

運用報告書 (全体版)

第8期<決算日2019年4月11日>

D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)

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	
信託期間	2015年8月28日から無期限です。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。	
主要投資対象	D I AMコア資産設計 ファンド (堅実型)	以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券 (E T F) 、短期金融資産等に投資する場合があります。
	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。
	国内株式パッシブ・ファンド (厳選化型)・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。
	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。
	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。
	エマージング債券 パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	エマージング株式 パッシブ・マザーファンド	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
	マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本、先進国および新興国の債券・株式の6資産に実質的に分散投資を行います。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券 (E T F) 、短期金融資産等 ^(*) に投資する場合があります。 (*) 市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 6資産の配分比率 (基本配分比率) は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。 基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率 (合計資産比率) を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時には基準価額の下落を一定水準 (下値目安値 ^(**)) までに抑えることをめざします。なお、下値目安値は、3ヵ月毎に改定します。 (*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません (相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります)。	
投資制限	各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。	
分配方針	決算日 (原則として4月、10月の各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。	

愛称：まもラップ (堅実型)

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、「D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)」は、2019年4月11日に第8期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付(転換社債)比率	債券先物比率	債券先物比率	投資信託受益証券、債券投資比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率								
4期(2017年4月11日)	円	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
	10,000	0	5.5	20.5	0.8	13.6	-	-	-	0.2	165
5期(2017年10月11日)	10,538	0	5.4	45.3	1.4	30.2	-	-	-	0.3	141
6期(2018年4月11日)	10,645	0	1.0	5.6	0.2	4.1	-	-	-	0.0	133
7期(2018年10月11日)	10,294	0	△3.3	21.3	1.1	16.6	-	-	-	0.1	154
8期(2019年4月11日)	10,513	0	2.1	50.3	2.0	26.2	-	-	-	0.3	157

(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。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付(転換社債)比率	債券先物比率	債券先物比率	投資信託受益証券、債券投資比率
	騰落率								
(期首)	円	%	%	%	%	%	%	%	%
2018年10月11日	10,294	-	21.3	1.1	16.6	-	-	-	0.1
10月末	10,150	△1.4	12.5	0.5	7.2	-	-	-	0.1
11月末	10,173	△1.2	13.9	0.3	7.6	-	-	-	0.1
12月末	10,050	△2.4	6.0	0.2	3.6	-	-	-	0.0
2019年1月末	10,174	△1.2	33.5	1.2	18.0	-	-	-	0.2
2月末	10,354	0.6	48.1	2.3	25.5	-	-	-	0.3
3月末	10,364	0.7	49.4	2.3	26.6	-	-	-	0.3
(期末)									
2019年4月11日	10,513	2.1	50.3	2.0	26.2	-	-	-	0.3

(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。

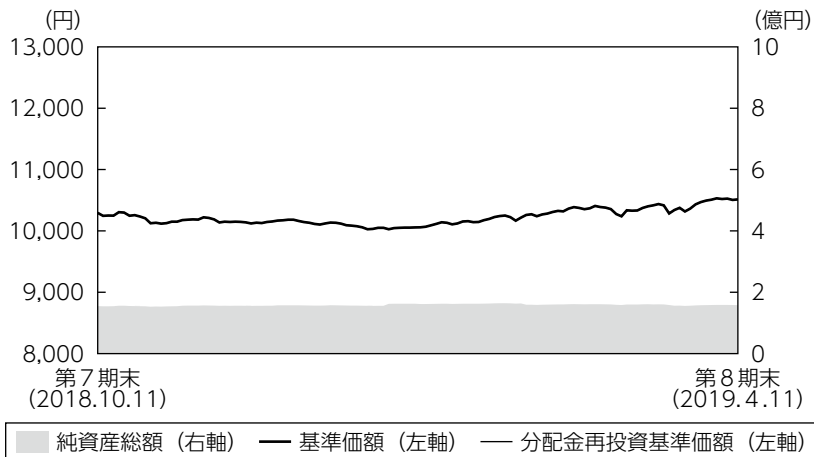
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2018年10月12日から2019年4月11日まで）

基準価額等の推移



第8期首：10,294円
 第8期末：10,513円
 (既払分配金0円)
 騰落率：2.1%
 (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は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

2018年末から2019年初めにかけて株式市場は大幅に下落しましたが、パウエルF R B（米連邦準備理事会）議長が利上げ休止を示唆したことなどを受けて上昇に転じました。その後も、米中通商協議の進展期待などが高まったことなどから期末にかけて株式市場が上昇基調で推移した他、各国中央銀行がハト派姿勢に転じてきたことなどから債券利回りが低下（価格は上昇）したことがプラス要因となり、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
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.6%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	△4.3%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.2%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.8%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.4%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	11.0%

投資環境

国内債券市場は上昇（利回りは低下）しました。世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の悪化懸念、欧米の政治リスクの高まりなどを背景に、10年国債利回りは期を通じて低下基調で推移しました。国内債券市場の好需給や、米国の利上げペースの緩和観測なども、利回りの低下要因となりました。前期末に0.14%程度だった10年国債利回りは、2月にマイナス圏にまで低下し、△0.07%程度で期末を迎えました。

国内株式市場は期初から12月下旬にかけては、米国長期金利の低下を受けて米国株式市場が下落したこと、世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の激化などを嫌気し、急落しました。その後、1月半ばまでは大幅下落の反動もあり、反発しました。それ以降は、米中貿易問題の進捗、ブレグジット（英国のEU離脱）問題、世界景気の減速懸念、トルコ信用不安などを材料として一進一退の展開となりました。

先進国債券市場では、米国債の利回り、欧州債の利回りともに低下しました。米国ではFRBが保有資産の縮小を2019年9月末で終了する方針を示し、政策金利見通しを引き下げたことなどから、米国債利回りは低下しました。欧州圏ではECB（欧州中央銀行）が年内の利上げを断念し、経済見通しを下方修正したことなどを受けて、欧州債の利回りは低下しました。

先進国株式市場は、FOMC（米連邦公開市場委員会）が利上げを決定したことが嫌気されたことなどから、2018年末にかけて弱含みました。年明け以降は、パウエルFRB議長が、金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから値を戻し、前期末比で上昇となりました。欧州市場は、英国のEU離脱を巡る懸念などから軟調に推移していましたが、年明け以降は値を戻し、各国株式市場は前期末比で概ね上昇となりました。

新興国債券の利回りは低下しました。ベースとなる米国の長期金利は、米国における利上げの打ち止め観測や、FOMCにおいて2019年内の利上げを見送る姿勢が示されたことなどを背景に、低下しました。対米国債スプレッドは、原油安などを背景に産油国を中心に拡大する局面もありましたが、その後原油価格の反発に伴い縮小し、期末には期初とほぼ同水準になりました。

新興国株式市場は、前期末比で上昇しました。前半は世界景気の先行きや、米中の貿易摩擦を巡る思惑などから方向感のない展開となりましたが、年明け以降はパウエルFRB議長が金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから世界景気の先行き懸念が和らぎ、新興国株式市場は上昇基調となりました。米中通商協議進展への期待もあり、その後も市場心理の改善を背景に堅調な推移となりました。

為替市場では、米ドル、ユーロに対して2018年12月中旬まではレンジ内の動きになりましたが、日米金利差の縮小やリスク回避的な動きが強まったことなどから、12月末にかけて円高になりました。年初に、一時急速に円高が進む局面がありましたが、その後はリスク回避姿勢が和らいだことや、底堅い米景気動向などを受けて、2月末にかけて円安傾向で推移し、その後は揉み合いになりました。期を通して見ると、米ドル、ユーロに対して円高が進みました。

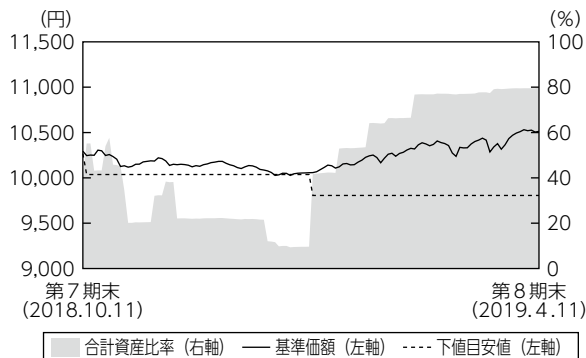
ポートフォリオについて

●当ファンド

国内外の6つのマザーファンドへの分散投資を行いつつ、基準価額の下落幅を抑制する運用を行いました。2018年12月下旬にかけて基準価額が下落したため、合計資産比率を10%程度まで引き下げました。下値目安値変更後、合計資産比率を42%程度まで引き上げ、期末にかけて基準価額が上昇したため、合計資産比率を80%程度まで段階的に引き上げました。

※ 合計資産比率は純資産総額に対する各マザーファンド評価額の合計の割合です。

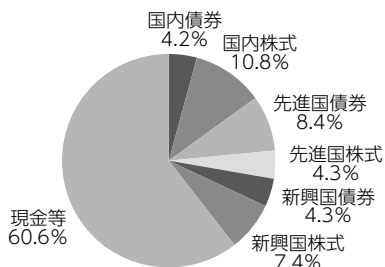
<基準価額と合計資産比率の推移>



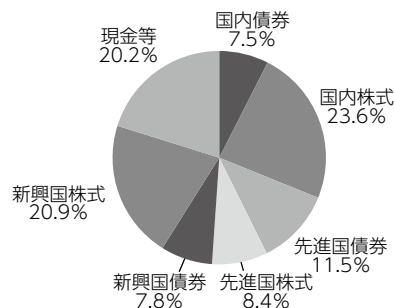
【運用状況】

○ポートフォリオ構成

期首 (前期末)



期末



※ 1 組入比率は純資産総額に対する割合です。

※ 2 現金等とは、短期国債等およびコール・ローンなどの短期金融資産等をあらわします。

※ 3 国内債券：国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式：国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、先進国債券：外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、先進国株式：外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、新興国債券：エマージング債券パッシブ・マザーファンド、新興国株式：エマージング株式パッシブ・マザーファンド

●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。

●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。

●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。

●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M S C I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。

●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。

●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M S C I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。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、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
	2018年10月12日 ～2019年4月11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	732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

●当ファンド

引き続き、国内外の6資産に分散投資を行い、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率を機動的に変更することでファンドのリスクをコントロールし、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざした運用を行います。

●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。

●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。

●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。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

●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。

●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	第 8 期		項目の概要
	(2018年10月12日 ～2019年4月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	58円	0.565%	(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10,224円です。
(投信会社)	(28)	(0.269)	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)	(28)	(0.269)	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
(受託銀行)	(3)	(0.027)	受託銀行分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.006	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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)	(0.005)	
(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)	
(c) 有価証券取引税	1	0.005	(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)	(1)	(0.005)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.011	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.007)	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)	(0)	(0.002)	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)	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	60	0.587	

(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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2018年10月12日から2019年4月11日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13,308	17,200	9,427	12,100
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	22,183	55,100	13,669	34,200
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12,773	22,900	10,179	18,300
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,108	17,300	3,342	11,400
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	9,489	17,200	6,637	12,000
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	43,833	48,300	27,209	29,300

■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	58,731,065千円	76,035,429千円	26,839,218千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	267,328,157千円	319,000,139千円	47,435,450千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.21	0.23	0.56

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2018年10月12日から2019年4月11日まで）

【D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）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)	9千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.0008千円
(B)／(A)	0.0%

(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まず。

【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 63,186	百万円 5,299	% 8.4	百万円 118,095	百万円 8,286	% 7.0

平均保有割合 0.0%

(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。

【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

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 32,380	百万円 -	% -	百万円 26,350	百万円 5,556	% 21.1

平均保有割合 0.0%

(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。

(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 309	百万円 235	百万円 2,772

(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 25

【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。

【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。

【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。

【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。

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、興銀リース、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
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,135	9,016	11,836
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	6,372	14,887	37,343
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,283	9,876	18,239
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,867	3,632	13,298
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	3,640	6,492	12,387
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	10,528	27,152	33,004

■投資信託財産の構成

2019年4月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,836	7.4
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	37,343	23.4
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	18,239	11.4
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	13,298	8.3
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	12,387	7.8
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	33,004	20.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	33,429	21.0
投 資 信 託 財 産 総 額	159,538	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、2019年4月11日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは195,831,597千円、99.8%、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは370,579,464千円、100.0%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは108,396,341千円、99.9%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは62,190,008千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年4月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=111.11円、1カナダ・ドル=83.32円、1オーストラリア・ドル=79.61円、1香港・ドル=14.18円、1シンガポール・ドル=82.17円、1ニュージーランド・ドル=75.15円、1台湾・ドル=3.60円、1イギリス・ポンド=145.51円、1イスラエル・シェケル=31.04円、1スイス・フラン=110.83円、1トルコ・リラ=19.57円、1デンマーク・クローネ=16.78円、1ノルウェー・クローネ=13.08円、1スウェーデン・クローナ=11.99円、1メキシコ・ペソ=5.90円、1フィリピン・ペソ=2.14円、100チリ・ペソ=16.78円、100コロンビア・ペソ=3.59円、1カタール・リアル=30.47円、1インド・ルピー=1.62円、1パキスタン・ルピー=0.79円、100インドネシア・ルピア=0.79円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.20円、1ブラジル・レアル=29.04円、1チェコ・コルナ=4.89円、100韓国・ウォン=9.78円、1オフショア・人民元=16.53円、1マレーシア・リンギット=27.02円、1南アフリカ・ランド=7.99円、1タイ・バーツ=3.50円、1ポーランド・ズロチ=29.27円、100ハンガリー・フォリント=38.96円、1ユーロ=125.24円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年4月11日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	159,538,749円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	33,429,278
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	11,836,248
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)	37,343,431
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	18,239,745
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	13,298,792
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	12,387,243
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	33,004,012
(B) 負 債	1,554,037
未 払 解 約 金	654,837
未 払 信 託 報 酬	896,040
そ の 他 未 払 費 用	3,160
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	157,984,712
元 本	150,275,904
次 期 繰 越 損 益 金	7,708,808
(D) 受 益 権 総 口 数	150,275,904口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,513円

