	214.32	102,873	9,124	銀行
HANMI PHARM CO LTD	6.53	4.16	108,992	9,667	医薬品
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	284.68	113.69	20,634	1,830	保険
FILA HOLDINGS CORP	43.1	24.24	80,719	7,159	繊維・アパレル・贅沢品

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	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
E-MART CO LTD	18.78	11.97	138,253	12,263	食品・生活必需品小売り
DGB FINANCIAL GROUP INC	163.21	—	—	—	銀行
GS RETAIL CO LTD	24.82	8.21	26,148	2,319	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	65.9	47.69	102,056	9,052	自動車部品
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	24.82	12.33	23,242	2,061	建設・土木
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	8.63	5.76	134,496	11,929	機械
BGF RETAIL CO LTD	6.31	2.53	38,203	3,388	食品・生活必需品小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	20.71	13.23	155,452	13,788	食品
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	27.63	—	—	—	保険
NETMARBLE CORP	22.91	8.62	83,096	7,370	娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	443.48	246.32	202,475	17,959	銀行
SAMSUNG SDS CO LTD	33.52	15.37	252,068	22,358	情報技術サービス
SAMSUNG C&T CORP	73.94	41.71	399,998	35,479	コンピュータ
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	15.63	8.24	466,384	41,368	ライフサイエンス・ツール/サービス
PEARL ABBYSS CORP	5.34	3.14	64,935	5,759	娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	36.36	9.89	22,203	1,969	機械
SILLAJEN INC	53.19	—	—	—	バイオテクノロジー
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	44.6	27.41	220,924	19,596	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	36,274.914	3,217.584	
	114銘柄	110銘柄	—	<7.8%>	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
EVE ENERGY CO LTD	—	27	170	2,599	電気設備
LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	—	173	135	2,072	化学
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	—	54	139	2,121	電子装置・機器・部品
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	—	30	180	2,757	飲料
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	—	35	155	2,374	金属・鉱業
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	—	323	160	2,451	化学
UNISPLENDOR CORP LTD	—	56	210	3,208	電子装置・機器・部品
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	—	12	92	1,407	ライフサイエンス・ツール/サービス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	—	3	166	2,537	医薬品
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	—	81	154	2,354	機械
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	—	52	223	3,402	娯楽
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	—	238	136	2,078	保険
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	—	66	126	1,932	家庭用耐久財
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	—	103	386	5,897	建設資材
GEM CO LTD	—	291	137	2,097	金属・鉱業
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	—	69	252	3,843	バイオテクノロジー
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	—	36	135	2,060	電子装置・機器・部品
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	—	59.04	178	2,720	家庭用耐久財
ZHEJIANG NHU CO LTD	—	42	118	1,803	医薬品
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	—	19	67	1,022	医薬品
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	—	18	61	943	電子装置・機器・部品
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	—	142	319	4,869	情報技術サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	—	154	386	5,883	情報技術サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	—	37	152	2,322	食品
VENUSTECH GROUP INC	—	95	366	5,587	ソフトウェア
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	—	76	942	14,358	食品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	—	37	287	4,379	バイオテクノロジー
GLODON CO LTD	—	23	105	1,607	ソフトウェア
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	112	130	1,988	コンピュータ・周辺機器
NAVINFO CO LTD	—	218	325	4,956	家庭用耐久財
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	—	143	115	1,767	不動産管理・開発
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	—	120	261	3,986	医薬品
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	—	60	292	4,459	バイオテクノロジー
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	—	96	114	1,742	化学
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	—	53	315	4,803	半導体・半導体製造装置
INSUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	—	35.7	133	2,029	コンピュータ・周辺機器

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	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	—	127	136	2,076	コンピュータ・周辺機器
O-FILM TECH CO LTD	—	86	127	1,950	電子装置・機器・部品
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	—	86	370	5,647	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	—	184	365	5,571	電子装置・機器・部品
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	—	69	269	4,100	ヘルスケア機器・用品
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	—	382	223	3,399	機械
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	—	67	263	4,013	医薬品
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	—	153	185	2,833	通信機器
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	—	50	126	1,927	エネルギー設備・サービス
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	—	66	239	3,655	娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	—	68	532	8,117	飲料
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	—	74	219	3,349	機械
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	149.5	122	1,870	食品
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	—	177	147	2,252	資本市場
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	—	213	339	5,174	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	—	33	89	1,362	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	—	38	112	1,714	ソフトウェア
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	—	160	128	1,950	不動産管理・開発
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	—	21	247	3,773	資本市場
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	96	198.5	835	12,732	電子装置・機器・部品
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	263	269	116	1,775	メディア
NEW HOPE LIUHE CO LTD	—	111	362	5,526	食品
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	—	65	109	1,666	電子装置・機器・部品
DHC SOFTWARE CO LTD	—	262	351	5,350	情報技術サービス
IFLYTEK CO LTD	64	75	259	3,958	ソフトウェア
GOERTEK INC	—	105	200	3,062	電子装置・機器・部品
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	—	374	372	5,682	商業サービス・用品
BANK OF NINGBO CO LTD	—	126	292	4,458	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD	—	43	72	1,106	電子装置・機器・部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	—	474	218	3,330	家庭用耐久財
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	—	568	365	5,574	資本市場
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	—	376	238	3,638	ホテル・レストラン・レジャー
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	—	122	121	1,844	自動車
WESTERN SECURITIES CO LTD	—	423	342	5,215	資本市場
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	—	79	315	4,803	食品
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	23	30	255	3,894	医薬品
AVIC AIRCRAFT CO LTD	—	107	185	2,824	航空宇宙・防衛
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	—	202	356	5,430	資本市場
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	25	30	269	4,103	飲料
WULIANGYE YIBIN CO LTD	72	123	1,584	24,147	飲料
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	—	208	169	2,580	バイオテクノロジー
SUNING.COM CO LTD	295	291	257	3,924	専門小売り
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	799	791	307	4,689	電子装置・機器・部品
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	123	192	322	4,909	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	57	107	585	8,919	家庭用耐久財
MIDEA GROUP CO LTD	80	—	—	—	家庭用耐久財
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	120	322	973	14,839	電子装置・機器・部品
GUOSEN SECURITIES CO LTD	—	170	185	2,826	資本市場
PING AN BANK CO LTD	272	670	863	13,161	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	—	121	372	5,677	食品
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	790	657	289	4,415	資本市場
CHINA VANKE CO LTD	137	373	996	15,189	不動産管理・開発
ZTE CORP	—	97	388	5,913	通信機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	—	405	260	3,968	機械
WEICHAI POWER CO LTD	299	220	295	4,509	機械
GF SECURITIES CO LTD	227	183	254	3,873	資本市場
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	—	62	61	942	電気設備

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	
BYD CO LTD	75	100	588	8,961	自動車
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	—	110	170	2,605	化学
NANJI E-COMMERCE CO LTD	—	129	178	2,726	メディア
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	12	164	2,500	電子装置・機器・部品
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	—	37	185	2,830	娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	—	12	152	2,328	飲料
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	—	120	143	2,192	化学
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	—	42	287	4,377	家庭用耐久財
YUNDA HOLDING CO LTD	—	54	168	2,569	航空貨物・物流サービス
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	—	338	95	1,462	半導体・半導体製造装置
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	—	151	172	2,632	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SF HOLDING CO LTD	—	50	243	3,707	航空貨物・物流サービス
SHANDONG SINCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	—	65	147	2,240	化学
BANK OF SHANGHAI CO LTD	209	655.9	543	8,286	銀行
CSC FINANCIAL CO LTD	—	63	220	3,354	資本市場
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	—	171	236	3,609	化学
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	—	236	160	2,438	銀行
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	—	43.2	147	2,249	金属・鉱業
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	—	95	147	2,251	食品
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	—	5	115	1,754	電子装置・機器・部品
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	—	29	329	5,020	ヘルスケア機器・用品
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	—	16	204	3,117	バイオテクノロジー
CAITONG SECURITIES CO LTD	—	127	124	1,894	資本市場
BANK OF CHENGDU CO LTD	—	270	203	3,094	銀行
NANJING SECURITIES CO LTD	—	98	145	2,217	資本市場
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	—	144	201	3,070	電子装置・機器・部品
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	—	34	881	13,432	ヘルスケア機器・用品
HUAXI SECURITIES CO LTD	—	155	164	2,511	資本市場
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	—	11	192	2,930	ソフトウェア
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	—	41	561	8,557	電気設備
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	—	6	161	2,459	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTTEC CO LTD	—	32	316	4,817	ライフサイエンス・ツール/サービス
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	—	25	247	3,768	電子装置・機器・部品
WILL SEMICONDUCTOR LTD	—	14	246	3,750	半導体・半導体製造装置
PETROCHINA CO LTD	328	128	58	887	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	755	1,633	840	12,816	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	825	2,306	793	12,089	銀行
BANK OF CHINA LTD	745	840	300	4,582	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	513	351	160	2,439	石油・ガス・消耗燃料
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	—	100	280	4,276	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	—	61	97	1,490	石油・ガス・消耗燃料
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	315	647	2,126	32,400	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	195	339	2,454	37,404	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD	274	653	1,048	15,982	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	367	948	966	14,736	銀行
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	733.2	1,399	810	12,344	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD	109	175	332	5,067	自動車
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	18	37	4,536	69,131	飲料
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	792	1,232	639	9,744	銀行
CITIC SECURITIES CO LTD	316	404	944	14,394	資本市場
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	109	165	483	7,367	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	—	383	165	2,521	運送インフラ
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	265	628	1,075	16,385	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DAQIN RAILWAY CO LTD	301	661	452	6,900	陸運・鉄道
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	608	1,598	576	8,791	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	616	1,467	773	11,782	建設・土木
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	—	736	312	4,755	機械

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	
HAITONG SECURITIES CO LTD	360	242	316	4,820	資本市場
HUAXIA BANK CO LTD	232	229	148	2,261	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	104	228	682	10,406	食品
BANK OF BEIJING CO LTD	428	880	420	6,410	銀行
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	—	795	420	6,409	無線通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	292	407	200	3,057	金属・鉱業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	165	107	622	9,492	建設資材
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	228	157	280	4,280	資本市場
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	204	246	389	5,930	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD	847	1,101	699	10,654	機械
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	102	138	1,333	20,316	医薬品
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	—	366	332	5,064	金属・鉱業
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	274	298	294	4,487	建設・土木
HUATAI SECURITIES CO LTD	236	197	357	5,449	資本市場
CHINA RAILWAY GROUP LTD	—	497	290	4,423	建設・土木
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	—	71	302	4,617	保険
HAIER SMART HOME CO LTD	—	286	423	6,459	家庭用耐久財
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	211	333	652	9,946	機械
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	—	618	126	1,921	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	110	36	128	1,952	医薬品
GEMDALE CORP	—	106	145	2,222	不動産管理・開発
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	—	75	161	2,459	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	—	71	313	4,773	化学
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	—	99	211	3,228	不動産管理・開発
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GROUP CO LTD	—	384	350	5,343	メディア
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	—	700	289	4,405	金属・鉱業
FOUNDER SECURITIES CO LTD	310	159	112	1,710	資本市場
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	—	120	92	1,406	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NARI TECHNOLOGY CO LTD	—	145	305	4,653	電気設備
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	—	298	158	2,420	エネルギー設備・サービス
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	39	82	666	10,159	専門小売り
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	—	1,739	198	3,021	金属・鉱業
TSINGTAO BREWERY CO LTD	—	73	339	5,178	飲料
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LTD	—	669	232	3,537	運送インフラ
AVIC CAPITAL CO LTD	498	322	126	1,933	各種金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	—	658	191	2,918	金属・鉱業
AIR CHINA LTD	—	284	193	2,951	旅客航空輸送業
TBEA CO LTD	—	457	360	5,495	電気設備
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	—	425	260	3,976	建設・土木
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	1,512	336	88	1,341	建設・土木
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	954	264	99	1,512	建設・土木
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	—	33	223	3,405	運送インフラ
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	—	69	217	3,320	医薬品
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	—	84	175	2,675	自動車部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD	—	148	142	2,167	資本市場
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	—	48	57	877	化学
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	237	237	209	3,196	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	99	187	365	5,577	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	93	211	3,228	航空宇宙・防衛
BANK OF NANJING CO LTD	—	156	116	1,773	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	160	76	133	2,037	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	—	618	220	3,362	金属・鉱業
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	532	282	172	2,630	資本市場
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	64	106	267	4,082	医薬品
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	80	68	247	3,764	金属・鉱業
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	—	76	189	2,889	電気設備
BBMG CORP	—	542	178	2,725	建設資材