(注) 期首における元本額は150,326,288円、当期中における追加設定元本額は16,604,344円、同解約元本額は16,654,728円です。

■損益の状況

当期 自2018年10月12日 至2019年4月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△33,104円
受 取 利 息	2,590
支 払 利 息	△35,694
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,470,191
売 買 益	6,945,360
売 買 損	△2,475,169
(C) 信 託 報 酬 等	△899,200
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,537,887
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,165,155
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,005,766
(配 当 等 相 当 額)	(3,716,149)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,710,383)
(G) 合 計(D+E+F)	7,708,808
次 期 繰 越 損 益 金(G)	7,708,808
追 加 信 託 差 損 益 金	2,005,766
(配 当 等 相 当 額)	(3,718,910)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,713,144)
分 配 準 備 積 立 金	7,293,517
繰 越 損 益 金	△1,590,475

(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	754,600円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	3,718,910
(d) 分 配 準 備 積 立 金	6,538,917
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	11,012,427
(f) 1万口当たり当期分配対象額	732.81
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

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16期 (決算日 2019年2月14日)

(計算期間 2018年2月15日～2019年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月3日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 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				
12期 (2015年2月16日)	12,161	1.8	ポイント 359.95	% 1.8	% 98.5	% -	% -	百万円 422,496
13期 (2016年2月15日)	12,614	3.7	373.37	3.7	98.6	-	-	400,593
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	-	-	379,734
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	-	-	355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	-	-	292,112

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

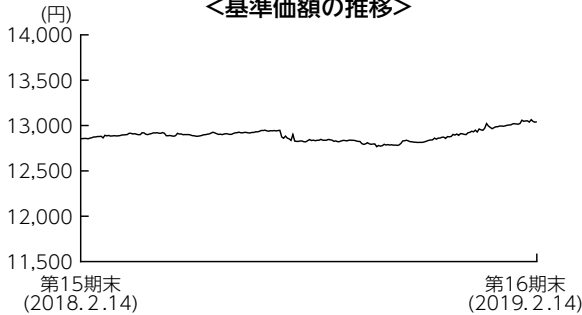
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率 比	新株予約債 権付社債 (転換社債) 率 比	債券先物率 比
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2018年 2月14日	円 12,855	% -	ポイント 380.56	% -	% 99.5	% -	% -
2 月 末	12,879	0.2	381.29	0.2	99.2	-	-
3 月 末	12,899	0.3	381.91	0.4	99.4	-	-
4 月 末	12,889	0.3	381.64	0.3	99.5	-	-
5 月 末	12,919	0.5	382.50	0.5	99.4	-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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月15日から2019年2月14日まで）

<基準価額の推移>



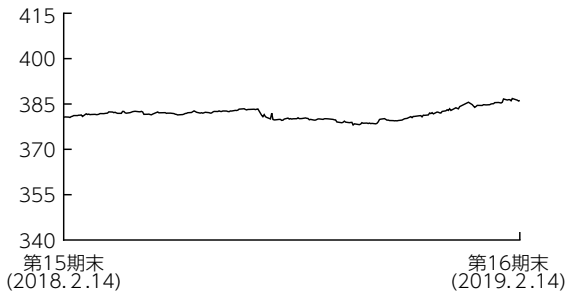
基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

<NOMURA-BPI総合の推移>



投資環境

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

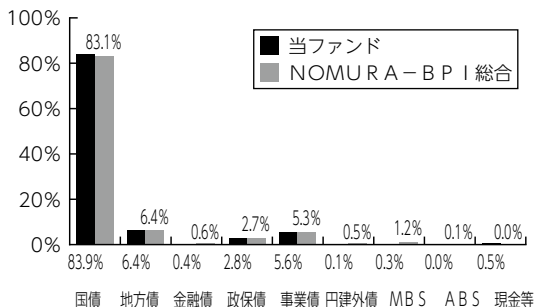
ポートフォリオについて

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

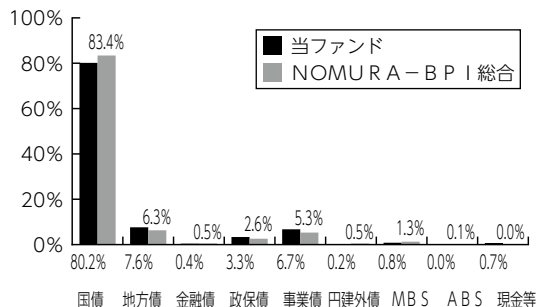
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○**セクター別構成比**

期首 (前期末)

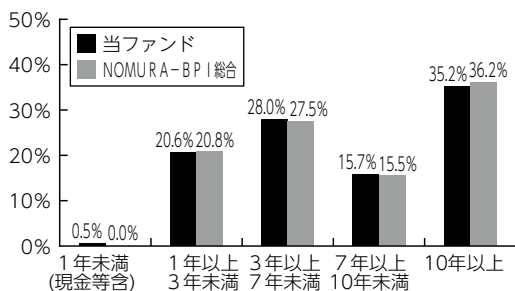


期末

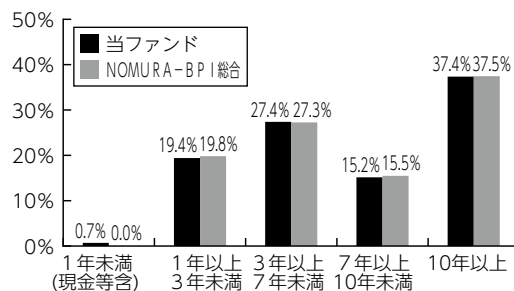


○**残存年限別構成比**

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークは、前期末比で1.5%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(12,890円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

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

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 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 122,124	百万円 8,273	% 6.8	百万円 187,356	百万円 10,434	% 5.6

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

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

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	680,000	941,616	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,210,000	1,231,453	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,220,000	1,239,666	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	900,000	1,233,792	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	880,000	925,443	2038/09/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	960,000	1,302,816	2039/03/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	700,000	939,736	2039/09/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	960,000	1,312,204	2040/03/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,070,000	1,403,326	2040/09/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,040,000	1,411,363	2041/03/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,120,000	1,477,548	2041/09/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,050,000	1,390,420	2042/03/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,020,000	1,332,619	2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	720,000	927,223	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	630,000	826,786	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	650,000	838,734	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	510,000	647,388	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	680,000	863,838	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	700,000	889,931	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	610,000	776,975	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	700,000	859,222	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	930,000	1,142,002	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	760,000	952,371	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	740,000	892,136	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	790,000	952,637	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	760,000	802,902	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	650,000	604,194	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	910,000	890,562	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	650,000	652,333	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	650,000	685,366	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	740,000	779,627	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	700,000	736,862	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	760,000	799,337	2047/12/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,010,000	1,061,338	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	800,000	818,936	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	640,000	689,113	2048/09/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	460,000	658,503	2049/03/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	490,000	705,595	2050/03/20
4回 利付国庫債券(40年)	2.2000	640,000	928,032	2051/03/20
5回 利付国庫債券(40年)	2.0000	580,000	812,029	2052/03/20
6回 利付国庫債券(40年)	1.9000	580,000	799,042	2053/03/20
7回 利付国庫債券(40年)	1.7000	630,000	833,294	2054/03/20
8回 利付国庫債券(40年)	1.4000	720,000	886,924	2055/03/20
9回 利付国庫債券(40年)	0.4000	1,100,000	998,415	2056/03/20

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

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

銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	310,050	2024/09/13
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	515,505	2025/03/31
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 1 0 年	0.0900	400,000	401,432	2026/04/28
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	200,000	202,362	2027/04/13
3 0 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	811,544	2027/04/30
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	302,079	2027/11/19
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	303,651	2028/02/18
1 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.0700	200,000	236,678	2028/12/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	240,610	2029/09/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	237,772	2030/10/29
1 2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	592,880	2030/10/31
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	424,739	2031/06/13
1 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	238,446	2031/12/26
1 3 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	1.9600	16,924	17,384	2032/05/10
1 4 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	1.7000	85,360	87,311	2032/05/10
1 5 回 国際協力機構債	1.7240	100,000	118,357	2032/09/17
2 4 回 政保地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.7020	200,000	236,216	2032/09/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	400,000	540,344	2033/12/20
2 3 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	338,991	2035/02/28
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.2980	200,000	226,540	2035/06/28
1 7 2 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	192,932	2036/06/20
6 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	42,762	44,886	2037/05/10
8 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	30,140	31,723	2037/05/10
9 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	44,832	47,035	2037/05/10
3 1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	205,962	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	275,914	2037/09/18
2 回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	2.2700	47,898	50,841	2037/11/10
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	16,027	16,931	2041/06/10
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	60,532	63,807	2041/07/10
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	45,024	47,286	2042/02/10
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	76,495	80,007	2042/05/10
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	160,090	172,354	2044/10/10
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	277,296	294,929	2045/05/10
2 6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	235,020	2045/10/31
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	223,767	2047/03/20
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	285,063	287,925	2052/11/10
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	286,293	288,944	2053/01/10
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	290,136	292,329	2053/04/10
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	290,742	292,928	2053/05/10
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	296,253	300,163	2053/10/10
小 計	-	16,423,867	17,541,186	-
(金融債券)	%	千円	千円	
い第779号 利付商工債	0.2200	200,000	200,430	2020/04/27
い第783号 利付商工債	0.2400	300,000	300,918	2020/08/27

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

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

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

■投資信託財産の構成

2019年2月14日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月14日)現在

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

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

■損益の状況

当期 自2018年2月15日 至2019年2月14日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2019年2月7日）

（計算期間 2018年2月8日～2019年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

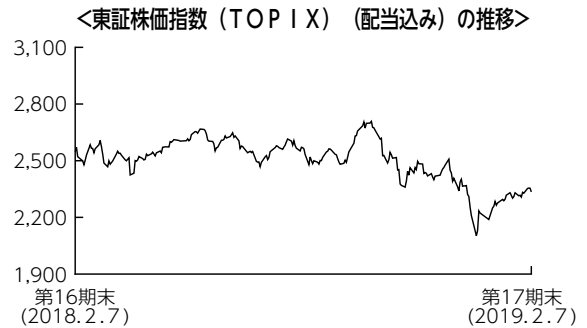
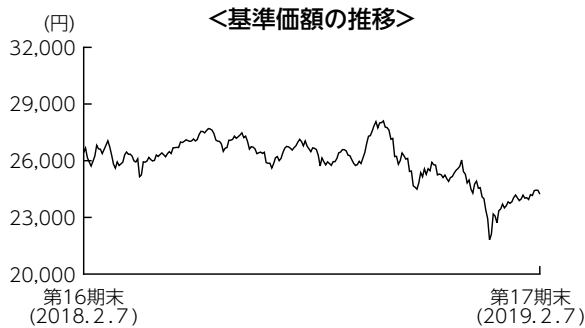
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月8日から2019年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は24,228円となり、前期末に比べ8.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種
 期首 (前期末)

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



期末

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

○組入上位10銘柄
 期首 (前期末)

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



期末

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で8.3%下落しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,984円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2018年2月8日から2019年2月7日まで)

(1) 株 式

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

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円	百万円	百万円	百万円
		100,959	98,142	-	-

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2018年2月8日から2019年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 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 50,317	百万円 -	% -	百万円 31,359	百万円 5	% 0.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 55

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
水産・農林業 (0.1%)		千株	千円		千株	千円	北野建設	27	2.9	9,193	昭和産業	10.4	11.4	33,812		千株	千円		千株	千円
極洋	5	5.4	15,206		5.4	15,206	植木組	1.6	1.8	4,060	鳥越製粉	10.1	11.1	8,746		千株	千円		千株	千円
日本水産	143	166.5	122,710		166.5	122,710	三井ホーム	16	-	-	中部飼料	13.9	15	16,920		千株	千円		千株	千円
マルハニチロ	24.1	24.1	87,121		24.1	87,121	矢作建設工業	17.3	18.8	13,742	フィード・ワン	76.6	83	14,442		千株	千円		千株	千円
カネコ種苗	4.4	4.6	6,035		4.6	6,035	ビーエス三菱	15.1	14.5	8,352	東洋精糖	2	2	2,179		千株	千円		千株	千円
サカタのタネ	18.8	20.2	73,023		20.2	73,023	日本ハウスホールディングス	24.3	26.2	11,397	日本甜菜製糖	6.5	7	12,341		千株	千円		千株	千円
ホクト	12.9	14	27,412		14	27,412	大東建設	46	49	745,780	三井製糖	9	9.7	27,994		千株	千円		千株	千円
ホクリヨウ	1.6	2.3	1,405		2.3	1,405	新日本建設	15.1	16.4	17,941	塩水港精糖	13.7	14.4	3,182		千株	千円		千株	千円
鉱業 (0.3%)							NIPPO	29.4	36.4	76,076	日新製糖	5.4	5.8	11,814		千株	千円		千株	千円
住石ホールディングス	33.7	35.9	3,590		35.9	3,590	東亜道路工業	2.6	2.6	8,008	森永製菓	26.7	31	140,895		千株	千円		千株	千円
日鉄鉱業	3.5	3.9	18,271		3.9	18,271	前田道路	40	43.1	93,096	中村屋	2.9	3	12,780		千株	千円		千株	千円
三井鉱山ホールディングス	6.5	6.9	9,694		6.9	9,694	日本道路	3.4	3.8	24,206	江崎グリコ	31.8	36.9	205,164		千株	千円		千株	千円
国際石油開発帝石	617.8	668.6	678,629		668.6	678,629	東亜建設工業	10.3	12.1	17,327	名糖産業	5.5	5.9	8,419		千株	千円		千株	千円
日本海洋掘削	4.4	-	-		-	-	若築建設	6.9	6.9	10,094	井村屋グループ	4.5	5.2	12,698		千株	千円		千株	千円
石油資源開発	20.1	24	49,728		24	49,728	東洋建設	39.9	50.3	20,723	不二家	7.3	6.9	15,635		千株	千円		千株	千円
K&Oエナジーグループ	7.5	8	11,664		8	11,664	五洋建設	151.1	163.3	102,552	山崎製パン	93.1	100.8	216,115		千株	千円		千株	千円
建設業 (2.9%)							世紀東急工業	17.2	20.1	12,341	第一屋製パン	2	2.1	2,137		千株	千円		千株	千円
ヒノキヤグループ	-	3.5	7,122		3.5	7,122	福田組	4.1	4.5	19,530	モロゾフ	1.9	2	9,800		千株	千円		千株	千円
ショボンドホールディングス	12	11.9	93,415		11.9	93,415	住友林業	81.2	97.5	136,890	亀田製菓	7.1	7.6	39,140		千株	千円		千株	千円
ミライト・ホールディングス	39.1	46.9	75,978		46.9	75,978	日本基礎技術	14.2	14.4	4,867	寿スベリッツ	11	13	55,445		千株	千円		千株	千円
タマホーム	9.6	10.3	12,174		10.3	12,174	日成ビルド工業	18.8	-	-	カルビ	51.8	56.1	175,873		千株	千円		千株	千円
サンヨーホームズ	2.3	2.5	2,092		2.5	2,092	ヤマダ・エスバイエルホーム	58	-	-	森永乳業	22.8	24.6	77,490		千株	千円		千株	千円
日本アクア	4	4.1	1,767		4.1	1,767	BCOコーポレーション	15.9	17.1	6,805	六甲バター	5.7	9	17,874		千株	千円		千株	千円
ファーストコーポレーション	4.3	4.6	3,491		4.6	3,491	大和ハウス工業	375.3	380.8	1,287,484	ヤクルト本社	68.1	91.3	648,230		千株	千円		千株	千円
ベステラ	1.8	3.2	4,272		3.2	4,272	ライト工業	24.5	26.4	35,904	明治ホールディングス	75.3	87.2	721,144		千株	千円		千株	千円
T A T E R U	11.2	20.2	5,959		20.2	5,959	積水ハウス	413.3	420.8	679,381	雪印メグミルク	27.4	29.6	77,788		千株	千円		千株	千円
スペースリゾールホールディングス	-	20.3	19,325		20.3	19,325	日特建設	10.9	11.8	7,363	プリマハム	80	17.3	34,669		千株	千円		千株	千円
ダイセキ環境ソリューション	3	3.2	2,051		3.2	2,051	北陸電気工事	7.1	6.7	6,036	日本ハム	98	53.2	230,888		千株	千円		千株	千円
第一カッター興業	1.3	1.9	3,562		1.9	3,562	ユアテック	20	22.1	19,934	林業産業	4.1	4.3	2,494		千株	千円		千株	千円
安藤・間	97.8	106.4	80,757		106.4	80,757	西部電気工業	2.1	-	-	丸大食品	6.1	13.3	24,312		千株	千円		千株	千円
東急建設	48.9	48.8	47,775		48.8	47,775	四電工	1.9	2	5,334	S Foods	8	11.1	43,734		千株	千円		千株	千円
コムシホールディングス	44.7	59.1	165,361		59.1	165,361	中電工	16.4	17.6	40,180	伊藤ハム株式会社ホールディングス	73.3	79.3	49,959		千株	千円		千株	千円
ミサワホーム	10.6	13.1	9,589		13.1	9,589	関電工	50.6	62.6	62,224	サッポロホールディングス	41.6	45.1	111,938		千株	千円		千株	千円
ビーホールホールディングス	12.6	13.8	4,899		13.8	4,899	きんでん	84.5	91.5	161,314	アサヒグループホールディングス	238.4	257.9	1,220,382		千株	千円		千株	千円
藤松コンストラクショナルグループ	8.2	10.3	28,644		10.3	28,644	東京エネシス	14.4	14.2	14,498	キリンホールディングス	547	557.2	1,474,980		千株	千円		千株	千円
東建コーポレーション	4.7	5.1	32,895		5.1	32,895	トーエネック	3.6	3.8	12,331	宝ホールディングス	85.2	92.2	111,746		千株	千円		千株	千円
ソネット	1.6	1.8	1,258		1.8	1,258	住友電設	10.1	9.5	17,052	オノンホールディングス	32.5	35.2	12,672		千株	千円		千株	千円
ヤマウラ	6	6.5	6,305		6.5	6,305	日本電設工業	19.5	23.5	53,298	養命酒製造	3.5	3.9	8,034		千株	千円		千株	千円
大成建設	126.5	136.8	663,480		136.8	663,480	協和エクシオ	45.6	53.8	145,582	コトコロ ホテラズ/ホテルホールディングス	79.9	94.3	322,977		千株	千円		千株	千円
大林組	381	412.3	419,309		412.3	419,309	新日本空調	9.8	11.7	21,258	サントリー食品インターナショナル	87	82.4	401,700		千株	千円		千株	千円
清水建設	388.6	420.5	388,962		420.5	388,962	NDS	2	-	-	ダイドールグループホールディングス	5.8	6.9	36,432		千株	千円		千株	千円
飛鳥建設	115.9	11.8	17,133		11.8	17,133	九電工	25.1	27	106,245	伊藤園	37.7	37.4	188,496		千株	千円		千株	千円
長谷工コーポレーション	148.3	171.9	206,623		171.9	206,623	三機工業	26.9	31.6	35,676	キーコーヒー	11.2	12.2	24,668		千株	千円		千株	千円
松井建設	14	15.2	11,020		15.2	11,020	日揮	109.4	118.4	191,808	ユニカフェ	3.5	3.9	3,900		千株	千円		千株	千円
銭高組	1.8	1.8	9,594		1.8	9,594	中外炉工業	3.9	3.9	8,162	ジャパンフーズ	1.6	1.8	2,181		千株	千円		千株	千円
鹿島建設	558	322.2	494,899		322.2	494,899	ヤマト	10.5	12.4	5,753	日清オイリオグループ	13.4	15.9	50,562		千株	千円		千株	千円
不動テトラ	96.5	9.4	15,820		9.4	15,820	太平電業	8.6	9.3	22,905	不二製油グループ本社	30.8	30.1	108,661		千株	千円		千株	千円
大末建設	4.1	4.9	4,630		4.9	4,630	高砂熱学工業	35	34.6	58,197	かどや製油	1.2	1.3	6,526		千株	千円		千株	千円
鉄建建設	7.7	8.3	22,119		8.3	22,119	三晃金属工業	1.4	1.5	4,378	J-オイルミルズ	5.9	6.4	25,696		千株	千円		千株	千円
西松建設	29.3	29.6	75,835		29.6	75,835	朝日工業社	2.6	2.7	8,262	キッコーマン	88.9	81.3	418,695		千株	千円		千株	千円
三井住友建設	91.6	99.1	68,379		99.1	68,379	明星工業	23	24.9	16,932	味の素	261.7	271.9	449,314		千株	千円		千株	千円
大豊建設	46	9.3	32,689		9.3	32,689	大気社	16.8	18.8	53,486	キユーピー	63.4	68.6	170,608		千株	千円		千株	千円
前田建設工業	90.6	98.1	106,732		98.1	106,732	ダイダ	8.5	9.2	22,650	ハウス食品グループ本社	43.4	47	187,295		千株	千円		千株	千円
佐田建設	8.4	8.8	3,361		8.8	3,361	日比谷総合設備	14.2	13.1	23,855	カゴメ	45.6	49.4	139,406		千株	千円		千株	千円
ナカノフードー建設	9.7	10.5	5,481		10.5	5,481	東芝プラントシステム	27.5	29.7	58,509	焼津水産化学工業	5.5	6.1	6,581		千株	千円		千株	千円
奥村組	20.9	22.6	77,066		22.6	77,066	OSJ Bホールディングス	56.3	60.8	18,118	アリアケジャパン	10.4	11.3	79,213		千株	千円		千株	千円
東鉄工業	15.3	16.5	48,691		16.5	48,691	東洋エンジニアリング	15	16.2	12,295	ビエトロ	1.5	1.6	2,616		千株	千円		千株	千円
イチケン	2.3	2.6	5,166		2.6	5,166	千代田化工建設	82.5	99.1	33,297	エバラ食品工業	2.5	2.6	5,675		千株	千円		千株	千円
富士ピー・エス	-	4.3	2,214		4.3	2,214	新興プランテック	24.5	24.7	31,023	ニチレイ	54.2	64	171,008		千株	千円		千株	千円
浅沼組	45	4.9	14,523		4.9	14,523	食料品 (4.3%)				東洋水産	62.4	63.3	258,264		千株	千円		千株	千円
戸田建設	148	159.8	112,499		159.8	112,499	日本製粉	37.7	40.9	75,746	イトーアンド	3.2	4.3	7,030		千株	千円		千株	千円
熊谷組																				