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	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	240	294	303	4,632	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO LTD	-	186	160	2,443	石油・ガス・消耗燃料
SHENERGY CO LTD	-	464	249	3,797	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	-	882	375	5,726	旅客航空輸送業
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	-	150.19	133	2,041	電気設備
AISINO CORP	64	103	197	3,017	ソフトウェア
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	-	18	171	2,611	ソフトウェア
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	-	65	293	4,466	ソフトウェア
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	665	327	171	2,611	旅客航空輸送業
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	-	1,068	350	5,338	建設・土木
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	-	17	32	498	自動車部品
XIAMEN C & D INC	-	304	233	3,553	商社・流通業
AVIC HELICOPTER CO LTD	-	46	203	3,095	航空宇宙・防衛
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	-	168	133	2,027	資本市場
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	-	850	218	3,329	化学
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	-	140	127	1,945	電気設備
ZHANGZHOU PIENITZHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	18	17	229	3,493	医薬品
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	-	17	165	2,524	飲料
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	-	114	369	5,637	通信機器
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD	-	157	123	1,875	各種金融サービス
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	-	1,602	334	5,102	金属・鉱業
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	-	129	97	1,490	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	-	126	137	2,094	電気設備
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	-	119	168	2,573	運送インフラ
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	-	45	130	1,986	電子装置・機器・部品
TONGWEI CO LTD	-	116	148	2,266	食品
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	-	53	140	2,135	ホテル・レストラン・レジャー
CHINA RAILWAY HI-TECH INDUSTRY CO LTD	-	228	226	3,446	建設・土木
CHINA JUSHI CO LTD	-	234	198	3,031	建設資材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	-	53	358	5,466	機械
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	81	67	112	1,717	通信機器
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	-	65	187	2,864	半導体・半導体製造装置
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	-	323.51	244	3,722	石油・ガス・消耗燃料
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	-	74	932	14,204	食品
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	-	124	252	3,847	自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	-	58	176	2,694	電気設備
DONGXING SECURITIES CO LTD	-	132	144	2,202	資本市場
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	-	128	125	1,911	旅客航空輸送業
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	-	215	360	5,488	資本市場
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	513	214	95	1,451	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HUAAN SECURITIES CO LTD	-	165	123	1,880	資本市場
BANK OF JIANGSU CO LTD	324	218	129	1,966	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD	-	236	183	2,794	銀行
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	-	12	319	4,871	半導体・半導体製造装置
SDIC CAPITAL CO LTD	-	65	79	1,210	資本市場
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SERVICES CO LTD	-	351	126	1,920	専門小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	-	21	141	2,162	機械
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	248	449	423	6,459	資本市場
SPRING AIRLINES CO LTD	-	75	263	4,018	旅客航空輸送業
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	240	160	179	2,738	資本市場
DAWNING INFORMATION INDUSTRY CO LTD	-	75	345	5,260	コンピュータ・周辺機器
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	-	292	160	2,447	不動産管理・開発
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	-	106	335	5,111	不動産管理・開発
小計	株数	株数	金額	金額	
	22,976.2	64,044.54	82,257.00	1,253,600.00	
	73銘柄	259銘柄	-	<3.0%>	
(マレーシア)	百株	百株	千円	千円	
AMMB HOLDINGS BHD	1,345	844	261	6,454	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	
			株数	株数			
(マレーシア)	百株	百株	千円	千円	千円	千円	
GENTING PLANTATIONS BHD	375	141	135	3,349			食品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	4,651	2,774	1,006	24,841			銀行
DIGI.COM BHD	2,887	1,208	553	13,649			無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	1,014.2	588.2	299	7,400			運送インフラ
RHB BANK BHD	777.8	577.8	277	6,842			銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	632	344	248	6,135			コンプロマリット
TOP GLOVE CORP BHD	1,338	563	382	9,444			ヘルスケア機器・用品
GAMUDA BHD	1,946	696	225	5,563			建設・土木
GENTING BHD	2,117	1,367	539	13,320			ホテル・レストラン・レジャー
YTL CORP BHD	2,837.1	1,070.1	81	2,019			総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	202.56	87.56	117	2,894			銀行
HONG LEONG BANK BHD	624.08	237.08	325	8,036			銀行
IJM CORP BHD	2,303.6	1,080.6	189	4,665			建設・土木
IOI CORP BHD	1,872.13	1,222.13	488	12,059			食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	445	265	560	13,820			食品
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	128	88	277	6,842			飲料
MALAYAN BANKING BHD	3,662.75	1,785.75	1,375	33,921			銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	884	-	-	-			銀行
MISC BHD	902.8	561.8	444	10,962			海運業
NESTLE MALAYSIA BHD	48	29	402	9,930			食品
PPB GROUP BHD	475.6	262.6	439	10,844			食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	196	208	437	10,786			石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	604	394	610	15,065			ガス
GENTING MALAYSIA BHD	2,986	1,396	311	7,679			ホテル・レストラン・レジャー
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	147	-	-	-			タバコ
TELEKOM MALAYSIA BHD	1,034	567	224	5,539			各種電気通信サービス
SP SETIA BHD	1,367	-	-	-			不動産管理・開発
TENAGA NASIONAL BHD	3,046.5	1,524.5	1,936	47,763			電力
QL RESOURCES BHD	538	372	303	7,479			食品
DIALOG GROUP BHD	3,205.44	1,504.44	491	12,136			エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	2,762.3	1,545.3	2,478	61,148			銀行
AIRASIA GROUP BHD	1,479	555	43	1,074			旅客航空輸送業
CARLSBERG BREWERY-MALAY BHD	-	70	197	4,869			飲料
SIME DARBY BERHAD	2,296	1,531	283	6,987			コンプロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,171	765	587	14,494			ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD	2,746	1,528	582	14,362			無線通信サービス
MAXIS BHD	2,384	910	496	12,257			無線通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,331	1,323	747	18,440			化学
IHH HEALTHCARE BHD	2,137	1,148	599	14,783			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,092	145	56	1,402			運送インフラ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	1,240	880	340	8,401			金属・鉱業
SIME DARBY PROPERTY BHD	2,327	-	-	-			不動産管理・開発
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,161	876	425	10,502			食品
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	1,745.48	-	-	-			不動産管理・開発
小計	株数 70,464.34	株数 33,034.86	19,788	488,177			
	銘柄数 44銘柄	銘柄数 40銘柄	-	<1.2%>			
(南アフリカ)	百株	百株	千円	千円	千円	千円	
BIDVEST GROUP LTD	334.72	159.91	2,299	13,221			コンプロマリット
CLICKS GROUP LTD	224.23	108.58	2,924	16,813			食品・生活必需品小売り
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	453.11	-	-	-			専門小売り
DISCOVERY LTD	358.24	226.58	1,910	10,982			保険
REDEFINE PROPERTIES LTD	5,458.11	-	-	-			エクイティ不動産投資信託 (REITs)
GOLD FIELDS LTD	699.36	437.64	5,263	30,267			金属・鉱業
REMGRO LTD	506.21	228.62	2,989	17,191			各種金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	198.73	75.72	588	3,386			専門小売り
NORTHAM PLATINUM LTD	-	126.32	1,090	6,271			金属・鉱業
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	808.77	395.05	662	3,811			保険

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	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	2,898.26	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REITs)
EXXARO RESOURCES LTD	248.46	79.98	912	5,247	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	37.04	26.28	2,390	13,747	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	114.38	54.22	366	2,109	保険
MTN GROUP LTD	1,626.78	867.7	4,577	26,318	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	405.22	216.67	8,933	51,367	金属・鉱業
TELKOM SA SOC LTD	220.8	74.7	157	904	各種電気通信サービス
FIRSTRAND LTD	3,195.17	1,694.08	6,381	36,694	各種金融サービス
PSG GROUP LTD	149.38	49.09	691	3,975	各種金融サービス
NASPERS LTD	416.43	217.22	60,290	346,669	インターネット販売・通信販売
NEDBANK GROUP LTD	387.61	213.34	2,016	11,592	銀行
NETCARE LTD	1,054.65	—	—	—	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	312.55	149.15	901	5,180	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	611.74	412	2,060	11,845	各種金融サービス
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	50.42	30.72	2,790	16,045	金属・鉱業
SAPPI LTD	538.82	—	—	—	紙製品・林産品
SASOL LTD	537.28	228.48	1,316	7,567	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	433.8	192.18	2,286	13,147	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	234.11	148.01	1,938	11,148	専門小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,235.96	649.38	6,710	38,582	銀行
SPAR GROUP LTD/THE	200.38	80.76	1,493	8,588	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	880.09	611.53	1,847	10,622	複合小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	345.76	206.4	2,301	13,232	医薬品
ABSA GROUP LTD	698.64	307.37	2,560	14,722	銀行
TIGER BRANDS LTD	159.65	72.48	1,294	7,442	食品
SANLAM LTD	1,713.29	960.98	5,264	30,269	保険
INVESTEC LTD	295.37	252.13	931	5,353	資本市場
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	—	412.26	4,452	25,601	金属・鉱業
KUMBA IRON ORE LTD	53.27	30.74	1,055	6,070	金属・鉱業
MONDI LTD	108.66	—	—	—	紙製品・林産品
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	1,371.82	806.61	1,475	8,482	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
RMI HOLDINGS	555.7	482.13	1,148	6,606	保険
VODACOM GROUP PTY LTD	626.12	323.22	3,899	22,422	無線通信サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC	329.83	151.82	1,381	7,943	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	4,758.87	2,218.19	2,757	15,853	保険
REINET INVESTMENTS SCA	139.93	80.54	2,318	13,328	資本市場
PEPKOR HOLDINGS LTD	—	166.33	189	1,089	専門小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	407.24	249.88	2,264	13,018	メディア
SIBANYE STILLWATER LTD	—	912.18	3,029	17,418	金属・鉱業
FORTRESS REIT LTD-A	1,029.5	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REITs)
BID CORP LTD	323.21	175.18	4,067	23,386	食品・生活必需品小売り
小計	株数 < 金額 >	株数 < 金額 >	166,181	955,545	
	47銘柄	44銘柄	—	< 2.3% >	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL	220	235	2,690	8,933	銀行
BERLI JUCKER PCL NVDR	1,236	779	3,096	10,280	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	3,480	1,462	1,578	5,242	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	—	236	1,398	4,642	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ROBINSON PCL-NVDR	388	—	—	—	複合小売り
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	1,739	297	2,056	6,828	銀行
TRUE CORP PCL NVDR	10,747.55	5,859.55	1,933	6,419	各種電気通信サービス
KASIKORN BANK PCL NVDR	621	352	3,484	11,569	銀行
TMB BANK PCL -NVDR	10,100	13,362	1,202	3,992	銀行
IRPC PCL NVDR	10,609	3,796	979	3,251	石油・ガス・消耗燃料
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	1,720	2,119	1,186	3,939	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	131	164	3,919	13,013	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHIN CORP PCL	—	1,002	4,859	16,134	無線通信サービス

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	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	3,115	2,092	5,596	18,579	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL	1,019	585	11,407	37,872	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	3,805.2	3,186.2	4,301	14,280	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	442	-	-	-	電子装置・機器・部品
PTT PCL	9,960	5,678	19,447	64,564	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,626	1,464	1,888	6,270	食品
LAND AND HOUSES PCL NVDR	2,639	3,678	2,666	8,852	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL NVDR	338.5	386.5	12,638	41,959	建設資材
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	4,064	2,107	12,325	40,922	運送インフラ
KASIKORN BANK PCL - FOREIGN	1,076	566	5,631	18,697	銀行
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	1,192	1,178	5,831	19,359	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	3,813	4,221	8,737	29,008	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	324	239	2,820	9,363	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	2,276.1	1,265.1	2,606	8,652	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR	983	813	3,089	10,256	石油・ガス・消耗燃料
GLOW ENERGY PCL NVDR	540	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CP ALL PCL NVDR	4,812	2,843	18,550	61,587	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	5,313	4,168	4,668	15,498	陸運・鉄道
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	1,329.45	728.45	5,572	18,501	石油・ガス・消耗燃料
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	-	132	531	1,763	無線通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	1,709.22	536.22	1,380	4,584	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,172.08	1,246.08	4,579	15,203	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	1,180	934	3,385	11,240	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	7,678	4,208	3,766	12,503	運送インフラ
B GRIMM POWER PCL NVDR	-	481	1,972	6,547	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	342	1,220	4,178	13,872	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
OSOTSPA PCL NVDR	-	267	1,041	3,457	飲料
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	-	614.33	2,058	6,832	複合小売り
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	-	460	2,357	7,826	消費者金融
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	594	307	1,389	4,612	消費者金融
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	-	255	1,612	5,354	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数 103,334.1	株数 75,522.43	外貨建金額 184,419	邦貨換算金額 612,272	
	銘柄数 36銘柄	銘柄数 41銘柄		<1.5%>	
(ポーランド)	百株	百株	千ポランド・ズロチ	千円	
BANK MILLENNIUM SA	497.82	55.36	17	455	銀行
MBANK	13.83	6.68	145	3,763	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	25.96	-	-	-	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	142.94	82.1	594	15,385	金属・鉱業
BANK PEKAO SA	158.87	68.11	371	9,609	銀行
ORANGE POLSKA SA	586	297.77	197	5,099	各種電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	286.43	157.33	963	24,925	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA	1.31	0.57	324	8,405	繊維・アパレル・贅沢品
SANTANDER BANK POLSKA SA	35.15	24.25	380	9,849	銀行
CD PROJEKT RED SA	60.15	34.22	1,161	30,054	娯楽
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	845.54	440.83	966	25,009	銀行
CCC SA	27.63	20.25	93	2,425	繊維・アパレル・贅沢品
GRUPA LOTOS SA	93.85	39.78	257	6,670	石油・ガス・消耗燃料
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	1,650.76	821.78	307	7,946	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA	234.95	124.85	310	8,042	メディア
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	705.29	416.93	186	4,821	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	538.42	309.05	952	24,640	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	53.8	-	-	-	金属・鉱業
ALIOR BANK SA	90.07	-	-	-	銀行
DINO POLSKA SA	47.09	17.97	334	8,646	食品・生活必需品小売り
AMREST HOLDINGS SE	-	44	112	2,902	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数 6,095.86	株数 2,961.83	外貨建金額 7,679	邦貨換算金額 198,656	
	銘柄数 20銘柄	銘柄数 18銘柄		<0.5%>	

銘柄	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			
(ハンガリー)		百株	百株	千円	千円			
RICHTER GEDEON NYRT		131.04	75.42	48,495	16,095			医薬品
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT		349.34	179.55	37,274	12,371			石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT		214.83	115.07	97,521	32,367			銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	695.21 3銘柄	370.04 3銘柄	183,291	60,834			
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円			
TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA		—	27	30	3,596			建設資材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	27 1銘柄	30	3,596			
(ユーロ…ギリシャ)		百株	百株	千ユーロ	千円			
ALPHA BANK A.E.		1,257.32	383.28	26	3,056			銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		—	263.48	30	3,615			銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.		40.89	—	—	—			建設資材
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		220.51	145.18	170	19,953			各種電気通信サービス
FF GROUP		31.3	31.3	0	0			繊維・アパレル・贅沢品
EUROBANK ERGASIAS SERVICES		—	748.45	27	3,212			銀行
MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN		58.47	22.65	31	3,723			石油・ガス・消耗燃料
OPAP SA		198.46	91.84	62	7,355			ホテル・レストラン・レジャー
JUMBO SA		115.02	54.3	75	8,838			専門小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,921.97 7銘柄	1,740.48 8銘柄	424	49,755			
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,324,818.12 963銘柄	1,249,512.59 1,180銘柄	—	26,646,081			<64.7%>

(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) < >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	柄	期首(前期末)		当期		期末	
		証券数	証券数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(タイ)				千タイ・パーツ	千円		
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR		証券 59,033	証券 —	—	—		
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		—	9,465	21	70		
合計	証券数・金額 銘柄数<比率>	59,033 1銘柄	9,465 1銘柄	—	70		<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	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額
(メキシコ)	千□	千円	千□	千メキシコ・ペソ	千円
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D	184.4	96.1	96.1	13,229	59,398
GRUPO TELEvisa SAB	—	103.8	103.8	2,805	12,597
CEMEX SAB DE CV	1,485.375	688.475	688.475	3,476	15,610
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	—	25	25	1,548	6,950
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	326.1	184.9	184.9	3,555	15,964
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	—	23.3	23.3	2,320	10,417
小計	□数・金額	1,995.875	1,121.575	26,935	120,940
	銘柄数<比率>	3銘柄<0.5%>	6銘柄<0.3%>	—	—
(ブラジル)	千□	千円	千□	千ブラジル・レアル	千円
SUL AMERICA SA	—	16.269	16.269	706	14,561
BANCO SANTANDER BRASIL SA	—	13.6	13.6	360	7,424
ENERGISA SA	—	6.1	6.1	261	5,389
KLABIN SA	—	25.2	25.2	399	8,228
BANCO BTG PACTUAL SA	—	7.2	7.2	291	6,008
小計	□数・金額	—	68.369	2,020	41,612
	銘柄数<比率>	—銘柄<—%>	5銘柄<0.1%>	—	—
(南アフリカ)	千□	千円	千□	千南アフリカ・ランド	千円
REDEFINE PROPERTIES LTD	—	152.868	152.868	400	2,302
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	—	195.763	195.763	2,736	15,736
HYPROP INVESTMENTS LTD	22.174	—	—	—	—
FORTRESS REIT LTD	—	54.518	54.518	601	3,460
FORTRESS REIT LTD-B	57.784	—	—	—	—
RESILIENT REIT LTD	28.6	—	—	—	—
小計	□数・金額	108.558	403.149	3,739	21,500
	銘柄数<比率>	3銘柄<0.1%>	3銘柄<0.1%>	—	—
合計	□数・金額	2,104.433	1,593.093	—	184,052
	銘柄数<比率>	6銘柄<0.6%>	14銘柄<0.4%>	—	—

(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) 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		末
	買 建 額	売 建 額	額
外国 MINI MSCI EMG MKT	百万円 14,340		百万円 -