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	千 円		株 数	株 数	評 価 額	千 円		株 数	株 数	評 価 額	千 円
日清食品ホールディングス	49.6	52.4	383,044	千株	レンゴー	114.5	124	114,824	千株	ミライアル	3.9	3.5	3,993	千株
永谷園ホールディングス	12	6.6	15,919	千株	トモク	6.8	7.4	11,766	千株	ダイキョウクス	4	4.3	4,145	千株
一正蒲鉾	4.4	4.9	5,081	千株	ザ・パック	8.4	9.1	27,982	千株	ダイキョーニシカフ	23.4	25.4	29,718	千株
フジッコ	12.3	13.4	30,471	千株	化学 (7.3%)				千株	竹本容器	1.3	4.3	6,054	千株
ロック・フィールド	12.3	13.4	20,595	千株	クラレ	199.9	202.9	331,944	千株	森六ホールディングス	4.5	6.5	16,542	千株
日本たばこ産業	704.1	711.1	1,938,814	千株	旭化成	740.7	855	986,242	千株	日本化薬	77.1	76.4	98,097	千株
ケンコーマヨネーズ	7.5	6.9	14,545	千株	昭和レザー	6.9	7.5	5,467	千株	カリットホールディングス	11	12.8	10,393	千株
からばや日洋ホールディングス	7.5	8	14,992	千株	昭和電工	79.1	79.8	285,684	千株	日本精工	9.9	9.7	10,864	千株
なとり	6.4	6.9	11,212	千株	住友化学	874	946	518,408	千株	扶桑化学工業	8.4	12.2	25,144	千株
イフジ産業	2	2.1	1,386	千株	住友精工	4.9	5.8	24,766	千株	トリケミカル研究所	-	2.7	12,879	千株
ピュウスクーパーション	1.7	3	6,078	千株	日産化学	69.1	73.8	408,852	千株	A D E K A	51.1	59.3	100,572	千株
北の達人コーポレーション	10.9	48.4	19,698	千株	ラサ工業	4.2	4.3	5,921	千株	日油	45.9	46.2	165,627	千株
ユープレナ	43.9	48.9	29,095	千株	クラレハ	10.3	11.1	74,148	千株	新日本理化	18.9	21.9	4,182	千株
ミヨシ油脂	4.4	5	5,240	千株	多木化学	1.6	3.4	18,394	千株	ハリマ化成グループ	9.2	10	10,960	千株
理研ビタミン	4.3	5.8	20,242	千株	テイカ	9.1	9.8	19,649	千株	花王	278.8	297.9	2,397,797	千株
繊維製品 (0.7%)				千株	石原産業	21.3	23.2	25,404	千株	第一工業製薬	23	4.5	12,613	千株
片倉工業	13.7	14.8	17,197	千株	片倉コープアグリ	2.9	3	3,507	千株	石原ケミカル	-	3.1	5,499	千株
グンゼ	8.9	8	41,440	千株	日東エフシー	6.9	7.7	5,882	千株	日華化学	3.8	4	3,796	千株
東洋紡	43.9	50.8	82,804	千株	日本曹達	82	19	56,468	千株	ニイタカ	1.7	1.9	2,846	千株
ユニチカ	34.6	35.2	17,283	千株	東ソー	171.7	185.7	291,734	千株	三洋化成工業	7.5	8	40,720	千株
富士紡ホールディングス	6.6	6.3	17,671	千株	トクヤマ	34.5	34.6	97,987	千株	有機合成薬品工業	8	8.3	1,726	千株
倉敷紡績	120	11.5	27,128	千株	セントラル硝子	24.2	26.2	65,788	千株	大日本塗料	13.6	13.7	14,385	千株
シキボウ	6	6.3	6,552	千株	東亜合成	69.7	75.4	95,607	千株	日本ペイントホールディングス	91.7	99.1	367,661	千株
日本毛織	33.4	39.4	33,923	千株	大阪ソーダ	10.7	12.9	32,688	千株	関西ペイント	124.8	135	257,445	千株
ダイトウボウ	18.8	19	1,634	千株	関東電化工業	28.4	28.5	25,564	千株	神東塗料	9	9.4	1,616	千株
トア紡コーポレーション	5.1	5	2,265	千株	デンカ	43.6	47.2	157,176	千株	中国塗料	34.1	39.4	37,627	千株
ダイドーリミテッド	13.5	15	5,175	千株	信越化学工業	197.8	211.8	1,957,879	千株	日本特殊塗料	7.5	9	11,475	千株
帝国繊維	12.4	13.5	33,615	千株	日本カーバイド工業	3.8	4.1	7,129	千株	藤倉化成	15	16.4	9,266	千株
帯人	97	98	178,458	千株	堺化学工業	8.1	7.9	18,264	千株	太陽ホールディングス	9.1	9.9	34,551	千株
東レ	861.5	932.2	742,870	千株	第一稀元素化学工業	-	9.8	8,839	千株	D I C	46.9	54.4	188,768	千株
サカイオーベックス	3.1	3	5,889	千株	エア・ウォーター	97.9	98.5	179,762	千株	サカタインクス	24.2	26.2	32,226	千株
住江織物	3	3.2	8,019	千株	大陽日酸	91.5	99	156,816	千株	東洋インキS Cホールディングス	11.7	25.4	61,442	千株
日本ファルコ	6.4	6.6	2,943	千株	日本化学工業	4.4	4.1	10,721	千株	T & K TOKA	7.9	9.4	9,315	千株
イチワフ	8	1.8	2,469	千株	東邦アセチレン	1.7	1.9	2,580	千株	富士フイルムホールディングス	235.5	254.8	1,188,387	千株
日東製綱	1.3	1.4	1,792	千株	日本パーカライズン	60.7	65.6	90,068	千株	資生堂	211.2	243.8	1,755,360	千株
アツギ	7.9	10	9,520	千株	高圧ガス工業	17.6	19.2	14,630	千株	ライオン	158	171	405,783	千株
ダイニッ	4.6	4.7	3,468	千株	チタン工業	1.3	1.5	3,769	千株	高砂香料工業	7.1	8.5	29,877	千株
セーレン	27.3	29.5	55,460	千株	四国化成工業	17.1	20.2	25,876	千株	マンダム	22.1	27.6	73,002	千株
ソトー	4.4	4.6	4,296	千株	戸田工業	2.4	2.6	5,829	千株	ミルボン	15.2	15.1	68,554	千株
東海染工	1.7	1.8	1,791	千株	ステラ ケミファ	6.1	7	20,762	千株	ファンケル	27.5	54.6	130,384	千株
小松マテール	18.2	19.7	15,070	千株	保土谷化学工業	3.9	4.2	11,743	千株	コーセー	19.2	20.8	355,264	千株
ワコールホールディングス	32.8	35	95,830	千株	日本触媒	18.7	20.2	150,490	千株	コタ	4.9	5.8	8,439	千株
ホギメディカル	7.5	14.9	55,428	千株	大日精化工業	9.2	9.9	29,284	千株	シーズ・ホールディングス	15.4	-	-	千株
レナウン	32.3	35	3,465	千株	カネカ	160	32	137,920	千株	シーボン	1.4	1.4	3,725	千株
クラウディアホールディングス	2.9	2.9	1,374	千株	三菱瓦斯化学	97.9	123.7	217,588	千株	ポーラ・オルビスホールディングス	48.4	52.4	173,182	千株
T S Iホールディングス	44.8	44.3	30,744	千株	三井化学	108	109	300,404	千株	ノビアホールディングス	7.2	7.7	39,578	千株
マツカコーポレーション	2.1	3.9	10,221	千株	J S R	119.4	120.6	217,924	千株	アジエパルメックス	2.6	2.8	2,671	千株
ワールド	-	12.4	24,093	千株	東京応化工業	20.6	20.6	65,405	千株	エステー	8.1	8.8	16,016	千株
三陽商会	6.2	7.2	12,600	千株	大阪有機化学工業	7.7	11.1	12,742	千株	アグロ カネシオウ	4.6	5	10,770	千株
ナイガイ	4.4	4.6	2,428	千株	三菱ケミカルホールディングス	795.4	803.4	680,078	千株	コニシ	18.6	21.8	39,087	千株
オンワードホールディングス	70.9	72.3	46,127	千株	K Hネオケム	18.2	18.3	48,092	千株	長谷川香料	15	14.6	23,506	千株
ルックホールディングス	20	4.4	4,809	千株	ダイセル	160.2	186.7	199,208	千株	星光 P M C	6.5	8.1	6,228	千株
キムラタン	55.5	57.1	1,313	千株	住友ベークライト	96	20.8	85,176	千株	小林製薬	31.8	34.4	283,800	千株
ゴールドウイン	3.4	10.9	117,284	千株	積水化学工業	246.7	262.6	444,581	千株	荒川化学工業	10.2	11.1	14,474	千株
デサント	27.1	29.3	77,293	千株	日本ゼオン	100.2	108.4	122,166	千株	メック	7.8	8.5	9,469	千株
キング	5.8	6.2	3,490	千株	アイカ工業	33.3	36	136,620	千株	日本高純度化学	3.1	3.2	7,136	千株
ヤマトインターナショナル	8.1	7.9	3,231	千株	宇部興産	59.8	60.6	152,166	千株	タカラバイオ	29.7	32.1	74,953	千株
パルプ・紙 (0.3%)				千株	積水樹脂	18.3	19.8	40,728	千株	J C U	7	15.9	28,111	千株
特種東海製紙	6.5	7.6	30,438	千株	タキロンシーアイ	24	26	15,938	千株	新田ゼラチン	7.8	7.7	5,320	千株
王子ホールディングス	500	541	330,010	千株	旭有機材	7	8.3	13,495	千株	O A Tアグリオ	1.6	1.8	3,796	千株
日本製紙	53.2	57.5	118,162	千株	日立化成	58.7	55.5	106,671	千株	デクセリアルズ	29.9	31.6	24,964	千株
三菱製紙	16.9	19.7	10,421	千株	ニチパン	5.8	6.3	12,883	千株	アース製薬	8.5	9.3	48,081	千株
北越コーポレーション	66.3	79.7	47,501	千株	リケンテクノス	25.6	32.9	14,837	千株	北興化学工業	11.7	12.8	6,745	千株
中越パルプ工業	4.7	5.1	6,823	千株	大倉工業	28	6.2	11,488	千株	大成ラミック	3.5	3.7	10,448	千株
巴川製紙所	18	4.1	4,202	千株	積水化成製品工業	14.9	17.8	16,927	千株	クミアイ化学工業	51.6	50.7	33,816	千株
大王製紙	47.3	58.5	82,777	千株	群栄化学工業	2.8	2.9	7,737	千株	日本農薬	29.6	29.4	14,229	千株
阿波製紙	2.9	3	1,416	千株	タイガースポリマー	5.9	6.5	3,737	千株	アキレス	8.6	9	18,423	千株