(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

2020年4月20日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	率
株 式	千円 26,646,081		% 64.5
新 株 予 約 権 証 券	70		0.0
投 資 信 託 受 益 証 券、投 資 証 券	184,052		0.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等、そ の 他	14,474,036		35.0
投 資 信 託 財 産 総 額	41,304,240		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、40,906,088千円、99.0%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4月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.89円、1香港・ドル=13.92円、1台湾・ドル=3.59円、1イギリス・ポンド=134.75円、1トルコ・リラ=15.63円、1メキシコ・ペソ=4.49円、1フィリピン・ペソ=2.12円、100チリ・ペソ=12.63円、100コロンビア・ペソ=2.74円、1カタール・リアル=29.53円、1サウジアラビア・リアル=28.78円、1インド・ルピー=1.42円、1パキスタン・ルピー=0.65円、100インドネシア・ルピア=0.70円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.42円、1ブラジル・レアル=20.60円、1チェコ・コルナ=4.30円、100韓国・ウォン=8.87円、1オフショア・人民元=15.24円、1マレーシア・リングギット=24.67円、1南アフリカ・ランド=5.75円、1タイ・バーツ=3.32円、1ポーランド・ズロチ=25.87円、100ハンガリー・フォリント=33.19円、1ユーロ=117.27円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年4月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	44,437,160,354円
コ ー ル ・ ー ン 等	10,226,515,462
株 式(評価額)	26,646,081,119
新 株 予 約 権 証 券(評価額)	70,389
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	146,587,725
投 資 証 券(評価額)	37,464,933
未 収 入 金	4,380,252,971
未 収 配 当 金	76,766,082
差 入 委 託 証 拠 金	2,923,421,673
(B) 負 債	3,270,332,874
未 払 金	3,269,530,874
未 払 解 約 金	802,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	41,166,827,480
元 本	42,338,367,514
次 期 繰 越 損 益 金	△1,171,540,034
(D) 受 益 権 総 口 数	42,338,367,514口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	9,723円

(注1) 期首元本額 50,190,897,430円
追加設定元本額 64,986,905,142円
一部解約元本額 72,839,435,058円

(注2) 期末における元本の内訳
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金> 5,997,328,714円
D I A M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) 393,030,146円
M I T O ラップ型ファンド (安定型) 2,677,342円
M I T O ラップ型ファンド (中立型) 8,945,691円
M I T O ラップ型ファンド (積極型) 9,485,481円
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 38,313,785円
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 35,858,209円
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 14,497,885円
たわらノーロード 新興国株式 5,964,627,825円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け> 2,590,247,477円
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 954,882,697円
たわらノーロード バランス (堅実型) 9,026,402円
たわらノーロード バランス (標準型) 28,903,810円
たわらノーロード バランス (積極型) 45,281,993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) 505,018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) 73,928,655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) 147,066,610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) 116,857,099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) 176,423,651円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 503,710円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 2,231,992円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 1,222,251円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 3,159,650円

たわらノーロード 全世界株式 27,656,092円
One DC 新興国株式インデックスファンド 26,232,767円
マネックス資産設計ファンド エボリューション 441,719,912円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) 398,227,441円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) 400,152,689円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30) 712,425,282円
投資のソムリエ 12,196,710,455円
クルーズコントロール 530,462,496円
投資のソムリエ<DC年金> 1,153,569,344円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 363,111,843円
クルーズコントロール<DC年金> 603,694円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) 7,287,401円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) 19,375,965円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 423,849,540円
リスク抑制世界8資産バランスファンド 4,153,309,653円
ワールドアセットバランス (基本コース) 1,464,721,356円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 915,052,973円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 7,341,516円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 4,897,797円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 3,862,935円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 8,646,549円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 1,221,142,588円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 316,194,620円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 1,491,414円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 692,778円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 940,124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) 179,615,850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) 425,370,792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) 318,695,555円
期末元本合計 42,338,367,514円

■損益の状況

当期 自2019年4月19日 至2020年4月20日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		1,193,010,860円
受 取 配 当 金		1,146,643,739
受 取 利 息		32,304,661
そ の 他 収 益		14,298,303
支 払 利 息		△235,843
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		△9,582,484,591
売 買 益		3,981,906,152
売 買 損		△13,564,390,743
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益		△422,187,684
取 引 益		2,511,118,711
取 引 損		△2,933,306,395
(D) そ の 他 費 用		△98,691,954
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)		△8,910,353,369
(F) 前 期 繰 越 損 益 金		11,344,413,332
(G) 解 約 差 損 益 金		△7,282,491,255
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金		3,676,891,258
(I) 合 計(E + F + G + H)		△1,171,540,034
次 期 繰 越 損 益 金(I)		△1,171,540,034

(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12期（決算日 2020年4月20日）

（計算期間 2019年4月19日～2020年4月20日）

エマージング債券パッシブ・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	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。 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 (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
8期 (2016年4月18日)	17,120	△6.9%	81,716.02	△3.9%	96.5%	-	51,487 百万円
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
12期 (2020年4月20日)	19,435	1.2%	88,952.63	△5.0%	96.5%	-	78,076

(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）。

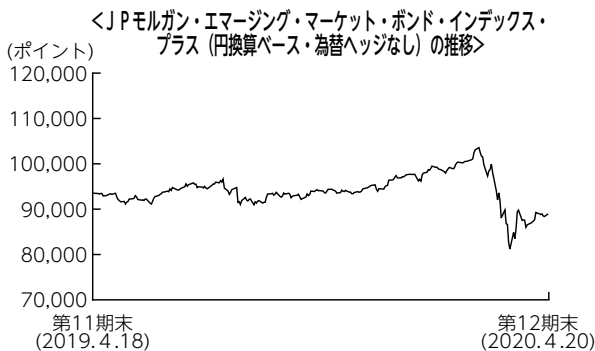
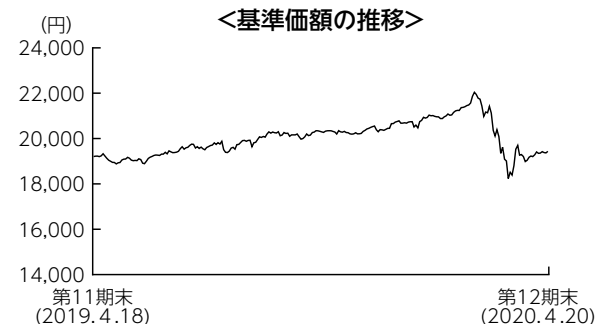
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		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) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2019 年 4 月 18 日	円 19,206	% -	ポイント 93,647.60	% -	% 97.5	% -
4 月 末	19,229	0.1	92,912.02	△0.8	96.7	-
5 月 末	19,071	△0.7	92,204.77	△1.5	96.5	-
6 月 末	19,439	1.2	94,614.26	1.0	96.0	-
7 月 末	19,755	2.9	95,975.11	2.5	96.3	-
8 月 末	20,076	4.5	91,872.88	△1.9	96.2	-
9 月 末	20,162	5.0	93,068.15	△0.6	96.2	-
10 月 末	20,287	5.6	93,980.92	0.4	97.6	-
11 月 末	20,526	6.9	95,246.45	1.7	98.0	-
12 月 末	20,744	8.0	97,704.58	4.3	96.6	-
2020 年 1 月 末	21,083	9.8	99,206.38	5.9	98.3	-
2 月 末	21,430	11.6	99,779.17	6.5	87.9	-
3 月 末	19,292	0.4	87,584.44	△6.5	113.2	-
(期 末) 2020 年 4 月 20 日	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5	-

(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（2019年4月19日から2020年4月20日まで）



た。しかしその後は新型コロナウイルスの感染拡大により経済の急速な悪化が懸念されたことより、急速な円高が進みました。期末にかけては感染拡大スピードの鈍化への期待から一部値を戻したものの、期を通じては円高米ドル安となりました。

基準価額の推移

当期末の基準価額は19,435円となり、前期末比で1.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国金利の低下や債券の利息収入を主因に、基準価額は上昇しました。

投資環境

新興国債券市場は下落しました。期初から2020年2月半ばにかけては概ね堅調に推移しました。しかしその後は新型コロナウイルスの感染拡大により経済の急速な悪化が懸念されたことや、OPEC（石油輸出国機構）プラスでの交渉が決裂し原油価格が急落したことなどを背景に、流動性の低下を伴いながら市場は大幅に下落しました。期末にかけては感染拡大スピードの鈍化への期待から一部値を戻しました。米国長期金利は低下し、対米国債スプレッドは大幅に拡大しました。

為替市場では、米ドルは対円で下落しました。期初から2020年2月にかけては、米国の堅調な経済状況、米中貿易問題などを背景に一進一退の展開となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである 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%	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%	-	

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%	4.9%	△4.9%
	ブラジル	10.0%	8.6%	1.4%
	メキシコ	15.3%	13.4%	1.9%
	パナマ	5.7%	3.9%	1.8%
	ペルー	4.6%	2.9%	1.7%
	コロンビア	9.2%	8.4%	0.8%
	計	44.7%	42.1%	2.7%
欧州	ハンガリー	4.1%	2.5%	1.6%
	ロシア	14.2%	11.6%	2.6%
	トルコ	0.0%	12.6%	△12.6%
	ウクライナ	0.0%	4.3%	△4.3%
	クロアチア	1.8%	1.1%	0.7%
	ルーマニア	3.5%	2.3%	1.2%
	計	23.6%	34.4%	△10.8%
アジア・オセアニア	インドネシア	13.8%	11.8%	2.1%
	フィリピン	8.8%	8.0%	0.8%
	計	22.6%	19.7%	2.9%
アフリカ	南アフリカ	5.6%	3.8%	1.8%
	計	5.6%	3.8%	1.8%
	現金など	3.5%	-	-
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5.0%下落しました。

当ファンドはベンチマークを6.2%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	0.011%
（保管費用）	(2)	(0.011)
（その他）	(0)	(0.000)
合 計	2	0.011

(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（20,018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（2019年4月19日から2020年4月20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
			1,892,513	2,183,380 (3,072)

(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（2019年4月19日から2020年4月20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 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 630,091	千アメリカ・ドル 698,504	千円 75,361,611	% 96.5	% 15.6	% 74.3	% 19.2	% 3.1
合 計	—	—	75,361,611	96.5	15.6	74.3	19.2	3.1

(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			評 価 額			償還年月日
	種 類	利 率	額 面 金 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 6.05 01/11/40	国債証券	6.0500	7,900	8,985	969,432		2040/01/11
BRAZIL 5.625 01/07/41	国債証券	5.6250	5,100	5,240	565,370		2041/01/07
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国債証券	4.6000	6,000	5,753	620,747		2046/01/23
BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	4.2500	10,100	10,567	1,140,087		2025/01/07
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	4,800	5,705	615,512		2026/01/29
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債証券	7.7500	4,100	6,026	650,156		2031/01/14
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	4,400	5,324	574,406		2044/01/22
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	国債証券	5.5500	6,400	6,995	754,719		2045/01/21
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	国債証券	4.6650	5,100	5,042	544,048		2024/01/17
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	国債証券	6.3750	2,600	3,531	381,025		2032/01/15
COLOMBIA 6.125 01/18/41	国債証券	6.1250	7,000	8,141	878,332		2041/01/18
INDONESIA 5.25 01/17/42	国債証券	5.2500	5,300	6,120	660,313		2042/01/17
INDONESIA 6.75 01/15/44	国債証券	6.7500	5,500	7,425	801,094		2044/01/15
BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	5.0000	6,800	6,534	705,039		2045/01/27
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	国債証券	4.3500	6,000	5,610	605,360		2047/01/15
INDONESIA 5.125 01/15/45	国債証券	5.1250	3,400	3,830	413,254		2045/01/15
INDONESIA 5.25 01/08/47	国債証券	5.2500	3,400	3,873	417,882		2047/01/08
INDONESIA 4.35 01/11/48	国債証券	4.3500	4,000	4,210	454,278		2048/01/11
BRAZIL 8.25 01/20/34	国債証券	8.2500	5,200	6,531	704,707		2034/01/20
PANAMA 6.7 01/26/36	国債証券	6.7000	6,900	8,354	901,369		2036/01/26
BRAZIL 7.125 01/20/37	国債証券	7.1250	6,300	7,424	801,034		2037/01/20
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	5,500	7,735	834,596		2038/01/17
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国債証券	3.9500	2,800	3,302	356,280		2040/01/20
INDONESIA 5.95 01/08/46	国債証券	5.9500	5,200	6,467	697,758		2046/01/08
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	3.6000	5,200	5,259	567,418		2025/01/30
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	国債証券	5.0000	2,800	3,554	383,456		2037/01/13
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	6,800	7,093	765,306		2025/01/15
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	5,000	5,312	573,147		2027/01/08
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	国債証券	3.7500	3,000	3,417	368,694		2029/01/14
ROMANIA 4.875 01/22/24	国債証券	4.8750	3,600	3,836	413,960		2024/01/22
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	6,000	6,236	672,829		2026/01/28
CROATIA 6.0 01/26/24	国債証券	6.0000	5,400	6,012	648,664		2024/01/26

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	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	国債証券	4.1250	7,000	7,175	774,110	2026/01/21
INDONESIA 5.875 01/15/24	国債証券	5.8750	5,200	5,714	616,540	2024/01/15
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	6,800	7,390	797,360	2026/01/08
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国債証券	4.2000	4,800	5,193	560,336	2024/01/21
BRAZIL 2.625 01/05/23	国債証券	2.6250	4,800	4,852	523,568	2023/01/05
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	6,800	7,182	774,919	2028/01/13
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	国債証券	3.7500	5,200	5,120	552,472	2028/01/11
INDONESIA 3.5 01/11/28	国債証券	3.5000	4,200	4,255	459,164	2028/01/11
PANAMA 3.16 01/23/30	国債証券	3.1600	5,000	4,919	530,764	2030/01/23
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国債証券	4.5000	6,000	5,655	610,182	2050/01/31
BRAZIL 8.75 02/04/25	国債証券	8.7500	3,800	4,643	500,998	2025/02/04
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国債証券	3.7000	6,000	7,031	758,670	2042/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	国債証券	4.6000	6,400	6,208	669,781	2048/02/10
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国債証券	9.5000	5,800	9,236	996,513	2030/02/02
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国債証券	5.6250	4,000	4,450	480,110	2044/02/26
ROMANIA 6.75 02/07/22	国債証券	6.7500	7,500	7,988	861,828	2022/02/07
INDONESIA 5.35 02/11/49	国債証券	5.3500	3,000	3,563	384,424	2049/02/11
BRAZIL 5.625 02/21/47	国債証券	5.6250	6,600	6,864	740,556	2047/02/21
COLOMBIA 4.0 02/26/24	国債証券	4.0000	6,100	6,238	673,061	2024/02/26
INDONESIA 4.75 02/11/29	国債証券	4.7500	4,000	4,411	475,966	2029/02/11
HUNGARY 5.375 02/21/23	国債証券	5.3750	6,358	6,896	744,038	2023/02/21
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	国債証券	3.0000	5,000	5,373	579,735	2028/02/01
PANAMA 3.875 03/17/28	国債証券	3.8750	2,100	2,231	240,729	2028/03/17
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	7.5000	9,853	11,135	1,201,448	2030/03/31
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	4.7500	8,400	8,244	889,518	2044/03/08
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	国債証券	4.3750	8,400	9,282	1,001,480	2029/03/21
COLOMBIA 4.5 03/15/29	国債証券	4.5000	5,000	5,193	560,278	2029/03/15
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	国債証券	5.5000	5,600	6,569	708,741	2026/03/30
PERU 6.55 03/14/37	国債証券	6.5500	8,000	11,095	1,197,061	2037/03/14
HUNGARY 7.625 03/29/41	国債証券	7.6250	5,000	8,157	880,074	2041/03/29
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	国債証券	3.7000	5,000	5,836	629,722	2041/03/01
HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	5.3750	6,380	7,112	767,400	2024/03/25
PANAMA 3.75 03/16/25	国債証券	3.7500	4,200	4,383	472,960	2025/03/16
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	国債証券	3.6250	5,900	5,947	641,649	2022/03/15
COLOMBIA 2.625 03/15/23	国債証券	2.6250	3,700	3,639	392,706	2023/03/15
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国債証券	4.1500	8,400	8,526	919,870	2027/03/28
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	5.1000	10,000	11,845	1,278,026	2035/03/28
PANAMA 4.5 04/16/50	国債証券	4.5000	6,300	6,811	734,933	2050/04/16
PANAMA 9.375 04/01/29	国債証券	9.3750	3,900	5,415	584,258	2029/04/01
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	5.6250	9,000	11,373	1,227,113	2042/04/04
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国債証券	4.5000	8,000	8,184	882,980	2029/04/22
INDONESIA 4.625 04/15/43	国債証券	4.6250	4,400	4,714	508,603	2043/04/15
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	国債証券	4.5000	5,800	6,086	656,662	2022/04/04
COLOMBIA 3.875 04/25/27	国債証券	3.8750	4,600	4,609	497,286	2027/04/25
CROATIA 5.5 04/04/23	国債証券	5.5000	6,400	6,899	744,349	2023/04/04
INDONESIA 3.375 04/15/23	国債証券	3.3750	5,700	5,777	623,328	2023/04/15
INDONESIA 4.1 04/24/28	国債証券	4.1000	5,000	5,255	567,051	2028/04/24
BRAZIL 6.0 04/07/26	国債証券	6.0000	6,800	7,694	830,127	2026/04/07
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	5,400	5,094	549,659	2026/04/14
COLOMBIA 8.125 05/21/24	国債証券	8.1250	4,900	5,645	609,070	2024/05/21
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	国債証券	5.8750	3,000	3,091	333,594	2022/05/30
PANAMA 4.5 05/15/47	国債証券	4.5000	3,000	3,233	348,853	2047/05/15