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	評 価 額		株	数	株	株	数	評 価 額		株	数	株	株	数	評 価 額
		千株			千株	千円			千株		千株	千円			千株		千株		千株	千円
有沢製作所		19			19.3	16,076	コスモエネルギーホールディングス		32.8		35.5	84,632	愛知製鋼		6.3		6.8		23,358	
日東電工		85.6			92.7	561,298	ゴム製品 (0.8%)						日立金属		120.8		130.8		143,487	
レック		6.7			13.1	22,152	横浜ゴム		65.6		71.2	163,332	日本金属		2.8		2.8		3,318	
三光合成		-			9.5	3,486	TOYO TIRE		67.2		63	94,248	新大洋金属		6.9		8.1		23,984	
きもと		19.4			20.9	4,012	ブリヂストン		400.8		377.1	1,573,261	大日本電工		67.2		72.6		16,552	
藤森工業		9.5			11	31,801	住友ゴム工業		116.7		110.2	166,622	栗本鐵工所		5.7		6.2		8,804	
前澤化成工業		7.8			8.6	9,116	藤倉ゴム工業		9.9		10.9	4,959	虹 技		1.7		1.8		2,444	
未来工業		-			6.6	15,503	オカモト		39		8.6	49,278	日本鑄鉄管		12		1.3		1,224	
ウェーブロックホールディングス		-			2.6	2,022	フコク		5		5.5	4,735	三菱製鋼		8.3		9.1		14,469	
J S P		6.6			7.1	17,586	ニッタ		11.7		13.9	52,125	日亜鋼業		16.5		17.2		5,005	
エフピコ		9.3			10.1	61,509	住友理工		22		23.9	24,306	日本精線		1.8		1.8		6,075	
天馬		8.8			8.6	15,514	三ツ星ベルト		28		16.2	33,647	エンビロ・ホールディングス		-		2.5		1,252	
信越ポリマー		23.3			22.1	17,967	パンドー化学		21.6		23.5	26,602	シンニッタン		8.7		1.9		6,175	
東リ		28.2			30.7	7,705	ガス・土石類 (0.9%)						新家工業		2.6		2.7		4,336	
ニフコ		20.8			49.1	133,404	日東紡績		16.9		18.3	35,227	非鉄金属 (0.8%)							
パルカー		9.2			9.9	22,275	AGC		115.9		121.4	469,211	大紀アルミニウム工業所		18.5		19.9		11,800	
ユニ・チャーム		240.4			260.2	906,016	日本板硝子		57.3		58.6	54,732	日本軽金属ホールディングス		327.4		330.6		79,013	
医薬品 (5.4%)							石塚硝子		1.5		1.6	2,924	三井金属鉱業		30.3		32.8		84,624	
協和発酵キリン		142.1			153.7	331,684	日本山硝子		47		5.2	7,779	東邦亜鉛		6.2		6.7		23,919	
武田薬品工業		417.7			777.5	3,465,317	日本電気硝子		49		53.1	152,662	三菱マテリアル		74.1		80.1		243,504	
アステラス製薬		1,165.4			1,131.4	1,879,255	オハラ		4.5		4.8	7,915	住友金属鉱山		143.3		166.1		527,367	
大日本住友製薬		84.1			91	235,963	住友大阪セメント		2.20		24.7	118,807	DOWAホールディングス		28.4		28.4		97,696	
塩野義製薬		162.2			160.6	1,064,938	太平洋セメント		71.6		77.4	288,702	古河機械金属		18.5		20		26,920	
田辺三菱製薬		138.4			128.3	206,691	日本ヒューム		11.4		12.4	9,734	エス・サイエンス		53.4		53.7		3,436	
わかもと製薬		14			14.3	3,875	日本コンクリート工業		24.5		26.6	7,288	大畑チタニウムテクノロジーズ		11.7		14.1		23,462	
あすか製薬		12.9			15.1	18,527	三谷セキサン		5.9		5.7	14,962	東邦チタニウム		20.1		21.8		20,819	
日本新薬		29.7			32.1	231,120	アジアパイルホールディングス		14.7		17.3	11,158	U A C J		17		18.5		40,330	
ピオフェルミン製薬		1.9			2	4,780	東海カーボン		103		111.4	164,537	C K サンエツ		-		2.3		5,568	
中外製薬		118.2			127.9	883,789	日本カーボン		5.8		5.8	24,302	古河電気工業		37.3		35		120,225	
科研製薬		20.5			22.2	119,880	東洋炭素		7.4		7.2	17,200	住友電気工業		419.2		453.6		689,472	
エーザイ		135.7			146.8	1,264,094	リタカカンパニリミテド		6.7		7.3	37,449	フジクラ		135.4		146.4		71,443	
ロート製薬		62.3			62.9	185,932	T O T O		87.2		94.4	409,224	昭和電線ホールディングス		14.1		14.1		9,602	
小野薬品工業		267.8			289.9	656,333	日本硝子		138.4		149.7	242,064	東京特殊電線		1.4		1.6		3,144	
久光製薬		33.5			36.2	197,652	日本特殊陶業		97.3		103.5	229,977	タツタ電線		22.3		24.1		12,050	
持田製薬		7.9			9.3	92,814	ダントホールディングス		9		9.4	1,109	カナレ電線		1.9		2		3,658	
参天製薬		214.7			232.6	345,876	M A R U W A		3.9		4.3	25,499	平河ヒューテック		5.6		5		7,425	
扶桑薬品工業		4			4.2	10,613	品川リフラクトリーズ		3		3.2	11,696	リョービー		13.8		14.9		42,599	
日本ケミファ		1.5			1.6	4,832	黒崎播磨		2.2		2.5	13,600	アーレスティ		13.8		14.9		9,595	
ツムラ		40.5			38.1	122,872	ヨータイ		6.8		10.7	7,490	アセビホールディングス		18.8		22.9		48,296	
日医工		29.9			30.1	48,972	インサイト工業		5.8		6.3	4,032	金属製品 (0.6%)							
キッセイ薬品工業		21			21.8	62,740	東京窯業		14.5		15.7	5,981	稲葉製作所		6.3		6.9		8,459	
生化学工業		22			23.8	30,368	ニッカトール		3.9		5.5	5,214	宮地エンジニアリンググループ		3.2		3.8		7,634	
栄研化学		9.2			21.6	53,157	アジミンコーポレートド		10.1		11	25,311	トーカロ		7.8		31.3		29,077	
日水製薬		4.8			5.2	6,073	クニミネ工業		-		4.2	3,414	アルファ		4		4.3		5,516	
鳥居薬品		7.1			6.6	14,223	エーアンドエーマテリアル		2.5		2.6	2,636	S U M C O		103.3		134.1		210,671	
J C R ファーマ		8			8.7	50,460	ニチアス		62		33.6	66,897	川田テクノロジーズ		2.3		2.7		18,387	
東和薬品		5.4			5.8	44,950	ニチハ		17.1		17	52,020	R S Technologies		1.6		2.5		7,485	
富士製薬工業		3.9			8.3	15,097	鉄鋼 (1.0%)						東洋製鋼		76.6		77.2		189,603	
沢井製薬		22.8			25.1	137,046	新日鐵住金		501.8		563.9	1,148,946	ホッカンホールディングス		28		6.2		10,744	
ゼリア新薬工業		24.3			24.3	46,315	神戸製鋼所		205.3		222	194,250	コロナ		6.2		6.8		6,956	
第一三共		324.5			351.1	1,265,364	中山製鋼所		15.5		16.8	7,896	福岡アジックホールディングス		20.9		22.6		43,437	
キョーリン製薬ホールディングス		31.7			27	60,723	合同製鐵		6.1		5.8	10,126	駒井ハルテック		2.5		2.4		4,538	
大幸薬品		6			5.4	9,417	ジェイ エフ イー ホールディングス		302.8		327.7	628,856	高田機工		1		1		2,756	
ダイト		6.6			7.1	19,951	日新製鋼		30.9		-	-	三和ホールディングス		107.5		125.3		163,140	
大塚ホールディングス		235.7			233.7	1,033,888	東京製鐵		60.1		64.9	58,994	文化シヤッター		33		35.8		28,425	
大正製薬ホールディングス		25.4			27.4	299,208	共英製鋼		12.6		13.7	21,961	三協立山		15.5		16.8		23,116	
ペプチドリーム		50.8			61.2	290,394	大和工業		23.8		25.8	75,516	アルインコ		8.2		9.7		9,467	
石油・石炭製品 (0.7%)							東京鐵鋼		4.6		5	5,925	東洋シヤッター		2.9		3		2,103	
日本コープス工業		96.1			104.2	10,420	大阪製鐵		7.4		8	15,296	LI X I L グループ		165.3		179.1		287,992	
昭和シェル石油		106.1			113.5	178,535	淀川製鋼所		16.4		16.4	35,522	日本フィルコン		8.7		9.4		4,869	
ニチレキ		14.5			15.8	16,590	東洋鋼板		28.4		-	-	ノーリツ		25		27		41,607	
ユシロ化学工業		6.4			6.4	7,865	丸一鋼管		39.7		43	148,995	長府製作所		12.6		12.4		25,469	
ピービー・カストロール		4.9			4.4	5,900	モリ工業		3.7		3.7	8,894	リンヤ		20		21.7		157,976	
富士石油		27.6			29.7	8,939	大同特殊鋼		19.9		19.8	86,625	ダイニチ工業		6		6.4		4,588	
M O R E S C O		4.1			4.5	7,294	日本高周波工業		4.2		4.6	2,507	日東精工		15.5		16.7		8,867	
出光興産		95.2			95.1	352,345	日本冶金工業		92.8		100.3	24,272	三洋工業		1.4		1.5		2,877	
J X T Gホールディングス		1,809.7			2,063.9	1,178,486	山陽特殊製鐵		12.9		15.2	35,765	岡部		22.7		24.6		21,156	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	価 額	株	数	価 額		株	数	価 額	株	数	価 額		株	数	価 額	株	数	価 額
		千株	千円			千株	千株	千株	千円			千株	千株	千株	千円			千株	千円	
ジーテクト		12.4	13.5	21,073		9.4	10.2	9,618					T P R		12.7	16.5	38,065			
中国工業		1.7	1.9	1,081		3.3	4.2	6,211					ツバキ・ナカシマ		11.4	18.5	31,468			
東プレ		20.9	22.6	53,810		3.8	4.9	3,248					ホシガキ		35.7	35.8	275,660			
高周波熱錬		21.6	23.5	21,056		547.5	555.5	1,485,684					大豊工業		9.2	10	10,290			
東京製綱		8.1	7.4	7,237		64.9	70.2	260,793					日本精工		232.9	252	268,884			
サンコール		6.3	6.9	4,395		53	49.1	136,154					NTN		262.4	263.7	90,449			
モリテックスチール		6.6	9.5	3,961		3.1	3.4	7,775					ジェイテクト		120.8	117.7	160,542			
パイオラックス		16.6	19.4	42,815		4.8	5.2	13,000					不二越		105	11.4	49,077			
エイチワン		8.3	12	13,260		11.3	12.3	20,393					日本トムソン		36.3	36.4	20,966			
日本発条		111.7	120.9	124,527		8.8	10.4	6,999					THK		70.7	76.5	206,014			
中央発條		1.3	1.4	4,048		2.5	2.6	3,546					ユーシン精機		5	9.5	8,597			
アドパネクス		1.8	1.6	2,468		5.4	5.5	12,507					前澤綯袋工業		4.4	4.8	8,707			
立川プラインド工業		5	5.4	5,313		5.6	5.3	8,904					イーグル工業		14	15.1	19,871			
三益半導体工業		8.7	9.5	13,642		3.6	4.4	2,657					前澤工業		7.8	9.1	3,221			
機械 (4.9%)						608.2	658.2	1,119,927					日本ビラー工業		11.5	12.4	16,603			
日本ドライケミカル		1.5	3.4	3,954		3.3	3.5	7,245					キッツ		50.5	49.7	45,028			
日本製鋼所		36.6	36.7	74,794		3.9	4.3	6,617					マキタ		147.9	149.3	582,270			
三浦工業		48.5	52.6	125,766		22.5	24.3	33,631					日立造船		89.9	97.1	35,247			
タクマ		38	44.2	61,482		7.9	8.6	10,294					三菱重工業		190	205.6	872,566			
ツガミ		30	27.1	19,268		4.5	4.7	1,800					IHI		87.1	94.3	321,091			
オークマ		13.1	15.4	89,782		26.9	29.1	27,965					スター精機		18.2	21.1	33,464			
東芝機械		63	13.7	29,961		9.9	10.7	40,446					電気機器 (13.0%)							
アマダホールディングス		173	187.2	201,427		19.6	21.2	14,903					日清紡ホールディングス		69.3	68.1	63,128			
アイデンエンジニアリング		28.5	33.7	26,656		28.5	33.2	37,682					イビデン		69.4	75.1	109,120			
滝澤鉄工所		3.5	3.9	6,555		9.5	9.6	17,222					コニカミノルタ		265.4	268.1	286,598			
F U J I		33.6	36.3	52,308		19	2	5,836					ブラザー工業		138.5	159.9	324,916			
牧野フライス製作所		56	14.2	60,634		2.1	2.3	5,428					ニセアミツミ		210.5	227.8	418,924			
オーエスジー		51.7	59.7	135,399		46.6	54.4	166,192					日立製作所		2,723	552.4	1,935,057			
ダイジェット工業		1.4	1.4	2,244		1.8	1.9	3,467					三菱電機		1,133.9	1,227	1,706,143			
旭ダイヤモンド工業		33.3	31.8	23,436		11.6	12.6	11,881					富士電機		342	79.6	258,700			
DMG森精機		62.1	76.7	114,743		12.8	12.7	15,240					東洋電機製造		4.5	4.8	6,254			
ソディック		24.4	26.4	21,648		154.8	167.5	1,968,962					日立電機		131.4	142.2	443,664			
ディスコ		15.2	16.4	271,748		4.1	4.5	12,546					シフニアテクノロジー		73	17	23,239			
日東工器		6.9	6.6	14,869		4.8	4.6	10,842					明電舎		96	24.3	39,293			
日進工具		3	3.7	9,113		61.4	66.4	186,052					オリソン電気		3.3	3.3	6,263			
パンチ工業		9.4	8.5	4,496		67	16	65,360					山洋電気		5.5	5.9	23,511			
富士ダイス		4.3	5.4	3,504		4.3	5.8	5,144					デンヨー		10.5	11.3	16,012			
豊和工業		6.2	6.7	5,715		9.6	10.2	3,886					東芝テック		81	15.3	41,264			
OKK		4.3	5	4,235		19.1	19.1	18,202					芝浦メカトロニクス		17	2.2	7,854			
石川製作所		2.9	2.9	3,433		57.7	67.4	376,092					マブチモーター		31.6	33.9	131,362			
東洋機械金属		8.8	8.8	5,139		3.1	3.4	3,352					日本電産		136.5	147.7	1,941,516			
津田駒工業		27	2.6	4,872		5.4	6.3	17,173					ユ・エム・シー・エレクトロニクス		4.1	6.6	11,259			
エンシュウ		29	3.2	3,564		2.2	2.2	4,331					トレックス・セミコンダクター		-	4.2	5,363			
島精機製作所		14.2	16.7	59,619		54.7	59.2	70,566					東光高岳		5.7	6.2	8,909			
オプトラン		8.2	11.9	22,848		36.3	44.6	52,494					ダブル・スコープ		16.5	17.8	20,559			
NCホールディングス		3.6	3.8	1,835		31.5	34.1	36,964					宮越ホールディングス		4.3	4.6	4,540			
フリユー		8	9.7	9,952		8.6	9.3	15,763					ダイヘン		62	13.5	37,125			
ヤマシンフィルタ		15.3	21.1	13,567		35.1	34.2	77,292					田淵電機		15.8	16.5	2,029			
日阪製作所		16.1	15	12,840		11.2	10.9	18,813					ヤーマン		16.4	17.7	24,355			
やまびこ		21.7	23.6	26,078		28.4	30.7	126,177					JVCケンウッド		83.3	89.9	24,452			
平田機工		3.1	5.7	37,107		10.5	13.6	13,205					ミキエンジニアリング		10.2	11	8,910			
ペガサスミシン製造		10.5	11.4	7,364		7.2	7.7	16,362					第一精工		5.3	5.1	6,257			
マルマエ		-	3.3	2,392		7	7.5	28,987					日新電機		26.6	28.8	28,137			
タツモ		-	3.9	3,525		4.8	5	1,750					大崎電気工業		24.3	24.4	17,470			
ナプテスコ		61.7	66.7	189,294		5.2	5.6	8,159					オムロン		120.5	130.3	630,000			
三井海洋開発		11.9	12.9	40,377		19	20.5	40,754					日東工業		18.2	19.6	42,708			
レオン自動機		10	12	16,740		35.1	35.1	82,941					I D E C		14	16.4	33,718			
S M C		35.6	35.9	1,386,458		16.8	17	19,635					不二電機工業		1.3	1.3	1,684			
新川		9.2	9.2	3,634		13.8	14.9	12,054					ジェエス・コア コーポレーション		204	44.1	99,798			
ホソカワミクロン		4.2	4.3	19,522		10.3	11.2	5,275					サクサホールディングス		2.9	3	5,367			
ユニオンツール		5.1	5.2	15,990		17.4	18.9	27,178					メルコホールディングス		5.5	5.1	20,298			
オイレ工業		14.5	16.9	32,160		33.8	34	86,156					テクノメディアカ		2.7	2.8	5,810			
日精イー・エス・ビー機械		3.8	3.5	13,597		11.5	11.4	17,293					日本電気		146.7	158.8	594,706			
サトーホールディングス		14.8	14.6	37,960		18.2	17.6	20,416					富士通		1,166	1,183	894,702			
技研製作所		5.7	8.5	27,115		112.5	121.8	157,974					沖電気工業		46	53.2	66,287			
日本エアテック		3.9	3.8	2,150		4.1	4.5	8,046					岩崎通信機		5	5.8	4,657			
カワタ		-	2.5	3,192		5.2	5.6	28,224					電気興業		6.4	6.4	17,158			
日精樹脂工業						9.4	10.2	9,618												
オカダアイオン						3.3	4.2	6,211												
ワイエイシールホールディングス						3.8	4.9	3,248												
小松製作所						547.5	555.5	1,485,684												
住友重機械工業						64.9	70.2	260,793												
日立建機						53	49.1	136,154												
日工						3.1	3.4	7,775												
巴工業						4.8	5.2													