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		千円	
				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			
COLOMBIA 5.2 05/15/49	国債証券	5.2000	3,000	3,171	342,151		2049/05/15
INDONESIA 4.875 05/05/21	国債証券	4.8750	1,100	1,121	121,046		2021/05/05
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	4.7500	10,400	11,491	1,239,867		2026/05/27
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	5,000	5,119	552,288		2029/05/30
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	6,400	5,999	647,243		2030/06/22
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	8,000	8,360	901,960		2045/06/15
ROMANIA 5.125 06/15/48	国債証券	5.1250	3,600	3,964	427,776		2048/06/15
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	国債証券	6.3000	3,000	2,551	275,310		2048/06/22
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	5.2500	16,000	19,895	2,146,517		2047/06/23
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	国債証券	4.2500	6,400	6,932	747,953		2027/06/23
PERU 2.844 06/20/30	国債証券	2.8440	3,000	3,081	332,447		2030/06/20
PERU 7.35 07/21/25	国債証券	7.3500	4,300	5,306	572,485		2025/07/21
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	国債証券	5.3750	2,800	2,233	240,918		2044/07/24
COLOMBIA 4.375 07/12/21	国債証券	4.3750	1,200	1,221	131,766		2021/07/12
INDONESIA 3.85 07/18/27	国債証券	3.8500	2,600	2,657	286,685		2027/07/18
PERU 4.125 08/25/27	国債証券	4.1250	4,300	4,815	519,501		2027/08/25
ROMANIA 4.375 08/22/23	国債証券	4.3750	4,000	4,173	450,261		2023/08/22
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	7,200	7,213	778,264		2025/09/16
COLOMBIA 7.375 09/18/37	国債証券	7.3750	7,400	9,435	1,017,942		2037/09/18
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債証券	6.7500	5,200	6,386	689,054		2034/09/27
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	国債証券	5.6500	3,200	2,560	276,198		2047/09/27
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	国債証券	5.8750	5,200	6,815	735,324		2043/09/16
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	国債証券	4.8750	7,400	8,099	873,877		2023/09/16
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	3,000	3,030	326,912		2029/09/18
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	5,800	5,800	625,762		2110/10/12
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	3,000	4,290	462,869		2034/10/23
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	5,200	4,499	485,439		2028/10/12
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	国債証券	5.0000	2,800	2,172	234,350		2046/10/12
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	4.0000	10,500	10,708	1,155,303		2023/10/02
PERU 5.625 11/18/50	国債証券	5.6250	6,000	8,685	937,024		2050/11/18
HUNGARY 5.75 11/22/23	国債証券	5.7500	7,000	7,805	842,171		2023/11/22
合 計	-	-	630,091	698,504	75,361,611		-

■投資信託財産の構成

2020年4月20日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	
公社債	千円	%	
	75,361,611	92.3	
コール・ローン等、その他	6,251,585	7.7	
投資信託財産総額	81,613,197	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、77,837,248千円、95.4％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4月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.89円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年4月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	81,763,127,639円
コ ー ン 等	5,541,931,170
公 社 債(評価額)	75,361,611,549
未 収 入 金	149,930,510
未 収 利 息	410,434,211
前 払 費 用	299,220,199
(B) 負 債	3,686,629,884
未 払 金	3,686,629,884
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	78,076,497,755
元 本	40,172,815,072
次 期 繰 越 損 益 金	37,903,682,683
(D) 受 益 権 総 口 数	40,172,815,072口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,435円

(注1) 期首元本額 56,267,402,909円
 追加設定元本額 112,332,882,393円
 一部解約元本額 128,427,470,230円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インテックスファンド<為替ヘッジなし>	173,461,180円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	473,693,319円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,045,374円
たわらノーロード バランス(標準型)	84,140,453円
たわらノーロード バランス(積極型)	33,845,192円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	458,070円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,670,703円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,110,027円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	724,523円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	895,956円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	44,240,071円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	196,333,833円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	203,727,538円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	376,267,256円
投資のソムリエ	6,002,310,971円
クルーズコントロール	262,178,890円
投資のソムリエ<DC年金>	567,776,156円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	171,006,640円
クルーズコントロール<DC年金>	298,079円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,431,478円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,833,238円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	208,860,582円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,045,144,801円
ワールドアセットバランス(基本コース)	843,793,149円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	490,833,333円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,648,741円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	5,104,195円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,898,446円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	14,907,075円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	759,646,337円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	149,816,429円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,555,458円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	692,951円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	982,107円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	16,090,592,717円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,671,308,252円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	81,643,341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)	200,321,526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)	150,049,889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)	4,026,245,071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)	3,787,321,725円
期末元本合計	40,172,815,072円

■損益の状況

当期 自2019年4月19日 至2020年4月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,757,865,707円
受 取 利 息	4,759,051,096
支 払 利 息	△1,185,389
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,962,675,660
売 買 損 益	10,342,537,916
売 買 損 益	△8,379,862,256
(C) そ の 他 費 用	△11,820,297
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	6,708,721,070
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	51,799,208,886
(F) 解 約 差 損 益 金	△131,569,630,080
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	110,965,382,807
(H) 合 計(D+E+F+G)	37,903,682,683
次 期 繰 越 損 益 金(H)	37,903,682,683

(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14期（決算日 2020年6月8日）

（計算期間 2019年6月7日～2020年6月8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14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。 外貨建資産への投資は行いません。 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 組入比率	不動産 投信先物 指数比率	純資産 総額
	円	騰落率	(配当込み) ポイント (ベンチマーク)	騰落率			
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
14期（2020年6月8日）	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885

（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（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・ノウハウおよび東証R E I T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（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）。

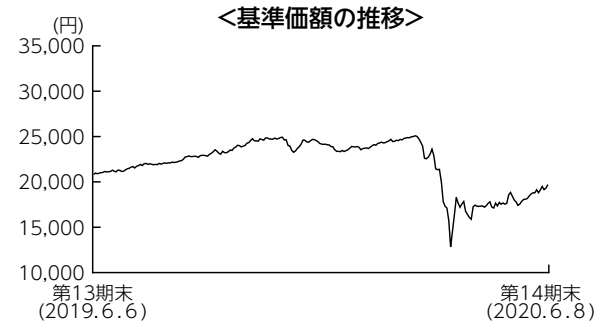
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数 (配当込み) (ベンチマーク)		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019 年 6 月 6 日	円	%	ポイント	%	%	%
	20,819	-	3,880.89	-	97.4	2.0
6 月 末	21,175	1.7	3,947.76	1.7	97.3	2.0
7 月 末	22,095	6.1	4,120.33	6.2	97.5	2.0
8 月 末	22,923	10.1	4,275.94	10.2	95.5	2.1
9 月 末	23,999	15.3	4,477.77	15.4	98.0	1.9
10 月 末	24,790	19.1	4,625.77	19.2	97.9	1.7
11 月 末	24,562	18.0	4,584.30	18.1	97.0	2.5
12 月 末	23,846	14.5	4,450.34	14.7	96.8	3.2
2020 年 1 月 末	24,694	18.6	4,608.85	18.8	96.4	3.1
2 月 末	22,604	8.6	4,218.40	8.7	96.7	3.7
3 月 末	17,835	△14.3	3,343.59	△13.8	95.2	4.2
4 月 末	17,672	△15.1	3,313.25	△14.6	95.8	4.0
5 月 末	19,122	△8.2	3,586.37	△7.6	95.1	2.3
(期 末) 2020 年 6 月 8 日	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2

(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（2019年6月7日から2020年6月8日まで）



基準価額の推移

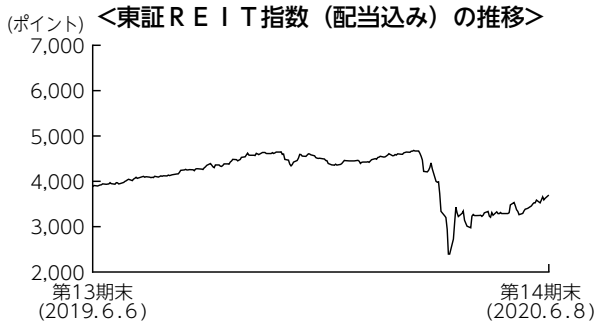
当期末の基準価額は19,706円となり、前期末比で5.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染拡大によって経済活動の長期的な停滞が懸念されたことから東証REIT指数（配当込み）が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。

投資環境

リート市場は下落しました。国内長期金利がマイナス圏で推移する環境下において、インカムゲインや賃貸収益の相対的な安定性などが注目され、リート市場は2020年2月半ばまでは堅調に推移しました。しかしその後は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大によって経済の長期的な活動停滞が意識されたことなどから大幅な調整となりました。期末にかけては感染者数のピークアウト観測とそれに伴う経済活動再開への期待などから、やや値を戻しました。



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、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

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4.7%下落しました。
当ファンドはベンチマークを0.6%下回りました。主に資金流出・流入に伴う売買タイミング効果がマイナス寄与となりました。

今後の運用方針

引き続き、リートの実質組入比率を高め、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。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 (先物・オプション)	1円 (0)	0.005% (0.001)
(投資証券)	(1)	(0.004)
合 計	1	0.005

(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(21,974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 (2019年6月7日から2020年6月8日まで)

(1) 投資証券

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
国内		千口		千円		千口		千円
エスコンジャパンリート投資法人		0.694		78,511		0.494		56,843
		(-)		(-)		(-)		(-)
サンケイリアルエステート投資法人		0.959		108,388		0.641		75,243
		(-)		(-)		(-)		(-)
S O S I L A 物流リート投資法人		1.454		178,686		0.451		53,367
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本アコモデーションファンド投資法人		1.945		1,283,849		1.575		1,037,603
		(-)		(-)		(-)		(-)
MCUBS MidCity投資法人		7.826		798,456		5.87		638,448
		(-)		(-)		(-)		(-)
森ヒルズリート投資法人		6.747		1,074,135		5.456		901,082
		(-)		(-)		(-)		(-)
産業ファンド投資法人		7.589		1,194,291		5.952		940,844
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・レジデンス投資法人		5.62		1,903,703		4.655		1,560,793
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		3.739		717,657		2.897		566,598
		(-)		(-)		(-)		(-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人		2.943		1,351,818		2.468		1,242,027
		(-)		(-)		(-)		(-)
GLP投資法人		14.62		2,012,239		11.809		1,621,762
		(-)		(-)		(-)		(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		2.493		827,143		1.939		640,160
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プロロジスリート投資法人		9.179		2,642,474		6.952		2,004,618
		(-)		(-)		(-)		(-)
星野リゾート・リート投資法人		0.889		432,757		0.72		372,007
		(-)		(-)		(-)		(-)
Oneリート投資法人		0.943		276,615		0.735		230,897
		(-)		(-)		(-)		(-)
イオンリート投資法人		6.418		838,465		5.04		683,476
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヒューリックリート投資法人		5.068		854,401		3.98		730,266
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本リート投資法人		1.91		777,302		1.542		676,121
		(-)		(-)		(-)		(-)
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		38.655		716,493		30.397		606,258
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ヘルスケア投資法人		0.187		36,915		0.208		41,494
		(△0.134)		(-)		(-)		(-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
		千□		千円		千□		千円
積水ハウス・リート投資法人		18.285		1,500,651		13.869		1,198,341
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		1.28		152,949		0.953		118,022
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		2.293		542,103		1.797		449,650
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		1.261		160,290		1.011		130,109
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		1.176		126,537		0.953		103,349
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		18.915		3,127,691		14.931		2,618,960
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		0.968		96,912		0.815		90,763
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールロジポート投資法人		5.695		882,627		4.31		667,682
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		2.011		208,497		1.569		168,854
		(-)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		0.588		67,449		0.436		51,651
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		1.63		743,300		1.171		524,406
		(-)		(-)		(-)		(-)
大江戸温泉リート投資法人		1.023		80,558		0.806		67,601
		(-)		(-)		(-)		(-)
さくら総合リート投資法人		1.267		110,185		1.026		92,444
		(-)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		6.691		339,317		5.224		284,934
		(-)		(-)		(-)		(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人		1.37		164,420		1.109		145,950
		(-)		(-)		(-)		(-)
三菱地所物流リート投資法人		1.41		490,949		0.882		310,121
		(-)		(-)		(-)		(-)
CREロジスティクスファンド投資法人		1.264		172,540		0.757		101,193
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		1.015		121,029		0.674		84,013
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		2.026		219,458		1.256		142,259
		(-)		(-)		(-)		(-)
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		1.201		143,773		0.789		90,268
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		5.672		4,258,557		4.596		3,618,271
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		5.857		3,959,078		4.746		3,348,037
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本リテールファンド投資法人		11.064		2,085,733		8.963		1,883,767
		(-)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		11.665		2,238,866		9.45		1,986,628
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		3.738		1,579,658		2.926		1,339,072
		(-)		(-)		(-)		(-)
プレミア投資法人		5.297		731,688		4.455		652,209
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		3.925		704,998		3.18		602,261
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		4.075		501,490		3.294		432,153
		(-)		(-)		(-)		(-)
ユナイテッド・アーバン投資法人		13.22		2,210,571		10.59		1,927,307
		(-)		(-)		(-)		(-)

	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	4.183 (-)	694,282 (-)	3.389 (-)	608,142 (-)
インヴィンシブル投資法人	28.656 (-)	1,420,494 (-)	20.604 (-)	1,098,856 (-)
フロンティア不動産投資法人	2.116 (-)	853,912 (-)	1.67 (-)	712,368 (-)
平和不動産リート投資法人	3.63 (-)	442,689 (-)	2.938 (-)	381,136 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	3.825 (-)	1,029,815 (-)	3.099 (-)	820,314 (-)
福岡リート投資法人	3.028 (-)	471,287 (-)	2.454 (-)	411,933 (-)
ケネディクス・オフィス投資法人	1.809 (-)	1,307,162 (-)	1.466 (-)	1,135,391 (-)
いちごオフィスリート投資法人	4.547 (-)	425,261 (-)	3.874 (-)	400,638 (-)
大和証券オフィス投資法人	1.347 (-)	996,835 (-)	1.09 (-)	856,201 (-)
阪急阪神リート投資法人	2.648 (-)	394,924 (-)	2.141 (-)	335,407 (-)
スターツプロシード投資法人	0.912 (-)	178,201 (-)	0.739 (-)	143,469 (-)
大和ハウスリート投資法人	8.372 (-)	2,330,991 (-)	6.497 (-)	1,826,074 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	18.808 (-)	1,202,296 (-)	15.219 (-)	1,109,795 (-)
大和証券リビング投資法人	6.803 (0.2747)	662,988 (-)	5.38 (-)	527,153 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	5.408 (-)	841,467 (-)	4.28 (-)	719,027 (-)

(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	4,360	3,988	-	-

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2019年6月7日から2020年6月8日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 59,078	百万円 1,343	% 2.3	百万円 48,996	百万円 414	% 0.8

(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 2,020

(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)	1,798千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	136千円
(B) / (A)	7.6%

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	評 価 額	比 率
不動産ファンド			千□		千□	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人		0.348		0.548		59,622	0.1
サンケイリアルエステート投資法人		0.335		0.653		67,781	0.2
S O S I L A 物流リート投資法人		—		1.003		128,484	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人		1.127		1.497		928,140	2.2
MCUBS MidCity 投資法人		3.823		5.779		534,557	1.3
森ヒルズリート投資法人		3.891		5.182		756,053	1.8
産業ファンド投資法人		4.164		5.801		925,839	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人		3.307		4.272		1,337,136	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		2.097		2.939		521,378	1.2
アクティビア・プロパティーズ投資法人		1.782		2.257		940,040	2.2
GLP 投資法人		8.407		11.218		1,563,789	3.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		1.407		1.961		602,027	1.4
日本プロロジスリート投資法人		4.551		6.778		1,957,486	4.7
星野リゾート・リート投資法人		0.516		0.685		325,375	0.8
One リート投資法人		0.494		0.702		195,577	0.5
イオンリート投資法人		3.483		4.861		587,694	1.4
ヒューリックリート投資法人		2.743		3.831		571,202	1.4
日本リート投資法人		1.095		1.463		574,227	1.4
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		20.679		28.937		469,936	1.1
日本ヘルスケア投資法人		0.155		—		—	—
積水ハウス・リート投資法人		8.754		13.17		953,508	2.3
トーセイ・リート投資法人		0.653		0.98		106,232	0.3
ケネディクス商業リート投資法人		1.244		1.74		365,574	0.9
ヘルスケア&メディカル投資法人		0.711		0.961		119,067	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		0.679		0.902		95,431	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人		10.557		14.541		2,144,797	5.1
いちごホテルリート投資法人		0.593		0.746		57,815	0.1
ラサールロジポート投資法人		2.803		4.188		653,328	1.6
スターアジア不動産投資法人		1.053		1.495		143,370	0.3
マリモ地方創生リート投資法人		0.292		0.444		51,637	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.823		1.282		567,926	1.4
大江戸温泉リート投資法人		0.548		0.765		55,309	0.1
さくら総合リート投資法人		0.734		0.975		80,925	0.2
投資法人みらい		3.655		5.122		215,380	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		0.796		1.057		115,213	0.3
三菱地所物流リート投資法人		0.359		0.887		343,712	0.8
CRE ロジスティクスファンド投資法人		0.34		0.847		123,746	0.3

銘	柄	期首(前期末) 当 期 末				
		□ 数	□ 数	評 価 額	比 率	
不動産ファンド		千□	千□	千円	%	
ザイマックス・リート投資法人		0.313	0.654	67,689	0.2	
タカラレーベン不動産投資法人		0.508	1.278	124,349	0.3	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		0.525	0.937	121,435	0.3	
日本ビルファンド投資法人		3.286	4.362	2,961,798	7.1	
ジャパンリアルエステイト投資法人		3.393	4.504	2,675,376	6.4	
日本リートファンド投資法人		6.412	8.513	1,390,172	3.3	
オリックス不動産投資法人		6.76	8.975	1,528,442	3.6	
日本プライムリアルティ投資法人		2.148	2.96	1,090,760	2.6	
プレミア投資法人		3.226	4.068	501,991	1.2	
東急リアル・エステート投資法人		2.275	3.02	488,636	1.2	
グローバル・ワン不動産投資法人		2.347	3.128	333,757	0.8	
ユナイテッド・アーバン投資法人		7.483	10.113	1,337,949	3.2	
森トラスト総合リート投資法人		2.425	3.219	461,282	1.1	
インヴィンシブル投資法人		11.705	19.757	646,053	1.5	
フロンティア不動産投資法人		1.154	1.6	590,400	1.4	
平和不動産リート投資法人		2.113	2.805	310,233	0.7	
日本ロジスティクスファンド投資法人		2.217	2.943	799,907	1.9	
福岡リート投資法人		1.755	2.329	326,525	0.8	
ケネディクス・オフィス投資法人		1.05	1.393	877,590	2.1	
いちごオフィスリート投資法人		2.815	3.488	277,296	0.7	
大和証券オフィス投資法人		0.783	1.04	665,600	1.6	
阪急阪神リート投資法人		1.527	2.034	293,099	0.7	
スターツプロシード投資法人		0.528	0.701	137,676	0.3	
大和ハウスリート投資法人		4.552	6.427	1,696,728	4.1	
ジャパン・ホテル・リート投資法人		10.921	14.51	761,775	1.8	
大和証券リビング投資法人		3.816	5.5137	519,941	1.2	
ジャパンエクセレント投資法人		3.038	4.166	591,155	1.4	
合 計		□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	188.073	264.9067	40,816,947	—
			63銘柄<97.4%>	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、森トラスト総合リート投資法人、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、いちごオフィスリート投資法人、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、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、大和証券リビング投資法人、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 918		百万円 -

■投資信託財産の構成

2020年6月8日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
投 資 証 券	千円 40,816,947		% 96.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,515,626		3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	42,332,574		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

(2020年6月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	42,324,055,564円
コ ー ル ・ オ ー ン 等	1,105,968,618
投 資 証 券(評価額)	40,816,947,390
未 収 配 当 金	232,381,556
差 入 委 託 証 拠 金	168,758,000
(B) 負 債	438,630,629
未 払 金	359,442,629
未 払 解 約 金	79,188,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	41,885,424,935
元 本	21,254,723,982
次 期 繰 越 損 益 金	20,630,700,953
(D) 受 益 権 総 口 数	21,254,723,982口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	19,706円

(注1) 期首元本額 15,925,100,033円
 追加設定元本額 30,805,671,386円
 一部解約元本額 25,476,047,437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)	378,112円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	1,260,208円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	1,373,413円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	5,249,258円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	5,059,919円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	2,113,621円
たわらノーロード 国内リート	4,034,155,990円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	828,210,372円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	562,774,380円
たわらノーロード バランス (堅実型)	10,362,413円
たわらノーロード バランス (標準型)	175,375,202円
たわらノーロード バランス (積極型)	186,907,069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)	36,161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)	88,708,399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)	185,931,782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)	95,606,399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)	125,781,991円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,926,307円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	4,996,228円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,339,844円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	4,792,268円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	11,809,922円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	350,338,871円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	3,701,541円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	121,041,592円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	128,721,045円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	239,546,187円
投資のソムリエ	4,346,070,011円
投資のソムリエ<DC年金>	418,407,821円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	116,385,910円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	74,908,386円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	712,976,935円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	3,414,068円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	2,226,970円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	705,693円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	6,837,068円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	250,709,200円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	97,804,648円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	700,875円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	338,327円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	416,395円
Jリートインデックスファンド (DC)	29,728,113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)	85,845,471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)	770,936,665円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	15,173,792円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4	251,633,545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)	5,344,010,922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)	22,413,044円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	20,179,566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)	1,504,402,063円
期末元本合計	21,254,723,982円

■損益の状況

当期 自2019年6月7日 至2020年6月8日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	1,343,772,418円	
	受取配当金	1,344,616,071	
	その他の収益	664	
	支払利息	△844,317	
(B)	有価証券売買損益	△1,541,778,841	
	売買益	3,261,141,332	
	売買損	△4,802,920,173	
(C)	先物取引等取引損益	△124,557,762	
	取引益	118,876,708	
	取引損	△243,434,470	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△322,564,185	
(E)	前期繰越損益金	17,228,908,223	
(F)	解約差損益金	△31,414,095,699	
(G)	追加信託差損益金	35,138,452,614	
(H)	計(D+E+F+G)	20,630,700,953	
	次期繰越損益金(H)	20,630,700,953	

(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) (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。

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13期（決算日 2020年6月22日）

（対象期間 2019年6月25日～2020年6月22日）

外国リート・パッシブ・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	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。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 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 （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額 総
	円	騰落率	ポイント	騰落率		
9期(2016年6月22日)	10,906	△5.6	108,051.29	△4.8	99.6	百万円 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
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	34,753

（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（「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・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズ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（以下同じ）。

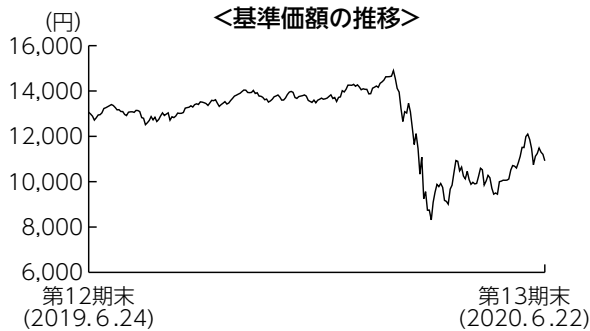
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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 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)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率	
(期 首) 2019年 6月 24日	円 13,060	% -	ポイント 131,885.51	% -	% 99.2
6 月 末	12,817	△1.9	129,636.53	△1.7	99.3
7 月 末	13,137	0.6	132,945.01	0.8	99.5
8 月 末	13,026	△0.3	132,025.50	0.1	99.3
9 月 末	13,574	3.9	137,663.18	4.4	99.7
10 月 末	14,027	7.4	142,261.33	7.9	99.6
11 月 末	13,981	7.1	141,938.55	7.6	99.5
12 月 末	13,831	5.9	140,439.63	6.5	99.8
2020年 1 月 末	14,072	7.7	143,073.05	8.5	99.4
2 月 末	13,225	1.3	134,573.20	2.0	99.3
3 月 末	9,920	△24.0	100,830.59	△23.5	108.2
4 月 末	10,594	△18.9	107,670.68	△18.4	99.4
5 月 末	10,687	△18.2	108,781.24	△17.5	98.9
(期 末) 2020年 6月 22日	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過 (2019年6月25日から2020年6月22日まで)



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,922円となり、前期末比で16.4%下落しました。

基準価額の主な変動要因

外国リート市場は2020年2月までは堅調に推移しましたが、新型コロナウイルスの影響からほとんどの外国リート市場が下落したことに加え、為替市場においても多くの通貨が対円で下落し円高となったことから、当ファンドの基準価額は下落しました。



投資環境

外国リート市場は米国の堅調な企業業績や長期金利の低下などに加え、欧州の低金利環境の長期化期待などを背景に堅調に推移しました。しかしながら2020年2月下旬以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大の影響から、景気悪化懸念が広がり大きく下落しました。3月下旬以降は反発局面となり、ワクチン開発や経済活動再開への期待などから値を戻しましたが、前期末比では下落して期末を迎えました。

為替市場では、米国の緊急利下げを受けた米長期金利の低下や、新型コロナウイルスの感染拡大や原油価

格の急落を背景としたリスク回避姿勢の強まりなどから、2020年2月後半から3月にかけて急速に円高米ドル安が進行しました。その後は世界的な米ドル資金需要の高まりなどから円安米ドル高に転じたものの、米中関係悪化への警戒感や経済活動の再開期待などの材料が交錯し、方向感のない展開となりました。ユーロやオーストラリアドルは対円で下落しました。

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15.7%下落しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.7%下回りました。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	4円	0.029%
(株 式)	(0)	(0.000)
(投資信託受益証券)	(1)	(0.004)
(投 資 証 券)	(3)	(0.025)
(b) 有価証券取引税	11	0.089
(株 式)	(0)	(0.000)
(投資信託受益証券)	(1)	(0.007)
(投 資 証 券)	(10)	(0.082)
(c) その他費用	11	0.089
(保 管 費 用)	(8)	(0.065)
(そ の 他)	(3)	(0.023)
合 計	26	0.206

(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(12,607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 (2019年6月25日から2020年6月22日まで)

(1) 株 式

		買		付		売		付	
		株 数	金 額	株 数	金 額	株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
	メ	(54.72)	(23)	54.72	23	54.72	23	54.72	23
国	カ	百株	千カナダ・ドル	百株	千カナダ・ドル	百株	千カナダ・ドル	百株	千カナダ・ドル
	ナ	375.48 (△300.48)	778 (△622)	75	150	75	150	75	150
国	イ	百株	千イギリス・ポンド	百株	千イギリス・ポンド	百株	千イギリス・ポンド	百株	千イギリス・ポンド
	ギ	1,617.4 (△1,617.4)	272 (△272)	—	—	—	—	—	—