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末				
	株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数		株	数	評 価 額	株	数	株	数	評 価 額
サンケン電気		千株		千株		千円	澤藤電機		千株		千株		千円	いすゞ自動車		千株		千株		千株		千円
ナカオ	66	14.3		31,274			原田工業	1.2	1.5		2,512			328.6	387.9		596,978					
アイホン	2.2	2.3		3,254			コーセル	-	3.8		3,469			1,378.5	1,367.5		8,991,312					
ルネサエレクトロニクス	6.4	7		11,886			イリソ電子工業	15.7	17		19,720			161.8	153.2		158,715					
セイコーエプソン	58.7	127		82,423			新日本無線	9.5	11.2		54,320			419.7	454.2		297,046					
ワコム	168.8	152.2		251,130			オプテックスグループ	6.9	-		-			エフテック	7.3		8.7					
アルパック	88	88.9		42,583			千代田インテグレ	9.2	21.6		43,329			レシッパホールディングス	4.1		4.5					
アクセル	26.1	24.5		88,567			アイ・オー・データ機器	5.5	5.1		9,679			GMB	1.9		2.5					
E I Z O	4.7	5		2,580			レーザータック	4.7	5.1		6,390			日産車体	2		2.1					
ジャパンディスプレイ	10.4	11.3		52,488			スタンレー電気	23.2	25.1		108,557			武蔵精密工業	12.1		28.9					
日本信号	233	290.1		21,177			岩崎電気	86.7	86.9		278,949			新明和工業	44.3		24					
京三製作所	31.3	31.2		30,139			ウシオ電機	4.4	4.8		6,518			極東開発工業	49.3		57.1					
能美防災	27	26.3		10,967			岡谷電機産業	68.8	74.5		92,752			日信工業	21.1		24.4					
ホーチキ	15	16.2		29,824			ハリオス テクノ ホールディング	6.1	8.8		3,440			トビー工業	23		22.4					
星和電機	8.2	7.7		8,547			エノモト	9.7	11.3		7,864			ティアラド	9.3		10.1					
エレコム	-	4.1		1,881			日本セラミック	-	2.6		2,202			曙ブレーキ工業	4.1		4.5					
パナソニック	9.8	11.1		35,742			遠藤照明	11.5	12.5		32,637			タチエス	52.7		67.3					
シャープ	1,295.4	1,401.8		1,445,956			古河電池	5.8	6.3		4,548			NOK	19.2		20.8					
アンリツ	79	121.8		148,596			双信電機	8.1	8.8		6,441			フタバ産業	60.9		65.9					
富士通ゼネラル	82.7	79		173,879			図研	5	5.9		2,041			ミクニ	34.7		34.1					
TDK	34.6	37.4		55,426			日本電子	8.2	8.9		11,676			太平洋工業	11.8		12.8					
帝国通信工業	757.5	822.6		3,876,913			カシオ計算機	7.4	7.9		13,003			ケーヒン	14.3		19.9					
タムラ製作所	59.3	64.2		551,478			ファナック	41	24.2		46,439			アイシン精機	60.2		60.8					
アルプスアルパイン	5	5.4		6,474			日本シイエムケイ	91.2	108.5		162,424			マツダ	14.4		15.5					
池上通信機	43.7	47.2		29,736			エンプラス	107.8	116.6		2,191,497			今仙電機製作所	10.5		11.4					
パイオニア	97.7	127.7		294,731			大真空	20	31.2		22,027			今仙電機製作所	23.7		25.7					
日本電波工業	36	3.9		4,875			ローム	5.1	5.5		16,373			西工工業	26		28.2					
鈴木	189	204.5		13,292			浜松ホトニクス	4.2	4.5		4,320			アイシン精機	13.9		15					
日本トリム	10.3	11.2		4,121			三井ハイテック	50.9	59.3		472,028			アイシン精機	93.4		101.1					
ローランド ディー・ジー	4.5	6.1		3,922			新光電気工業	82.6	88.1		347,554			マツダ	355.9		385.1					
フォスター電機	2.4	2.4		13,008			村田製作所	15	13.6		12,988			ヤマハ発動機	10.5		11.4					
クラリオン	5.8	6.3		14,143			ユーション	186.1	187.1		1,118,858			ヤマハ発動機	1,020.4		1,035.2					
S M K	13.3	14.4		23,184			ユーション	42.8	41.1		31,112			スズキ	224.7		224.5					
ヨコオ	60	10.7		26,717			京セラ	186.1	187.1		1,118,858			S U B A R U	352		381					
ティアック	29	3.4		8,870			太陽誘電	50.9	54.6		111,984			安永	5.5		5.9					
ホシデン	84	8.6		1,788			村田製作所	119	128.8		2,239,832			ヤマハ発動機	160.1		173.2					
ヒロセ電機	28.3	36.1		29,024			ユーション	17.1	19.4		19,089			ショーワ	29.4		29					
日本航空電子工業	19	17.5		208,775			ユーション	18.5	20		34,920			T B K	13.5		14.8					
T O A	12.2	13.3		14,350			ユーション	4.6	4.6		4,471			エクセディ	13.7		16.6					
マクセルホールディングス	22.5	26.4		42,873			ユーション	35.7	38.6		33,968			豊田合成	41.2		39.7					
古野電気	13.5	15.8		14,804			ユーション	9.2	8.8		18,576			愛三工業	19.9		19.2					
ユニデンホールディングス	31	3.7		7,958			ユーション	15.7	18.6		29,536			盟和産業	1.7		1.9					
アルパイン	27	-		-			ユーション	17	18.4		11,095			日本プラス	4.6		9.6					
スマグコーポレーション	11.6	10.4		12,916			ユーション	67.9	73.6		461,472			ヨロス	11.5		11.5					
アイコム	6.3	6.8		14,803			ユーション	20.9	22.6		14,870			エフ・シー・シー	18.5		22.1					
リオン	4.8	5.6		9,895			ユーション	21.5	21.3		106,500			シマノ	45.7		49.5					
本多通信工業	8.8	10.5		5,754			ユーション	10.4	11.3		20,611			ティ・エス テック	26.3		28.5					
船井電機	11.5	12.5		7,375			ユーション	610.4	660.6		2,104,011			ジャムコ	5.7		6.2					
横河電機	113.5	122.8		252,476			ユーション	340.9	369		426,195			精密機器 (2.0%)								
新電元工業	4	4.4		19,162			ユーション	-	22.9		27,182			テルモ	173.8		173.6					
アズビル	34	79.2		191,822			ユーション	1.6	1.6		2,982			クリエーティブメディック	3.8		4.2					
東亜ディーケーケー	5.6	6.1		4,855			ユーション	75.6	81.9		1,298,934			日機装	39.2		39.7					
日本光電工業	47.4	54.1		178,259			ユーション	33	42.9		75,847			島津製作所	135.5		157.9					
チノー	3.9	4.3		5,538			ユーション	2.4	2.6		3,868			J M S	10.5		11.1					
共和電業	13	13		4,771			ユーション	21.9	23.8		49,789			グボテック	2.5		2.6					
日本電子材料	4.5	4.7		3,600			ユーション	91.8	99.3		545,157			長野計器	8.9		9.6					
堀場製作所	22.5	24.3		136,323			ユーション	18.2	21.4		37,385			バイ・テクノロジー	7.2		7.9					
アドバンテスト	63.2	83.6		211,173			ユーション	14.4	15.5		8,990			東京計器	2.7		2.7					
小野測器	4.8	5.7		3,442			ユーション	251.6	270.2		1,256,159			愛知時計電機	1.5		1.6					
エスベック	10.1	10.9		21,898			ユーション	29.8	32.3		61,757			インターアクション	4.4		6.5					
キーエンス	55.7	60.2		3,748,052			ユーション	41	44.3		56,571			オーバル	11.2		11.7					
日置電機	5.9	6.4		28,672			ユーション	88.2	95.5		270,074			東京精密	20.5		22.2					
シスメックス	88.2	95.6		590,425			ユーション	34	36.8		15,787			マニー	13.8		14.9					
日本マイクロニクス	19.7	19.8		17,740			ユーション	13.8	16.3		2,917			ニコン	197.6		213.8					
メガチップス	8.9	9.7		20,321			ユーション	41	4.5		11,209			トプコン	60.9		65.8					
OBARA GROUP	6.6	7.1		25,666			ユーション	1.7	1.9		3,762			オリンパス	168.9		182.8					
							ユーション	1.337.3	1,447.3		1,343,239			理研計器	10.8		10.9					
							ユーション	1.337.3	1,447.3		1,343,239			タムコム	9.1		10.9					
							ユーション	1.337.3	1,447.3		1,343,239			HOYA	230.9		247.1					