(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 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
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	73.928	11,463	76.572	11,808
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER'S INC.	1.125	358	1.873	627
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	86.436	10,458	98.391	12,783
	(-)	(-)	(-)	(-)
CEDAR REALTY TRUST INC	-	-	13.618	28
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	131.917	4,969	139.652	5,500
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	88.054	4,207	95.639	4,844
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGREE REALTY CORP	29.369	2,060	26.556	1,922
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRT APARTMENTS CORP	2.662	23	1.643	20
	(-)	(-)	(-)	(-)
SL GREEN	49.19	3,623	56.479	4,490
	(-)	(-)	(-)	(-)
EPR PROPERTIES	45.41	2,713	49.043	3,192
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	408.022	36,004	440.532	37,743
	(29.908)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	83.024	16,378	90.526	18,837
	(-)	(-)	(-)	(-)
LEXINGTON REALTY TRUST	162.849	1,717	157.874	1,643
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	57.666	5,939	63.038	6,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES	23.633	35	56.01	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
MACK CALI	49.145	971	53.629	1,130
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	70.773	42,253	44.549	26,556
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	100.587	4,881	106.58	5,673
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	88.188	3,112	96.175	3,535
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12.153	228	13.988	292
	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	84.8	987	89.542	1,180
	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	218.861	7,514	236.704	7,988
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	-	-	16.616	16
	(-)	(△1)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	39.249	11,570	43.183	13,034
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
EQUITY RESIDENTIAL	210.388	16,421	237.678	19,153
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	42.161	4,821	47.542	5,932
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	76.565	3,005	83.109	3,281
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	306.271	9,782	316.293	10,581
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	72	2,376	78.964	2,535
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	82.569	2,690	86.449	2,936
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	61.61	2,662	66.887	3,049
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	96.829	1,819	104.784	2,192
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	250.339	18,654	263.961	20,978
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	22.447	2,763	23.745	2,991
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	250.151	4,212	273.213	5,095
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	61.466	4,563	65.772	5,075
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	21.849	958	24.506	1,130
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	119.252	781	129.607	945
	(-)	(△20)	(-)	(-)
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	55.618	766	60.721	856
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIBERTY PROPERTY TRUST	46.169	2,455	54.232	2,981
	(△44.309)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	100.925	1,368	113.101	1,614
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	169.513	5,100	185.077	5,762
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	63.048	1,331	66.591	1,646
	(1.071)	(7)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	87.478	7,192	98.056	8,140
	(32.371)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	47.569	1,067	51.181	1,271
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	434.49	6,517	488.254	7,647
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	67.88	8,583	74.2	9,722
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.498	79	10.813	130
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	25.284	1,861	27.542	2,205
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	5.235	354	6.222	434
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6.257	134	5.415	133
	(-)	(-)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12.862	72	22.034	66
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	19.05	567	21.286	640
	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	11.546	1,867	12.745	2,099
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	40.466	433	42.706	549
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	202.236	13,940	208.241	15,454
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	98.518	5,651	107.912	6,701
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	173.701	7,815	184.094	8,613
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	65.084	1,825	71.223	1,979
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORECIVIC INC	65.815	976	71.543	1,121
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	4.939	208	5.572	250
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	184.467	21,981	202.343	27,263
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	28.387	2,908	30.792	3,293
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	89.863	20,060	97.998	22,163
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	57.468	8,396	58.908	9,011
	(-)	(-)	(-)	(-)
TAUBMAN CENTERS INC	35.202	1,335	38.855	1,648
	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER FACTORY OUTLET	52.498	635	56.596	759
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	14.648	202	16.547	225
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14.099	275	14.855	294
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7.254	781	8.149	874
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	223.063	12,254	238.823	14,008
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	94.048	5,277	108.239	6,403
	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON REIT	44.537	1,197	48.263	1,354
	(-)	(-)	(-)	(-)
GEO GROUP INC	63.788	953	69.573	1,086
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
WEINGARTEN REALTY INVST	68.934	1,737	75.901	2,131
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	83.828	3,572	91.849	4,183
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	47.055	679	52.461	859
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	77.018	8,245	83.912	9,070
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	53.217	380	60.653	464
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	131.125	1,569	146.164	1,789
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	115.577	3,589	124.502	4,001
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	144.286	19,233	138.559	17,511
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	109.905	938	123.184	1,171
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	339.568	6,534	319.53	6,489
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	98.615	3,793	107.284	4,359
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	64.15	963	70.93	1,190
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	71.787	1,444	79.357	1,672
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	59.549	579	67.1	700
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	39.84	2,132	41.774	2,256
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	29.638	1,233	28.36	1,248
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	98.079	1,396	111.376	1,675
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	120.456	4,221	126.131	4,299
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	23.102	2,726	24.083	2,693
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	642.088	5,345	665.444	6,002
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHESAPEAKE LODGING TRUST	5.02	130	5.642	149
	(△20.497)	(△574)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	74.195	1,611	82.327	1,895
	(-)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	27.891	825	31.223	937
	(-)	(-)	(-)	(-)
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	19.153	197	20.73	228
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	20.564	260	22.718	345
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
SABRA HEALTH CARE REIT INC	115.26 (-)	2,185 (-)	118.283 (-)	2,366 (-)
WHITESTONE REIT	14.96 (-)	136 (-)	16.906 (-)	197 (-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	92.814 (-)	2,918 (-)	102.019 (-)	3,404 (-)
STAG INDUSTRIAL INC	86.007 (-)	2,504 (-)	84.975 (-)	2,482 (-)
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	120.216 (-)	1,234 (-)	130.353 (-)	1,532 (-)
CYRUSONE INC	70.15 (-)	4,834 (-)	74.521 (-)	4,859 (-)
WP CAREY INC	102.444 (-)	8,117 (-)	111.607 (-)	9,235 (-)
GLADSTONE LAND CORP	10.297 (-)	127 (-)	8.362 (-)	106 (-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	125.796 (-)	3,576 (-)	133.349 (-)	4,016 (-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	31.694 (-)	2,185 (-)	33.407 (-)	2,477 (-)
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	16.642 (-)	162 (-)	19.626 (-)	239 (-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	60.133 (-)	2,601 (-)	59.794 (-)	2,796 (-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	114.489 (-)	1,978 (-)	118.435 (-)	2,188 (-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	70.252 (-)	3,102 (-)	70.443 (-)	3,196 (-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	155.05 (-)	3,982 (-)	171.244 (-)	4,502 (-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	54.571 (-)	705 (-)	62.027 (-)	848 (-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10.051 (-)	892 (-)	8.231 (-)	754 (-)
JBG SMITH PROPERTIES	68.855 (-)	2,575 (-)	76.522 (-)	2,916 (-)
AMERICAN FINANCE TRUST INC	71.133 (-)	840 (-)	59.164 (-)	703 (-)
RETAIL VALUE INC	4.797 (0.219)	98 (8)	5.928 (-)	171 (-)
INVITATION HOMES INC	324.214 (-)	9,091 (-)	298.944 (-)	8,676 (-)
QTS REALTY TRUST INC	32.393 (-)	1,830 (-)	33.783 (-)	1,836 (-)
SPIRIT MTA REIT	5.315 (-)	44 (-)	19.261 (-)	165 (-)
COREPOINT LODGING INC	23.965 (-)	187 (-)	10.317 (-)	62 (-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	83.944 (-)	1,023 (-)	87.762 (-)	1,139 (-)

	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
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10.935	173	5.949	111
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	5.165	237	3.864	204
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	57.385	1,220	48.583	1,142
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	38.581	795	43.195	918
	(-)	(-)	(-)	(-)
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	64.89	1,203	70.656	1,419
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	119.231	4,464	130.086	5,367
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	176.843	3,060	193.665	3,693
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.355	66	10.956	85
	(-)	(△1)	(-)	(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	40.737	679	57.267	1,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAGLE HOSPITALITY TRUST	150	84	77.3	20
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	210.2	185	66.6	60
	(-)	(△2)	(-)	(-)
ARA US HOSPITALITY TRUST	420.6	325	265.5	192
	(-)	(△2)	(-)	(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	9.686	92	8.093	93
	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	5.098	33	5.35	31
	(-)	(-)	(-)	(-)
CITY OFFICE REIT INC	27.435	332	29.462	344
	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON PRIME GROUP INC	85.115	164	106.134	272
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	52.315	1,092	56.662	1,215
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34.332	168	38.372	228
	(-)	(-)	(-)	(-)
STORE CAPITAL CORP	128.373	4,103	133.097	4,656
	(-)	(-)	(-)	(-)
PARAMOUNT GROUP INC	113.279	1,360	128.052	1,605
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18.432	212	13.579	167
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	69.162	1,110	81.192	1,411
	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	45.835	1,074	49.803	1,119
	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	60.338	1,011	65.713	1,217
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	12.327	511	13.436	607
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	33.855	1,092	35.758	1,204
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	(-)	(-)	(-)	(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	9.933	414	10.503	475
GLOBAL NET LEASE INC	(-)	(-)	(-)	(-)
CLIPPER REALTY INC	123.934	1,687	138.502	1,972
MANULIFE US REIT	(-)	(-)	(-)	(-)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	49.415	888	51.627	1,002
PARK HOTELS & RESORTS INC	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	3.147	22	3.23	32
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	114.5	102	121.5	107
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	(△449.5)	(△393)	(-)	(-)
COLONY CAPITAL INC	761.4	672	788.8	743
	(449.5)	(383)	(-)	(-)
	137.59	2,612	151.963	3,193
	(12.872)	(348)	(-)	(-)
	295.273	6,403	285.103	6,622
	(-)	(-)	(-)	(-)
	6.014	101	24.82	420
	(-)	(-)	(-)	(-)
	19.507	578	20.409	713
	(-)	(-)	(-)	(-)
	35.694	937	40.109	1,126
	(-)	(-)	(-)	(-)
	276.179	1,148	308.566	1,449
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	41.118	1,177	45.221	1,372
CANADIAN APT PPTYS REIT	(-)	(-)	(-)	(-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	52.243	2,738	53.754	2,931
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	84.732	1,575	93.683	1,946
ALLIED PROPERTIES REIT	(-)	(-)	(-)	(-)
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	32.471	544	31.886	627
NORTHVIEW APARTMENT REIT	(30.048)	(622)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST TRUST	96.764	2,249	102.119	2,614
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	(-)	(-)	(-)	(-)
	38.369	1,927	38.662	2,039
	(-)	(-)	(-)	(-)
	51.333	617	56.914	764
	(-)	(-)	(-)	(-)
	15.515	420	16.705	508
	(-)	(-)	(-)	(-)
	17.344	545	17.87	574
	(-)	(-)	(-)	(-)
	12.786	499	13.427	593
	(-)	(-)	(-)	(-)
	37.078	401	40.38	479
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CROMBIE REAL ESTATE INV	26.105	387	29.181	448
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	27.588	419	29.178	471
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	35.868	396	33.636	402
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8.897	149	9.591	174
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25.26	396	58.463	954
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	39.38	480	39.241	495
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	36.49	432	34.91	447
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.585	1,159	17.619	1,163
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	11.698	70	9.749	64
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHOICE PROPERTIES REIT	93.762	1,288	101.024	1,409
	(-)	(-)	(-)	(-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.847	169	7.887	184
	(-)	(-)	(-)	(-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40.371	590	42.796	654
	(-)	(-)	(-)	(-)
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12.087	225	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SLATE RETAIL REIT	5.598	58	6.381	74
	(-)	(-)	(-)	(-)
SLATE OFFICE REIT	6.435	23	6.88	35
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REIT	6.05	121	7.516	145
	(△15.493)	(△307)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19.793	374	20.546	438
	(15.493)	(307)	(-)	(-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	286.22	1,113	307.178	1,181
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRVAC GROUP	2,373.635	6,906	2,590.245	7,912
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,191.976	1,333	1,230.516	1,457
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	242.282	963	229.703	1,035
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	1,201.177	6,599	1,257.962	7,326
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABACUS PROPERTY GROUP	210.096	727	230.504	854
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	133.624	439	154.426	529
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
STOCKLAND	1,446.562	5,979	1,590.502	7,261
	(-)	(-)	(-)	(-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	147.777	629	158.63	698
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	642.111	7,320	703.535	8,514
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	953.521	13,802	1,043.133	15,059
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	2,118.974	4,559	2,052.978	4,819
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	269.701	2,896	295.348	3,382
	(-)	(-)	(-)	(-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	141.38	541	154.672	648
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	593.154	1,529	605.195	1,654
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARENA REIT	150.041	403	163.478	472
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	279.783	1,483	234.247	1,266
	(-)	(-)	(-)	(-)
APN INDUSTRIA REIT	32.553	84	29.56	86
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE REIT	563.797	1,024	526.863	1,035
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	48.855	140	50.458	153
	(-)	(-)	(-)	(-)
GDI PROPERTY GROUP	226.812	299	249.062	346
	(-)	(-)	(-)	(-)
RURAL FUNDS GROUP	94.329	187	98.245	182
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	3,205.005	10,699	3,549.062	12,695
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA OFFICE REIT	258.952	709	143.044	413
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAYPOINT REIT LTD	322.804	863	270.487	730
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	1,237.6	98,099	1,378.1	109,460
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROSPERITY REIT	344	927	445	1,312
	(-)	(-)	(-)	(-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	899	4,286	932	4,651
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHAMPION REIT	1,089	5,286	1,178	5,671
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	550	2,639	621	3,055
	(-)	(-)	(-)	(-)
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	129	1,235	131	1,302
	(△475)	(△4,929)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	716 (475)	6,026 (4,929)	786 (-)	6,663 (-)
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 MALL TRUST	1,753.8 (-)	4,109 (-)	1,916 (-)	4,685 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,826 (-)	5,580 (△16)	1,856.1 (-)	5,719 (-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,703.1 (-)	3,250 (-)	1,854.5 (-)	3,660 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,351.5 (-)	2,308 (△5)	1,461.3 (-)	2,608 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,892.9 (-)	3,268 (△17)	1,852.5 (-)	3,221 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	716.6 (-)	464 (△1)	811.6 (-)	556 (-)
ASCOTT TRUST	878.7 (202.601)	991 (241)	989.9 (-)	1,201 (-)
FRASERS COMMERCIAL TRUST	252.1 (△113.88)	401 (△176)	382.5 (-)	617 (-)
KEPPEL REIT	1,127.8 (-)	1,330 (-)	1,200.6 (-)	1,462 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	427.1 (-)	1,101 (-)	448.9 (-)	1,242 (-)
ESR REIT	1,049.5 (-)	490 (-)	1,073.3 (-)	559 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	482.4 (-)	673 (△4)	489.1 (-)	732 (-)
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	480.4 (-)	719 (△23)	481.2 (-)	715 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	257.9 (-)	236 (△5)	276.3 (-)	271 (-)
AJMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	256.4 (-)	345 (△0.16673)	333.5 (-)	472 (-)
PARKWAY LIFE REIT	225 (-)	740 (△2)	237.3 (-)	782 (-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	1,036.3 (-)	200 (△3)	993.1 (-)	205 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	914.4 (-)	2,330 (△0.5021)	919.5 (-)	2,390 (-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,334.4 (-)	2,897 (△0.17955)	1,347 (-)	2,995 (-)
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	545.7 (-)	356 (△0.47411)	645.7 (-)	456 (-)
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	261.4 (-)	93 (-)	193.8 (-)	79 (-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,243.8 (-)	1,424 (△18)	1,371.3 (-)	1,611 (-)
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	177.1 (△255.1)	196 (△267)	205.5 (-)	218 (-)

	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
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	329.7	198	414	267
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPH REIT	499.1	504	487	504
	(-)	(-)	(-)	(-)
OUE HOSPITALITY TRUST	150.8	111	189.1	136
	(△407.02)	(△292)	(-)	(-)
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	431.4	196	412.8	196
	(-)	(△0.57467)	(-)	(-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	285.6	219	120.4	86
	(-)	(-)	(-)	(-)
OUE COMMERCIAL REIT	1,528.2	766	1,308	662
	(552.855)	(275)	(-)	(-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	-	-	180.153	44
	(180.153)	(-)	(-)	(-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	203.6	154	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS HOSPITALITY TRUST	259.7	146	297	185
	(-)	(△3)	(-)	(-)
KEPPEL DC REIT	774	1,630	755.3	1,590
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,000.2	1,155	973.1	1,179
	(140.414)	(143)	(-)	(-)
ニュージーランド	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	606.07	1,072	660.09	1,197
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	180.938	478	202.203	544
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	696.471	1,554	729.346	1,608
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	945.872	1,350	1,011.417	1,523
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	353.866	458	389.63	533
	(-)	(-)	(-)	(-)
STRIDE STAPLED GROUP	19.128	43	159.167	355
	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	581.439	2,973	641.453	3,341
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAPITAL & REGIONAL PLC	87.954	23	13.153	24
	(△201.052)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	64.624	2,236	71.761	2,570
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	90.236	975	96.492	1,038
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	455.24	890	490.897	1,127
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	448.997	3,646	492.772	4,169
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	73.453	709	81.28	834
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
INTU PROPERTIES PLC	310.357 (-)	66 (-)	375.192 (-)	61 (-)
UNITE GROUP PLC	234.956 (-)	2,524 (-)	220.181 (-)	2,474 (-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	725.379 (-)	1,072 (-)	765.285 (-)	1,112 (-)
SHAFTESBURY PLC	128.672 (-)	1,042 (-)	145.441 (-)	1,212 (-)
SEGRO PLC	661.393 (-)	5,495 (-)	713.476 (-)	5,864 (-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	157.747 (-)	1,203 (-)	180.18 (-)	1,413 (-)
ASSURA PLC	1,528.598 (-)	1,159 (-)	1,594.973 (-)	1,163 (-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	267.456 (-)	124 (-)	284.604 (-)	146 (-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	305.274 (-)	262 (-)	329.103 (-)	307 (-)
HANSTEEN HOLDINGS PLC	32.232 (-)	32 (-)	191.752 (-)	214 (-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	498.504 (-)	395 (-)	472.016 (-)	389 (-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	112.923 (-)	807 (-)	124.65 (-)	916 (-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	550.58 (-)	1,165 (-)	532.902 (-)	1,139 (-)
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	245.021 (-)	180 (-)	- (-)	- (-)
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	100.236 (161.74)	161 (272)	14.755 (-)	24 (-)
RDI REIT PLC	179.149 (-)	180 (-)	182.739 (-)	202 (-)
NEWRIVER REIT PLC	147.258 (-)	207 (-)	149.119 (-)	252 (-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	363.906 (-)	337 (-)	409.495 (-)	369 (-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	156.793 (-)	150 (-)	181.712 (-)	161 (-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,059.763 (-)	1,474 (-)	1,146.109 (-)	1,612 (-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	364.694 (-)	321 (-)	373.846 (-)	345 (-)
AEW UK REIT PLC	89.918 (-)	75 (-)	34.985 (-)	33 (-)
LXI REIT PLC	335.663 (-)	412 (-)	309.934 (-)	401 (-)
REGIONAL REIT LTD	206.341 (-)	202 (-)	187.489 (-)	205 (-)
イスラエル	千□	千イスラエル・シェケル	千□	千イスラエル・シェケル
REIT 1 LTD	69.888 (-)	1,368 (-)	80.992 (-)	1,633 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	14.293 (-)	103,068 (-)	12.715 (-)	89,958 (-)
LOTTE REIT CO LTD	25.4 (-)	147,692 (-)	- (-)	- (-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	- (0.498)	- (-)	0.498 (-)	- (-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GREEN REIT PLC	200.004 (-)	383 (-)	440.882 (-)	832 (-)
HIBERNIA REIT PLC	367.834 (-)	482 (-)	401.87 (-)	536 (-)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	212.059 (-)	323 (-)	216.537 (-)	328 (-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	24.25 (-)	489 (-)	26.896 (-)	590 (-)
VASTNED RETAIL	8.882 (-)	199 (-)	9.359 (-)	229 (-)
WERELDHAVE NV	19.966 (-)	310 (-)	22.281 (-)	389 (-)
NSI NV	10.018 (-)	408 (-)	11.223 (-)	480 (-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	82.413 (-)	8,735 (-)	90.038 (-)	10,588 (-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
BEFIMMO	12.458 (-)	627 (-)	13.469 (-)	711 (-)
COFINIMMO SA	15.552 (-)	2,008 (-)	15.714 (-)	2,124 (-)
RETAIL ESTATES	5.685 (-)	414 (-)	5.106 (-)	392 (-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10.054 (-)	249 (-)	11.582 (-)	290 (-)
WAREHOUSES DE PAUW	43.454 (38.346)	1,841 (-)	49.972 (-)	1,968 (-)
MONTEA SCA	5.817 (-)	475 (-)	6.12 (-)	504 (-)
AEDIFICA	15.551 (-)	1,616 (-)	16.25 (-)	1,758 (-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	31.965 (-)	4,590 (-)	34.578 (-)	5,303 (-)
ICADE	18.205 (-)	1,504 (-)	26.241 (-)	2,225 (-)
ALTAREA	1.6 (-)	256 (△11)	1.832 (-)	323 (-)
KLEPIERRE	121.602 (-)	3,220 (-)	131.978 (-)	3,714 (-)
COVIVIO	30.245 (-)	2,631 (-)	37.874 (-)	3,592 (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
MERCIALYS	12.191 (-)	125 (-)	23.432 (-)	260 (-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	31.584 (-)	288 (-)	37.824 (-)	354 (-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	93.039 (-)	1,455 (-)	102.696 (-)	1,670 (-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	135.278 (-)	1,405 (△12)	160.831 (-)	1,774 (-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	31.102 (-)	179 (-)	37.651 (-)	243 (-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	220.375 (-)	2,462 (-)	238.884 (-)	2,875 (-)
ユーロ (イタリア)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20.407 (-)	101 (-)	21.987 (-)	118 (-)

(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。

■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	115,477千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	229千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	502.71

(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6月25日から2020年6月22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
不動産ファンド (アメリカ)		千□		千□	千アメリカ・ドル	千円	%
EAGLE HOSPITALITY TRUST	-		72.7		9	1,063	0.0
PRIME US REIT	-		143.6		114	12,265	0.0
ARA US HOSPITALITY TRUST	-		155.1		65	6,955	0.0
MANULIFE US REIT	456.5		-		-	-	-
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME	-		422.1		320	34,251	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	40.032		37.388		6,200	662,019	1.9
ALEXANDER'S INC.	1.406		0.658		169	18,074	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	54.797		42.842		3,888	415,158	1.2
CEDAR REALTY TRUST INC	27.397		13.779		13	1,485	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	74.959		67.224		1,987	212,167	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	52.06		44.475		1,696	181,158	0.5
AGREE REALTY CORP	13.141		15.954		1,076	114,946	0.3
BRT APARTMENTS CORP	2.813		3.832		40	4,361	0.0
SL GREEN	29.965		22.676		1,176	125,583	0.4
EPR PROPERTIES	26.376		22.743		834	89,068	0.3
PROLOGIS INC	221.421		218.819		20,102	2,146,386	6.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	49.184		41.682		6,464	690,210	2.0
LEXINGTON REALTY TRUST	76.871		81.846		873	93,241	0.3
CAMDEN PROPERTY TRUST	34.249		28.877		2,700	288,309	0.8
CBL & ASSOCIATES	47.062		14.685		4	464	0.0
MACK CALI	31.711		27.227		428	45,756	0.1
EQUINIX INC	-		26.224		18,656	1,991,958	5.7
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	57.252		51.259		1,837	196,149	0.6
COUSINS PROPERTIES INC	51.859		43.872		1,348	143,992	0.4
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11.393		9.558		114	12,235	0.0
SITE CENTERS CORP	50.198		45.456		343	36,691	0.1
DUKE REALTY TRUST	127.358		109.515		3,898	416,267	1.2
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25.699		9.083		7	814	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	23.315		19.381		4,530	483,763	1.4
EQUITY RESIDENTIAL	130.924		103.634		6,174	659,252	1.9
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26.353		20.972		1,777	189,770	0.5
FIRST INDUSTRIAL RT	44.501		37.957		1,449	154,771	0.4
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	169.495		159.473		4,197	448,148	1.3
EQUITY COMMONWEALTH	42.702		35.738		1,127	120,424	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	44.016		40.136		1,221	130,445	0.4
HIGHWOODS PROPERTIES INC	36.411		31.134		1,201	128,313	0.4
SERVICE PROPERTIES TRUST	57.784		49.829		423	45,168	0.1
WELLTOWER INC	137.308		123.686		6,307	673,503	1.9
EAST GROUP	12.816		11.518		1,353	144,560	0.4
KIMCO REALTY	149.202		126.14		1,604	171,312	0.5
KILROY REALTY CORP	35.671		31.365		1,961	209,403	0.6
LTC PROPERTIES INC	14.61		11.953		451	48,164	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	83.031		72.676		287	30,689	0.1
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	34.32		29.217		423	45,201	0.1
LIBERTY PROPERTY TRUST	52.372		-		-	-	-
BRANDYWINE REALTY TRUST	61.895		49.719		515	54,996	0.2
IRON MOUNTAIN INC	101.232		85.668		2,256	240,925	0.7
THE MACERICH COMPANY	37.186		34.714		307	32,801	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32.042		53.835		3,460	369,479	1.1
ACADIA REALTY TRUST	28.451		24.839		330	35,245	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	262.621		208.857		2,437	260,237	0.7
MID AMERICA	40.303		33.983		3,897	416,100	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13.759		12.444		77	8,277	0.0
NATIONAL HEALTH INVS INC	14.991		12.733		763	81,474	0.2
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4.546		3.559		250	26,770	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4.255		5.097		87	9,327	0.0

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	%
PENN REAL ESTATE INVEST TST		17.505		8,333	11	1,210	0.0
GETTY REALTY CORP		12.616		10.38	314	33,602	0.1
PS BUSINESS PARKS		7.004		5,805	765	81,702	0.2
RPT REALTY		27.63		25.39	170	18,190	0.1
REALTY INCOME CORP		107.748		101.743	6,260	668,406	1.9
REGENCY CENTERS CORP		59.384		49.99	2,231	238,236	0.7
UDR INC		97.737		87.344	3,298	352,139	1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES		38.643		32.504	824	88,010	0.3
CORECIVIC INC		41.521		35.793	352	37,604	0.1
SAUL CENTERS INC		4.421		3.788	123	13,140	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		108.459		90.583	6,079	649,154	1.9
LIFE STORAGE INC		16.395		13.99	1,314	140,379	0.4
PUBLIC STORAGE		52.671		44.536	8,488	906,276	2.6
SUN COMMUNITIES INC		30.554		29,114	4,144	442,526	1.3
TAUBMAN CENTERS INC		21.393		17.74	661	70,668	0.2
TANGER FACTORY OUTLET		32.737		28.639	205	21,924	0.1
UMH PROPERTIES INC		13.433		11,534	146	15,615	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		11.234		10.478	194	20,758	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME		4.708		3,813	324	34,677	0.1
VENTAS INC		126.445		110.685	3,962	423,078	1.2
VORNADO REALTY TRUST		61.491		47.3	1,851	197,716	0.6
WASHINGTON REIT		27.867		24.141	524	55,958	0.2
GEO GROUP INC		42.24		36.455	431	46,045	0.1
WEINGARTEN REALTY INVST		41.968		35.001	647	69,172	0.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES		49.096		41.075	1,504	160,643	0.5
KITE REALTY GROUP TRUST		31.031		25.625	290	31,026	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC		45.051		38,157	3,547	378,761	1.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		40.56		33.124	156	16,728	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		80.002		64.963	564	60,274	0.2
CUBESMART		66.756		57.831	1,556	166,158	0.5
DIGITAL REALTY TRUST INC		73.766		79.493	11,117	1,186,972	3.4
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		73.922		60.643	343	36,647	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST		136.49		156.528	3,013	321,715	0.9
DOUGLAS EMMETT INC		57.933		49.264	1,489	159,007	0.5
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C		41.878		35.098	390	41,727	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC		43.929		36.359	604	64,558	0.2
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC		38.836		31.285	190	20,342	0.1
TERRENO REALTY CORP		21.401		19,467	1,048	111,905	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC		13.155		14.433	408	43,579	0.1
RLJ LODGING TRUST		61.408		48,111	465	49,672	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST		65.012		59,337	2,139	228,454	0.7
CORESITE REALTY CORP		12.902		11,921	1,448	154,633	0.4
VEREIT INC		342.119		318,763	2,161	230,752	0.7
CHESAPEAKE LODGING TRUST		21.119		-	-	-	-
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		45.82		37.688	511	54,604	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST		17.851		14.519	392	41,932	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES		16.36		14.783	110	11,806	0.0
CHATHAM LODGING TRUST		17.398		15,244	95	10,237	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC		62.571		59,548	861	91,935	0.3
WHITESTONE REIT		15.361		13,415	92	9,854	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC		54.303		45,098	1,137	121,437	0.3
STAG INDUSTRIAL INC		43.588		44.62	1,298	138,634	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC		74.671		64.534	417	44,580	0.1
CYRUSONE INC		38.14		33,769	2,588	276,416	0.8
WP CAREY INC		60.124		50.961	3,514	375,218	1.1
GLADSTONE LAND CORP		4.129		6,064	92	9,860	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC		72.282		64,729	1,764	188,397	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		18.038		16,325	574	61,319	0.2
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP		18.755		15,771	136	14,565	0.0
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		30.159		30,498	1,089	116,346	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		%
PHYSICIANS REALTY TRUST	63.958	60.012	1,070	114,245		0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	36.539	36.348	1,489	159,077		0.5
AMERICAN HOMES 4 RENT	92.275	76.081	2,048	218,675		0.6
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	33.291	25.835	284	30,370		0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	3.694	5.514	527	56,312		0.2
JBG SMITH PROPERTIES	41.967	34.3	1,038	110,891		0.3
AMERICAN FINANCE TRUST INC	20.602	32.571	273	29,177		0.1
RETAIL VALUE INC	5.916	5.004	63	6,731		0.0
INVITATION HOMES INC	135.096	160.366	4,464	476,684		1.4
QTS REALTY TRUST INC	19.246	17.856	1,126	120,261		0.3
SPIRIT MTA REIT	13.946	—	—	—		—
COREPOINT LODGING INC	—	13.648	55	5,887		0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	48.864	45.046	308	32,945		0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	—	4.986	68	7,277		0.0
SAFEHOLD INC	2.744	4.045	261	27,891		0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	17.735	26.537	453	48,422		0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	24.28	19.666	404	43,149		0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	40.874	35.108	478	51,091		0.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	71.712	60.857	2,312	246,912		0.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	105.086	88.264	1,117	119,307		0.3
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8.936	5.335	17	1,885		0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	33.378	16.848	184	19,661		0.1
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	6.509	8.102	64	6,903		0.0
FARMLAND PARTNERS INC	9.63	9.378	61	6,608		0.0
CITY OFFICE REIT INC	15.324	13.297	132	14,140		0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	70.292	49.273	49	5,260		0.0
CARETRUST REIT INC	33.024	28.677	522	55,786		0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	31.63	27.59	103	11,076		0.0
STORE CAPITAL CORP	70.644	65.92	1,615	172,437		0.5
PARAMOUNT GROUP INC	70.246	55.473	436	46,553		0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.336	12.189	147	15,708		0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	44.064	32.034	340	36,357		0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	25.372	21.404	502	53,704		0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	39.522	34.147	326	34,891		0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8.002	6.893	240	25,641		0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	19.694	17.791	502	53,700		0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6.76	6.19	268	28,709		0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	75.452	60.884	610	65,135		0.2
GLOBAL NET LEASE INC	29.176	26.964	449	48,020		0.1
CLIPPER REALTY INC	5.169	5.086	36	3,850		0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC	70.84	69.339	742	79,289		0.2
VICI PROPERTIES INC	127.279	137.449	3,089	329,903		0.9
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	18.806	—	—	—		—
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	10.32	9.418	112	12,006		0.0
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	25.108	20.693	490	52,406		0.2
COLONY CAPITAL INC	171.468	139.081	368	39,351		0.1
小 計	□ 数 7,983.341	□ 数 7,409.052	242,959	25,940,780		—
銘 柄 数<比率>	155銘柄<72.3%>	157銘柄<74.6%>	—	—		74.6
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	24.167	20.064	416	32,643		0.1
CANADIAN APT PPTYYS REIT	26.047	24.536	1,222	95,798		0.3
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	48.916	39.965	401	31,445		0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	—	30.633	440	34,498		0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	52.282	46.927	740	58,070		0.2
ALLIED PROPERTIES REIT	18.469	18.176	744	58,374		0.2
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	30.322	24.741	197	15,511		0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	9.817	8.627	172	13,535		0.0
NORTHVIEW APARTMENT REIT	10.523	9.997	344	26,990		0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.736	7.095	202	15,863		0.0
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	24.488	21.186	163	12,834		0.0

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	金額	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
(カナダ)	千口	千円	千口	千カナダ・ドル	千円		%
CROMBIE REAL ESTATE INV	16.86	13,784	178	14,021	14,021		0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19.862	18,272	265	20,820	20,820		0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	22.017	24,249	256	20,125	20,125		0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	6.696	6,002	89	6,994	6,994		0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM	33.203	—	—	—	—		—
DREAM INDUSTRIAL REIT	22.37	22,509	237	18,575	18,575		0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	19.293	20,873	229	17,993	17,993		0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	8.529	8,495	569	44,665	44,665		0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10.465	12,414	70	5,545	5,545		0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	53.304	46,042	594	46,619	46,619		0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	5.037	4,997	103	8,122	8,122		0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16.489	14,064	193	15,144	15,144		0.0
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES	—	12,087	221	17,334	17,334		0.0
SLATE RETAIL REIT	6.406	5,623	57	4,494	4,494		0.0
SLATE OFFICE REIT	12.079	11,634	43	3,446	3,446		0.0
KILLAM APARTMENT REIT	16.959	—	—	—	—		—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	—	14,74	257	20,215	20,215		0.1
小計	522.336	487.732	8,417	659,685	659,685		—
銘柄数<比率>	25銘柄<1.9%>	26銘柄<1.9%>	—	—	—		1.9
(オーストラリア)	千口	千円	千口	千オーストラリア・ドル	千円		%
BWP TRUST	166.921	145,963	575	41,901	41,901		0.1
MIRVAC GROUP	1,398.222	1,181.612	2,764	201,455	201,455		0.6
CROMWELL PROPERTY GROUP	608.982	570,442	510	37,198	37,198		0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	124.412	136,991	489	35,632	35,632		0.1
GPT GROUP	632.592	575,807	2,573	187,531	187,531		0.5
ABACUS PROPERTY GROUP	120.666	100,258	278	20,307	20,307		0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	95.978	75,176	196	14,295	14,295		0.0
STOCKLAND	871.018	727,078	2,632	191,769	191,769		0.6
INGENIA COMMUNITIES GROUP	79.545	68,692	321	23,422	23,422		0.1
DEXUS	383.348	321,924	3,235	235,726	235,726		0.7
GOODMAN GROUP	568.14	478,528	7,297	531,699	531,699		1.5
VICINITY CENTRES	1,131.404	1,197.4	1,814	132,172	132,172		0.4
CHARTER HALL GROUP	162.348	136,701	1,380	100,596	100,596		0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	99.748	86,456	290	21,165	21,165		0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	313.615	301,574	714	52,075	52,075		0.1
ARENA REIT	106.906	93,469	220	16,071	16,071		0.0
CHARTER HALL LONG WALE REIT	77.55	123,086	568	41,432	41,432		0.1
APN INDUSTRIA REIT	38.914	41,907	111	8,121	8,121		0.0
NATIONAL STORAGE REIT	243.475	280,409	553	40,350	40,350		0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	52.264	50,661	160	11,664	11,664		0.0
GDI PROPERTY GROUP	160.1	137.85	167	12,203	12,203		0.0
RURAL FUNDS GROUP	105.905	101,989	213	15,530	15,530		0.0
SCENTRE GROUP	1,887.979	1,543,922	3,412	248,603	248,603		0.7
CENTURIA OFFICE REIT	—	115,908	243	17,734	17,734		0.1
WAYPOINT REIT LTD	156.535	208,852	576	41,998	41,998		0.1
小計	9,586.567	8,802.655	31,301	2,280,661	2,280,661		—
銘柄数<比率>	24銘柄<7.0%>	25銘柄<6.6%>	—	—	—		6.6
(香港)	千口	千円	千口	千香港・ドル	千円		%
LINK REIT	748.52	608.02	39,946	550,468	550,468		1.6
PROSPERITY REIT	462	361	844	11,640	11,640		0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	481	448	1,666	22,965	22,965		0.1
CHAMPION REIT	691.07	602.07	2,528	34,845	34,845		0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	384	313	1,223	16,864	16,864		0.0
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	477	—	—	—	—		—
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	—	405	2,867	39,512	39,512		0.1
小計	3,243.59	2,737.09	49,078	676,296	676,296		—
銘柄数<比率>	6銘柄<2.6%>	6銘柄<1.9%>	—	—	—		1.9
(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	1,001.86	839.66	1,704	130,190	130,190		0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	911.76	881.66	2,750	210,104	210,104		0.6

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	金額	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
(シンガポール)	千口	千円	千口	千シンガポール・ドル	千円		%
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	992.379		840.979	1,454	111,124		0.3
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	808.39		698.59	1,005	76,835		0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	839.72		880.12	1,707	130,413		0.4
STARHILL GLOBAL REIT	469.2		374.2	205	15,719		0.0
ASCOTT TRUST	438.715		530.116	572	43,729		0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	244.28		-	-	-		-
KEPPEL REIT	626.4		553.6	614	46,935		0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	230.1		208.3	510	38,979		0.1
ESR REIT	660.33		636.53	257	19,690		0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	257.6		250.9	281	21,463		0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	233.38		232.58	304	23,271		0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	198.5		180.1	129	9,904		0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	217.695		140.595	175	13,423		0.0
PARKWAY LIFE REIT	131.6		119.3	408	31,163		0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	571.8		615	87	6,717		0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	460.92		455.82	1,294	98,876		0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	657.2		644.6	1,302	99,453		0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	410.78		310.78	177	13,530		0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	218.6		286.2	105	8,088		0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	741.7		614.2	583	44,566		0.1
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	283.5		-	-	-		-
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	355.6		271.3	145	11,086		0.0
SPH REIT	224.9		237	212	16,201		0.0
OUÉ HOSPITALITY TRUST	445.32		-	-	-		-
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	256.4		275	110	8,401		0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	-		165.2	125	9,589		0.0
OUÉ COMMERCIAL REIT	-		773.055	309	23,618		0.1
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	-		203.6	149	11,429		0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	273		235.7	117	9,001		0.0
KEPPEL DC REIT	341		359.7	888	67,860		0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	555.65		723.164	846	64,625		0.2
小計	14,058.279		13,537.549	18,538	1,415,996		4.1
	口数・金額 銘柄数<比率>	30銘柄<3.6%>	30銘柄<4.1%>	-	-	-	-
(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	380.191		326.171	544	37,268		0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	127.868		106.603	273	18,745		0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	361.871		328.996	697	47,721		0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	512.744		447.199	482	33,045		0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	282.83		247.066	286	19,608		0.1
STRIDE STAPLED GROUP	140.039		-	-	-		-
小計	1,805.543		1,456.035	2,285	156,388		0.4
	口数・金額 銘柄数<比率>	6銘柄<0.5%>	5銘柄<0.4%>	-	-	-	-
(イギリス)	千口	千円	千口	千イギリス・ポンド	千円		%
BRITISH LAND CO PLC	337.35		277.336	1,123	148,089		0.4
CAPITAL & REGIONAL PLC	135.437		9.186	9	1,260		0.0
DERWENT LONDON PLC	38.645		31.508	937	123,567		0.4
BIG YELLOW GROUP PLC	54.616		48.36	492	64,939		0.2
HAMMERSON PLC	269.495		233.838	244	32,232		0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	265.466		221.691	1,343	176,981		0.5
WORKSPACE GROUP PLC	46.404		38.577	269	35,534		0.1
INTU PROPERTIES PLC	295.875		231.04	11	1,522		0.0
UNITE GROUP PLC	92.217		106.992	1,000	131,829		0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	395.499		355.593	580	76,475		0.2
SHAFTESBURY PLC	80.557		63.788	363	47,956		0.1
SEGRO PLC	379.728		327.645	2,884	380,130		1.1
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	95.824		73.391	477	62,864		0.2
ASSURA PLC	854.448		788.073	641	84,535		0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	204.861		187.713	61	8,088		0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	194.275		170.446	116	15,386		0.0
HANSTEEN HOLDINGS PLC	159.52		-	-	-		-

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	金額	□数	金額
(イギリス)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	227.534	254.022	167	22,093	167	22,093
SAFESTORE HOLDINGS LTD	72.106	60.379	446	58,840	446	58,840
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	251.418	269.096	600	79,150	600	79,150
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT	-	245.021	178	23,538	178	23,538
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL	-	247.221	423	55,774	423	55,774
RDI REIT PLC	77.641	74.051	57	7,631	57	7,631
NEWRIVER REIT PLC	103.999	102.138	69	9,112	69	9,112
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	235.42	189.831	206	27,267	206	27,267
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	134.957	110.038	105	13,920	105	13,920
TRITAX BIG BOX REIT PLC	598.461	512.115	747	98,530	747	98,530
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	196.113	186.961	103	13,698	103	13,698
AEW UK REIT PLC	-	54.933	38	5,096	38	5,096
LXI REIT PLC	134.197	159.926	182	24,025	182	24,025
REGIONAL REIT LTD	110.888	129.74	97	12,822	97	12,822
小計	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>
	28銘柄	<4.9%>	30銘柄	<5.3%>	-	-
(イスラエル)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
REIT 1 LTD	63.655	52.551	722	22,334	722	22,334
小計	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>
	1銘柄	<0.1%>	1銘柄	<0.1%>	-	-
(韓国)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	9.316	10.894	72,989	6,423	72,989	6,423
LOTTE REIT CO LTD	-	25.4	147,574	12,986	-	-
小計	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>
	1銘柄	<0.0%>	2銘柄	<0.1%>	-	-
(ユーロ…アイルランド)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
GREEN REIT PLC	240.878	-	-	-	-	-
HIBERNIA REIT PLC	242.24	208.204	231	27,587	231	27,587
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	124.155	119.677	167	20,000	167	20,000
小計	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>
	3銘柄	<0.2%>	2銘柄	<0.1%>	-	-
(ユーロ…オランダ)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14.114	11.468	147	17,577	147	17,577
VASTNED RETAIL	6.326	5.849	111	13,265	111	13,265
WERELDHAVE NV	14.313	11.998	102	12,195	102	12,195
NSI NV	6.338	5.133	184	21,966	184	21,966
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	48.27	40.645	2,243	267,819	2,243	267,819
小計	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>
	5銘柄	<2.0%>	5銘柄	<1.0%>	-	-
(ユーロ…ベルギー)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
BEFIMMO	7.94	6.929	282	33,663	282	33,663
COFINIMMO SA	7.418	7.256	921	110,000	921	110,000
RETAIL ESTATES	2.609	3.188	190	22,756	190	22,756
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8.307	6.779	153	18,288	153	18,288
WAREHOUSES DE PAUW	6.236	38.064	933	111,434	933	111,434
MONTEA SCA	3.562	3.259	285	34,078	285	34,078
AEDIFICA	8.684	7.985	816	97,413	816	97,413
小計	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>
	7銘柄	<0.9%>	7銘柄	<1.2%>	-	-
(ユーロ…フランス)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
GEICINA SA	19.268	16.655	1,900	226,843	1,900	226,843
ICADE	16.153	8.117	514	61,381	514	61,381
ALTAREA	1.209	0.977	136	16,327	136	16,327
KLEPIERRE	70.94	60.564	1,067	127,420	1,067	127,420
COVIVIO	21.906	14.277	969	115,718	969	115,718
MERCIALYS	18.406	7.165	54	6,551	54	6,551
小計	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>	□数 銘柄数	金額 数<比率>
	6銘柄	<2.2%>	6銘柄	<1.6%>	-	-
(ユーロ…ドイツ)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
HAMBORNER REIT AG	27.782	21.542	185	22,173	185	22,173

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
(ユーロ…ドイツ)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		56.116		46.459	638	76,254	0.2
小計	□	83,898	□	68,001	824	98,428	—
	数	<0.3%>	数	<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		97.764		72.211	582	69,562	0.2
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		25.183		18.634	88	10,565	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		127.901		109.392	852	101,788	0.3
小計	□	250,848	□	200,237	1,523	181,915	—
	数	<0.7%>	数	<0.5%>	—	—	0.5
(ユーロ…イタリア)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		15.915		14.335	49	5,852	0.0
小計	□	15,915	□	14,335	49	5,852	—
	数	<0.0%>	数	<0.0%>	—	—	0.0
合計	□	44,555,511	□	41,146,369	—	34,662,937	—
	数	<99.2%>	数	<99.7%>	—	—	99.7

(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) < >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

2020年6月22日現在

項目	当期		期末	
	評価額	比率	評価額	比率
投資信託受益証券、投資証券	千円		千円	%
	34,662,937		34,662,937	98.9
コール・ローン等、その他	369,226		369,226	1.1
投資信託財産総額	35,032,164		35,032,164	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、34,683,398千円、99.0%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6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.77円、1カナダ・ドル=78.37円、1オーストラリア・ドル=72.86円、1香港・ドル=13.78円、1シンガポール・ドル=76.38円、1ニュージーランド・ドル=68.42円、1イギリス・ポンド=131.78円、1イスラエル・シケル=30.91円、100韓国・ウォン=8.80円、1ユーロ=119.37円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	35,187,750,939円
コ ー ル ・ オ ー ン 等	143,091,112
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	3,790,706,795
投 資 証 券(評価額)	30,872,230,731
未 収 入 金	300,884,664
未 収 配 当 金	80,837,637
(B) 負 債	434,323,086
未 払 金	430,282,086
未 払 解 約 金	4,041,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	34,753,427,853
元 本	31,818,365,833
次 期 繰 越 損 益 金	2,935,062,020
(D) 受 益 権 総 口 数	31,818,365,833口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	10,922円

(注1) 期首元本額 36,301,672,788円
 追加設定元本額 63,049,855,284円
 一部解約元本額 67,533,162,239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)	67,800,807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)	28,192,032円
MITOラップ型ファンド(安定型)	7,623,330円
MITOラップ型ファンド(中立型)	20,052,668円
MITOラップ型ファンド(積極型)	21,272,270円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	84,252,305円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	79,298,997円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	33,732,261円
たわらノーロード 先進国リート	6,472,824,918円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	800,466,510円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	300,736,279円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,032,535,921円
たわらノーロード バランス(堅実型)	9,582,980円
たわらノーロード バランス(標準型)	156,033,540円
たわらノーロード バランス(積極型)	301,916,594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)	71,016,875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)	255,469,351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)	174,107,265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)	291,954,248円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,282,274円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	6,404,870円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,259,508円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,979,388円
One DC先進国リートインデックスファンド	78,025,842円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	20,914,119円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	623,478,643円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	54,446,524円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10)	220,950,023円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20)	238,890,973円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30)	424,710,954円
投資のソムリエ	3,815,146,262円
投資のソムリエ<DC年金>	367,559,283円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	207,835,560円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	271,498,940円

リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,523,341,327円
ワールドアセットバランス(基本コース)	812,123,062円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	557,429,997円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	3,573,174円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	2,102,378円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,607,966円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	7,214,900円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,095,722,412円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	176,612,190円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	953,333円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	404,989円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	433,365円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	664,483,683円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	96,261,935円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-4	1,034,466,514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)	180,706,658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)	362,233,563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)	2,767,748,376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)	4,418,271,468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)	556,422,229円
期末元本合計	31,818,365,833円

■損益の状況

当期 自2019年6月25日 至2020年6月22日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	受 取 配 当	1,547,074,960円
	受 取 利 息	1,545,817,211
	そ の 他 収 益	1,274,461
	支 払 利 息	334,638
		△351,350
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	買 入 損 益	△5,102,286,109
	売 入 損 益	3,734,044,964
		△8,836,331,073
(C) そ の 他 費 用		△36,105,375
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		△3,591,316,524
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		11,108,533,203
(F) 解 約 差 損 益 金		△20,457,481,375
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		15,875,326,716
(H) 合 計(D + E + F + G)		2,935,062,020
次 期 繰 越 損 益 金(H)		2,935,062,020

(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。