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株	数	価 値	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額
		千株	千円		千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円
シード	1.2	5.2	6,744				電気・ガス業 (2.0%)						SGホールディングス	76.1	109.8	327,423					
ノーリツ鋼機	11.5	9.7	18,274				東京電力ホールディングス	905.1	979.5	658,224			海運業 (0.2%)								
エー・アンド・デイ	10.4	11.2	7,873				中部電力	346.9	375.4	627,481			日本郵船	89.8	97.1	175,945					
朝日インテック	-	52	254,280				関西電力	462.7	500.7	792,107			商船三井	67.9	69	182,712					
シチズン時計	135.3	134.2	77,567				中国電力	156.7	169.6	249,481			川崎汽船	49.6	35.8	55,704					
リズム時計工業	4.3	4.1	7,080				北陸電力	111.1	120.1	105,808			NSユナイテッド海運	5.1	6.4	16,832					
大研医器	10.1	9.8	5,870				東北電力	265.5	287.4	408,108			明治海運	11.4	12.1	4,271					
メニコン	15.6	16.8	45,578				東国電力	102.1	110.5	157,020			飯野海運	54.7	55	21,835					
シンシア	-	1.9	934				九州電力	250.4	252.9	334,839			共栄タンカー	0.8	0.8	1,216					
松風	5.6	6.2	7,526				北海道電力	113.7	114.8	89,544			乾汽船	8.3	10.4	7,415					
セイコーホールディングス	17.5	19	44,384				沖縄電力	18.3	22.7	46,716			空運業 (0.6%)								
ニプロ	78.5	84.9	118,605				電源開発	90.2	97.7	269,358			日本航空	199.2	212.8	856,732					
その他製品 (2.0%)							エフオン	5.7	7.3	6,635			ANAホールディングス	210.5	212.5	862,112					
中本パックス	1.1	3.4	5,531				イーレックス	17.8	21.3	14,079			パスコ	10	2.3	1,948					
スノーピーク	3.5	4.5	5,598				レノバ	-	12.7	13,881			倉庫・運輸関連業 (0.2%)								
パワマウントベッドホールディングス	12	14.1	65,071				東京瓦斯	241.9	240.7	699,835			トランコム	3	3.3	21,912					
トランザクション	5.1	6.7	4,817				大阪瓦斯	220	238	514,318			日新	9.3	10	19,050					
S H O - B I	3.9	3.5	1,221				東邦瓦斯	56.2	60.7	279,220			三菱倉庫	37.1	40.2	106,610					
ニホンフラッシュ	5.3	5.2	10,618				北海道瓦斯	31	6.6	9,490			三井倉庫ホールディングス	61	14.3	28,585					
前田工織	11.4	13.6	37,848				広島ガス	23.4	25.5	8,746			住友倉庫	74	43.7	63,496					
永大産業	15	16.4	7,314				西部瓦斯	13.8	13.9	34,597			滋澤倉庫	5.9	6.5	10,192					
アートネイチャー	12.1	13.1	8,017				静岡ガス	32.2	37.7	33,628			東陽倉庫	19.5	20.5	6,088					
パシフィックホールディングス	117.2	126.8	571,234				メタウォーター	6.4	5.9	18,349			日本トランスシティ	26	25.7	11,256					
アイフィスジャパン	2.4	2.7	1,657				陸運業 (4.7%)					ケイヒン	2.1	2.2	2,824						
共立印刷	18.9	20.8	4,846				SBSホールディングス	11.2	12.2	20,081			中央倉庫	6.6	6.9	6,906					
S H O E I	5.1	5.8	22,823				東武鉄道	121.2	129.4	390,141			川西倉庫	2.2	2.3	2,716					
フランスベッドホールディングス	13.4	17.4	15,068				相鉄ホールディングス	36.3	42.2	135,884			安田倉庫	9.7	9.7	8,516					
パイロットコーポレーション	19.8	21.4	113,848				東京急行電鉄	308	333.3	609,272			東洋埠頭	3.2	3.3	4,719					
萩原工業	6.3	6.8	11,240				京浜急行電鉄	155.3	168.1	300,562			宇徳	9.4	10.1	5,514					
トッパン・フォームズ	24.3	26.3	23,538				小田急電鉄	168.6	196.6	476,165			上組	67.6	71.8	174,545					
フジテレビインターナショナル	25.4	27.4	110,148				京王電鉄	63.4	68.6	420,518			サンリツ	2.8	2.9	2,012					
タカラトミー	47.5	51.4	61,731				京成電鉄	78.9	92	324,760			キムラユニティー	2.9	3.2	3,484					
廣済堂	10.6	11.4	8,835				富士通	15.5	16.7	59,118			キューソー流通システム	3.1	3	6,171					
エステールホールディングス	3.4	3.5	2,310				新京成電鉄	2.9	3.1	6,441			近鉄エクスプレス	20.3	22	36,630					
アーク	47.9	46.7	4,529				東日本旅客鉄道	203.7	218.2	2,216,912			東海運	6.1	6.3	1,764					
タカノ	5	4.9	4,135				西日本旅客鉄道	102.3	110	864,490			エーアイティ	7.7	7.5	7,627					
プロネクサス	10.6	10.5	12,201				東海旅客鉄道	101.5	109.9	2,596,387			内外トランスライン	3.8	3.8	5,449					
ホクシン	8.2	7.7	1,054				西武ホールディングス	144.5	156.3	302,284			日本コンセプト	2.1	3.2	3,206					
ウッドワン	3.8	4	4,148				鴻池運輸	16	19.6	32,594			情報・通信業 (8.4%)								
大建工業	8.8	9.3	17,688				西日本鉄道	31.4	34	91,358			NECネットエスアイ	12.3	13.4	33,567					
凸版印刷	320	173.2	309,335				ハマキョウレックス	8	9.4	35,720			システナ	8.9	43	46,784					
大日本印刷	148.4	172.9	435,362				サイキ引越センター	6	6.5	40,365			デジタルアーツ	5.5	6.5	52,195					
図書印刷	7.6	11.5	11,097				近鉄グループホールディングス	107.4	116.1	553,797			新日鉄住金ソリューションズ	17.5	18	52,776					
共同印刷	3.5	3.9	9,126				阪急阪神ホールディングス	143.2	155	599,850			キューブシステム	6.5	6.4	5,331					
N I S S H A	23.3	25.1	36,545				南海電気鉄道	50.9	51.9	151,288			エイジア	1.7	2.4	2,786					
光村印刷	1	1	1,964				京阪ホールディングス	47.8	51.8	232,582			コア	4.7	5.1	6,732					
宝印刷	5.9	6.4	10,208				神戸電鉄	2.6	3	11,685			ソリトンシステムズ	3.7	6.8	5,691					
アックス	112.6	121.9	200,891				名古屋鉄道	83.3	93.1	269,338			ソフトウエアホールディングス	5.4	5.2	7,753					
ツツミ	3.5	3.9	7,569				山陽電気鉄道	8.3	9	18,972			T I S	37.1	40.1	199,898					
小松フオル工業	3.8	3.8	7,087				日本通運	42.2	45.6	298,680			ネオス	3.4	4.1	4,239					
ヤマハ	76.4	73	382,520				ヤマトホールディングス	188.3	203.7	572,600			電算システム	3.9	4.6	11,012					
河合楽器製作所	3.8	3.8	12,711				丸運	27.6	32.3	166,345			グリー	59.6	83.1	38,059					
クリナップ	10.5	11.5	7,130				丸全和運輸	6	6.2	1,847			コーエーテックホールディングス	18.9	24.6	44,722					
ビジョン	68.5	74.2	325,738				セルコグループホールディングス	38	9.4	25,774			三菱総合研究所	4.8	4.7	15,345					
兼松サステック	0.9	0.8	1,240				トナミホールディングス	64.6	64.1	54,933			ポルテージ	2.1	2.4	1,360					
キングダム	9.4	10.2	8,047				ニッコンホールディングス	2.6	2.8	16,576			電算	1.3	1.3	2,797					
リンテック	26.9	29.2	71,335				日本石油輸送	40.8	44.2	120,003			A G S	6.3	6.8	4,549					
イトーキ	23.9	22.6	12,723				福山通運	1.3	1.4	3,977			ファインデックス	9.3	10.1	6,787					
任天堂	69.8	75.5	2,213,282				セイノールホールディングス	15.7	14.9	63,325			ヒト・コミュニケーションズ	2.5	2.8	4,390					
三菱鉛筆	18.7	20.2	46,460				エスライン	80.4	87	130,761			ブレインパッド	2.4	2.6	13,390					
タカラスタンダード	23.4	25.4	43,357				神奈川中央交通	-	3.1	3,468			K L a b	21.6	21.4	18,254					
コクヨ	54.4	58.9	94,416				日立物流	2.7	2.9	10,686			ホトクワイクビシオホールディングス	8.1	16	13,872					
ナカバヤシ	11.1	12.3	6,678				丸和運輸機関	23.6	25.6	77,440			イーブイコミュニケーションズ	1.8	2	3,054					
グローブライド	5.1	5.9	15,027				C&Fロジホールディングス	5.7	6.1	20,831			ネクソン	124	306.6	512,022					
オカムラ	39.6	42.9	54,483				九州旅客鉄道	11.8	11.9	14,053			アイスタイル	27.9	30.6	25,214					
美津濃	11.2	12.2	31,280						90.1	97.6	348,920			エムアツップ	3.7	4.2	7,492				

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株	数	価 額	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額
エイチーム		千株	千円		千株	千円	シンクロ・フード		千株	千株	千円		千株	千株	千円		USEN-NEXT HOLDINGS		千株	千株	千円
テクノスジャパン	7.6	7.5	13,560	7.7	7.5	13,600	オークネット	0.9	5.1	3,366	3,366	2.9	4.6	4,259	2.9	4.6	4,259	2.9	4.6	4,259	
enish	10.1	10.1	7,787	10.1	10.1	7,787	AOI TYO HOLDINGS	3.5	6.3	6,016	6,016	5.2	5.3	2,803	5.2	5.3	2,803	5.2	5.3	2,803	
コロプラ	3.3	4.2	2,041	4.2	2,041	2,041	マクロミル	9.1	13.1	10,807	10,807	7.9	8.6	12,160	7.9	8.6	12,160	7.9	8.6	12,160	
モバилクリエイト	36.1	34.3	24,215	34.3	24,215	24,215	ビーグリー	10.4	21.3	32,887	32,887	100.8	102.6	13,030	100.8	102.6	13,030	100.8	102.6	13,030	
オルトプラス	8.6	-	-	-	-	-	オロク	-	2.3	2,070	2,070	2.4	2.3	1,559	2.4	2.3	1,559	2.4	2.3	1,559	
ブロードリーフ	5.4	7.3	2,328	7.3	2,328	2,328	ソルクシーズ	-	1.1	5,203	5,203	798.5	823.5	3,817,746	798.5	823.5	3,817,746	798.5	823.5	3,817,746	
クロス・マーケティンググループ	27.6	59.7	33,790	59.7	33,790	33,790	フェイス	4.3	5.1	3,391	3,391	1,001.9	1,061.1	2,820,934	1,001.9	1,061.1	2,820,934	1,001.9	1,061.1	2,820,934	
デジタルハーツホールディングス	-	3.3	1,188	3.3	1,188	1,188	ハイマックス	3.9	4.2	3,616	3,616	-	-	957.3	-	-	957.3	-	-	957.3	
メディアアドホールディングス	5.9	5.4	7,630	5.4	7,630	7,630	野村総合研究所	1.5	1.5	2,688	2,688	13.4	14.2	251,766	13.4	14.2	251,766	13.4	14.2	251,766	
じげん	3.6	3.5	8,102	3.5	8,102	8,102	サイバネットシステム	74.4	76.5	318,622	318,622	823.7	864.6	2,208,620	823.7	864.6	2,208,620	823.7	864.6	2,208,620	
ブイキューブ	-	12.8	7,347	12.8	7,347	7,347	CEホールディングス	9.2	9.9	6,336	6,336	15	14.1	8,586	15	14.1	8,586	15	14.1	8,586	
サイバーリンクス	6.9	6.3	2,305	6.3	2,305	2,305	日本システム技術	3.2	3.2	2,272	2,272	40.5	43.8	68,809	40.5	43.8	68,809	40.5	43.8	68,809	
ディー・エル・イー	1.8	1.9	1,941	1.9	1,941	1,941	インテジホールディングス	1.4	2	3,012	3,012	1.8	2.5	1,245	1.8	2.5	1,245	1.8	2.5	1,245	
フィックスターズ	5.1	7.5	1,110	7.5	1,110	1,110	東邦システムサイエンス	12.8	15.4	13,582	13,582	32.4	35.1	41,733	32.4	35.1	41,733	32.4	35.1	41,733	
CARTA HOLDINGS	1.9	11.5	16,157	11.5	16,157	16,157	ソースネクスト	3.8	3.7	3,367	3,367	3.7	4.1	16,810	3.7	4.1	16,810	3.7	4.1	16,810	
オプティム	5.7	6.4	6,752	6.4	6,752	6,752	インフォコム	15.7	46.4	26,030	26,030	13.5	24	67,248	13.5	24	67,248	13.5	24	67,248	
セレス	1.9	2.7	12,312	2.7	12,312	12,312	FIG	-	4.9	19,110	19,110	5.1	5.4	2,430	5.1	5.4	2,430	5.1	5.4	2,430	
ペリサーブ	3.4	4	6,040	4	6,040	6,040	アルテリア・ネットワークス	-	10.6	3,572	3,572	9.5	9.7	1,455	9.5	9.7	1,455	9.5	9.7	1,455	
ティョーガイア	1.4	1.1	7,348	1.1	7,348	7,348	フォーカスシステムズ	6.3	8	8,328	8,328	6.3	6.8	9,200	6.3	6.8	9,200	6.3	6.8	9,200	
セック	11.1	12.1	24,030	12.1	24,030	24,030	フジ・メディア・ホールディングス	2.5	3.7	13,061	13,061	7.4	7.9	86,110	7.4	7.9	86,110	7.4	7.9	86,110	
日本アジアグループ	1.1	2	7,440	2	7,440	7,440	オービック	116.5	124.9	199,715	199,715	73.2	79.2	312,048	73.2	79.2	312,048	73.2	79.2	312,048	
豆蔵ホールディングス	11.7	12.8	4,595	12.8	4,595	4,595	ジャストシステム	35.1	41.8	427,196	427,196	4.2	5.1	71,298	4.2	5.1	71,298	4.2	5.1	71,298	
テクマトリックス	8.3	8.1	8,424	8.1	8,424	8,424	TDCソフト	18.1	17.1	39,723	39,723	345.6	320.7	379,708	345.6	320.7	379,708	345.6	320.7	379,708	
プロシッパ	6.1	8.6	16,847	8.6	16,847	16,847	ヤフー	4.9	10.5	9,166	9,166	1.7	1.6	3,211	1.7	1.6	3,211	1.7	1.6	3,211	
カネー・オンライン・エンターテインメント	1.6	3.6	4,716	3.6	4,716	4,716	トレンドマイクロ	802.3	785.1	244,166	244,166	1.9	2.1	4,111	1.9	2.1	4,111	1.9	2.1	4,111	
GMOベイメントゲートウェイ	301.7	290.2	91,413	290.2	91,413	91,413	インフォメーション・デバイス	54.3	64.2	362,730	362,730	11.6	13.5	56,362	11.6	13.5	56,362	11.6	13.5	56,362	
ザッパラス	7.8	19.8	110,682	19.8	110,682	110,682	日本オラクル	3.5	3.4	5,052	5,052	51.7	56	186,760	51.7	56	186,760	51.7	56	186,760	
システムリサーチ	5.5	5.9	2,194	5.9	2,194	2,194	アルファシステムズ	18	24.4	196,908	196,908	6.6	12.9	27,412	6.6	12.9	27,412	6.6	12.9	27,412	
インターネットエンシアティブ	1.1	1.6	4,880	1.6	4,880	4,880	フューチャー	3.7	4	10,408	10,408	23.8	23.8	117,028	23.8	23.8	117,028	23.8	23.8	117,028	
ざくらインターネット	18.1	19.6	52,645	19.6	52,645	52,645	CAC Holdings	15.1	16.3	28,655	28,655	2.2	2.4	4,576	2.2	2.4	4,576	2.2	2.4	4,576	
グインクス	13.3	14.4	6,768	14.4	6,768	6,768	ソフトバンク・テクノロジー	8.4	9.1	8,745	8,745	6.5	7	6,531	6.5	7	6,531	6.5	7	6,531	
GMOクラウド	-	4.1	5,174	4.1	5,174	5,174	トーセ	4.7	5.1	10,883	10,883	25.7	31.8	147,075	25.7	31.8	147,075	25.7	31.8	147,075	
SRAホールディングス	2.5	2.7	9,504	2.7	9,504	9,504	オービックビジネスコンサルタント	3	3.3	4,962	4,962	3.7	4	8,020	3.7	4	8,020	3.7	4	8,020	
MINORソリューションズ	5.9	6.4	16,742	6.4	16,742	16,742	伊藤忠テクノソリューションズ	5.7	12.4	49,662	49,662	14.1	15.2	19,866	14.1	15.2	19,866	14.1	15.2	19,866	
システムインテグレータ	2.2	2.4	3,960	2.4	3,960	3,960	アイティフォー	25.3	54.9	138,073	138,073	10.4	10.1	39,491	10.4	10.1	39,491	10.4	10.1	39,491	
朝日ネット	1.6	3.4	2,570	3.4	2,570	2,570	東計電算	13.6	14.6	12,059	12,059	15.4	18	80,730	15.4	18	80,730	15.4	18	80,730	
eBASE	10.2	10.1	5,191	10.1	5,191	5,191	エックスネット	2	1.8	5,436	5,436	18.3	19.7	47,063	18.3	19.7	47,063	18.3	19.7	47,063	
アバント	2.2	3.7	6,378	3.7	6,378	6,378	大塚商会	1.8	2.3	1,945	1,945	45.5	49.3	217,413	45.5	49.3	217,413	45.5	49.3	217,413	
アドソル日進	-	3.2	4,265	3.2	4,265	4,265	サイボウズ	33.4	65.1	262,027	262,027	3.2	4	7,256	3.2	4	7,256	3.2	4	7,256	
フリービット	4.3	4.3	7,271	4.3	7,271	7,271	ソフトブレイン	14.9	14.1	8,939	8,939	8.8	9.5	16,216	8.8	9.5	16,216	8.8	9.5	16,216	
コムチュア	7.4	7.9	7,394	7.9	7,394	7,394	電通国際情報サービス	8.9	9.5	4,854	4,854	9.8	12	30,672	9.8	12	30,672	9.8	12	30,672	
サイバーコム	5.7	6.7	19,892	6.7	19,892	19,892	デジタルガレージ	6.9	7.4	23,680	23,680	503.7	503.2	5,012,878	503.7	503.2	5,012,878	503.7	503.2	5,012,878	
アステリア	2	2.2	5,152	2.2	5,152	5,152	ウェアムシステムズ	20	23.5	66,881	66,881	0.9	0.9	784	0.9	0.9	784	0.9	0.9	784	
マークライズ	-	5.9	4,979	5.9	4,979	4,979	イーゼーニューズ	3.9	9.7	10,912	10,912	4.3	4.7	4,667	4.3	4.7	4,667	4.3	4.7	4,667	
メディカル・データ・ビジョン	4.2	10.6	10,250	10.6	10,250	10,250	CIJ	3.8	4.1	11,955	11,955	2.7	2.9	13,862	2.7	2.9	13,862	2.7	2.9	13,862	
gumi	12.8	13.9	8,896	13.9	8,896	8,896	東洋ビジネスエン지니어リング	8.8	9.5	7,666	7,666	5.2	5.6	10,242	5.2	5.6	10,242	5.2	5.6	10,242	
ショーケース・ティービー	2.2	2.6	1,781	2.6	1,781	1,781	日本エンタープライズ	1.1	1.1	2,106	2,106	3.2	3.4	8,466	3.2	3.4	8,466	3.2	3.4	8,466	
モバилファクトリー	2.1	3.3	5,388	3.3	5,388	5,388	WOWOW	11.7	12.7	2,298	2,298	5.9	6.8	29,111	5.9	6.8	29,111	5.9	6.8	29,111	
テラスカイ	-	0.7	2,863	0.7	2,863	2,863	スカラ	5.3	5.7	16,455	16,455	1.7	1.9	4,542	1.7	1.9	4,542	1.7	1.9	4,542	
デジタル・インフォメーション・テック/ロジック	1.7	5.3	6,927	5.3	6,927	6,927	IMAGICA GROUP	7.8	9.7	7,207	7,207	4	4.4	8,078	4	4.4	8,078	4	4.4	8,078	
PCIホールディングス	1.9	2.2	5,123	2.2	5,123	5,123	ネットワンシステムズ	9.4	10.2	5,344	5,344	8.5	10.5	6,709	8.5	10.5	6,709	8.5	10.5	6,709	
パイプHD	1.8	2	1,780	2	1,780	1,780	システムソフト	45.4	42.7	107,219	107,219	660.7	667.4	274,968	660.7	667.4	274,968	660.7	667.4	274,968	
アイビシー	1.2	2	2,574	2	2,574	2,574	アルフレッサ ホールディングス	26.5	29.1	2,880	2,880	124.1	134.3	398,736	124.1	134.3	398,736	124.1	134.3	398,736	
ネオジャパン	-	2.3	2,201	2.3	2,201	2,201	マールグラフィックス	5.1	5.1	23,740	23,740	27	31.7	29,544	27</						

銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
メディアスホールディングス		千株	千円		千株	千円	三井物産		千株	千円		千株	千円	加藤産業		千株	千円		千株	千円
UKCホールディングス	1.8	6.7	4,549		6.7	4,549	日本紙パルプ商事	948.7	995.7	1,737,496		995.7	1,737,496	北恵	17.4	18.9	61,708		18.9	61,708
ジュテックホールディングス	7.2	7.7	15,423		7.7	15,423	日立エレクトロロジーズ	5.8	6.9	28,566		6.9	28,566	イノテック	-	2.3	2,168		2.3	2,168
大光	2.6	2.7	2,716		2.7	2,716	カメイ	38.8	36.7	155,791		36.7	155,791	エコーハット	9.7	8.3	8,573		8.3	8,573
OCHIホールディングス	2.6	3	1,818		3	1,818	東都水産	14.5	15.8	18,391		15.8	18,391	J Kホールディングス	10.5	11.4	31,156		11.4	31,156
TOKAIホールディングス	3.2	3.4	3,872		3.4	3,872	OUGホールディングス	1.7	1.8	4,467		1.8	4,467	日伝	11.2	11.1	6,282		11.1	6,282
黒谷	59	63.9	56,679		63.9	56,679	スターゼン	1.8	2.1	5,115		2.1	5,115	北沢産業	9.3	10	15,630		10	15,630
Cominix	-	2	980		2	980	山善	4.4	4.5	18,090		4.5	18,090	杉本商事	9.5	9.2	2,668		9.2	2,668
三洋貿易	1.7	1.9	1,565		1.9	1,565	椿本興業	43.6	47.2	51,967		47.2	51,967	因幡電機産業	6	6.6	11,244		6.6	11,244
ピューティガレージ	6.1	6.1	10,980		6.1	10,980	住友商事	2.5	2.7	9,895		2.7	9,895	パイテックホールディングス	14.7	17.1	78,660		17.1	78,660
ワイン・パートナーズ	1.5	1.8	2,853		1.8	2,853	内田洋行	704.4	714.7	1,159,600		714.7	1,159,600	東テク	5.1	5.4	10,989		5.4	10,989
ミタチ産業	8.1	7.8	8,447		7.8	8,447	三菱商事	5.1	5.5	12,303		5.5	12,303	ミスミグループ本社	3.7	4.1	9,343		4.1	9,343
シッパヘルスケアホールディングス	2.6	2.9	2,114		2.9	2,114	第一実業	783.7	848	2,676,288		848	2,676,288	アルテック	129.6	151.3	394,439		151.3	394,439
明治電機工業	23.3	25.1	103,286		25.1	103,286	キャノンマーケティングジャパン	5.1	5.5	19,112		5.5	19,112	タキヒヨー	9.6	8.7	1,931		8.7	1,931
デリカフーズホールディングス	3.8	3.9	6,961		3.9	6,961	西華産業	31.9	34.5	70,207		34.5	70,207	戴王産業	3.7	3.8	6,809		3.8	6,809
スターティアホールディングス	2.2	2.2	2,981		2.2	2,981	佐藤商事	6.9	6.8	10,329		6.8	10,329	スズケン	1.8	2.1	2,679		2.1	2,679
コメダホールディングス	2.5	2.4	1,430		2.4	1,430	菱洋エレクトロ	10	10.9	9,690		10.9	9,690	ジェコス	50.9	55.1	307,458		55.1	307,458
富士興産	20.6	27.7	58,391		27.7	58,391	東京産業	10.4	12.3	18,474		12.3	18,474	ルネサスイーストン	7.7	8.5	8,882		8.5	8,882
協栄産業	4.1	4.6	2,953		4.6	2,953	ユアサ商事	11.1	12.1	6,449		12.1	6,449	小売業(4.9%)	10.2	11.2	4,816		11.2	4,816
小野建	9.7	1.4	2,114		1.4	2,114	神鋼商事	10.6	12.4	41,044		12.4	41,044	ローソン	28.3	30.6	204,102		30.6	204,102
南陽	-	2.5	5,597		2.5	5,597	阪和興業	2.5	2.7	6,814		2.7	6,814	サンエー	8.4	9.2	40,296		9.2	40,296
佐鳥電機	8.2	9	8,379		9	8,379	正栄食品工業	7.6	7	1,953		7	1,953	カワチ薬品	8.7	9.4	19,270		9.4	19,270
エコトレーディング	2.5	2.6	1,565		2.6	1,565	カナデン	20.9	21	61,551		21	61,551	ハーゾフコーポレーション	20.3	18.9	118,125		18.9	118,125
伯東	6.8	8.3	9,835		8.3	9,835	菱電商事	10.7	11.7	14,601		11.7	14,601	アスフル	4.9	4.8	3,926		4.8	3,926
コンドーテック	8.9	9.4	9,099		9.4	9,099	フルサト工業	8	9.6	13,324		9.6	13,324	ゲオホールディングス	9.7	12.7	26,847		12.7	26,847
中山福	6.4	6.6	3,445		6.6	3,445	岩谷産業	6.1	6.7	10,880		6.7	10,880	アダストリア	20.4	18.4	29,697		18.4	29,697
ナガイレーベン	14.8	17.4	38,367		17.4	38,367	すてきナイスグループ	24.8	26.7	98,256		26.7	98,256	ジーフット	17.2	16.7	31,963		16.7	31,963
三菱食品	12.3	13.4	39,114		13.4	39,114	昭光通商	4.8	5	4,315		5	4,315	シー・ワイ・エス・ベイエリア	6.7	7.4	4,972		7.4	4,972
松田産業	8.1	8.9	12,807		8.9	12,807	ニチモウ	40	4.4	2,802		4.4	2,802	くらこポレション	1.5	1.5	1,132		1.5	1,132
第一興商	16.6	18	93,960		18	93,960	極東貿易	1.7	1.9	3,629		1.9	3,629	キャンドゥ	6.6	7.1	39,334		7.1	39,334
メディカルホールディングス	111.9	130.5	329,121		130.5	329,121	イワキ	16	14.8	6,156		14.8	6,156	バルグループホールディングス	5.3	5.7	8,778		5.7	8,778
S P K	2.4	2.5	5,690		2.5	5,690	三菱石油	16	30.2	30,067		30.2	30,067	エディオン	6.2	6.2	18,817		6.2	18,817
萩原電気ホールディングス	3.8	4.5	12,586		4.5	12,586	稲畑産業	30	29	45,037		29	45,037	サウコーポレーション	43.4	51.1	50,078		51.1	50,078
アズワン	8.7	8.7	68,730		8.7	68,730	G S Iクレオス	26.8	3	3,872		3	3,872	ワッツ	19.2	24.5	13,989		24.5	13,989
スズデン	3.9	4.3	6,798		4.3	6,798	明和産業	3	11.4	4,753		11.4	4,753	あみやき亭	4.5	4.1	2,984		4.1	2,984
尾家産業	3.3	3.4	3,940		3.4	3,940	フキタ	10.4	23.8	29,695		23.8	29,695	ひらまつ	4.2	4.6	10,483		4.6	10,483
シモジマ	6.8	7.4	8,443		7.4	8,443	東邦ホールディングス	23.8	33.1	93,080		33.1	93,080	大黒天物産	2.4	2.7	9,612		2.7	9,612
ドウシシャ	11.8	11.4	18,559		11.4	18,559	サンゲツ	33.1	35.8	74,679		35.8	74,679	ハニースホールディングス	15.4	24.1	8,194		24.1	8,194
小津産業	2.5	2.6	4,836		2.6	4,836	ミツコグループホールディングス	37.7	36.5	14,000		36.5	14,000	ファーマリスホールディングス	2.7	2.8	11,172		2.8	11,172
高速	6.6	7.3	7,738		7.3	7,738	シヤネホールディングス	16.2	5	11,035		5	11,035	アルペン	10.8	11.8	11,174		11.8	11,174
たけびし	3.9	4.3	5,981		4.3	5,981	サンワ テクノス	5.3	7.3	6,891		7.3	6,891	クオールホールディングス	2.6	2.7	1,514		2.7	1,514
リップス	2.5	2.7	4,106		2.7	4,106	リョーサン	24.7	37.3	82,507		37.3	82,507	ジンズ	8.6	9.3	15,345		9.3	15,345
丸文	9.9	10.7	7,564		10.7	7,564	新光商事	31.4	14	41,071		14	41,071	ビックカメラ	2.1	3.9	3,673		3.9	3,673
ハピネット	7.6	10.1	15,846		10.1	15,846	トーホー	6.6	5.5	11,297		5.5	11,297	DCMホールディングス	12.3	17.7	25,257		17.7	25,257
橋本総業ホールディングス	2.3	2.4	3,410		2.4	3,410	三信電気	14	13.4	41,071		13.4	41,071	ペッパーフードサービス	7.6	8.1	42,444		8.1	42,444
日本ライフライン	31.8	37.9	58,972		37.9	58,972	東陽テクニカ	12.3	11.4	21,181		11.4	21,181	Monotaro	64.7	64.5	79,722		64.5	79,722
タカショー	-	6.1	2,641		6.1	2,641	モスフードサービス	5	10	18,090		10	18,090	DDホールディングス	60.2	65.1	72,521		65.1	72,521
エクセル	4.5	4.5	9,553		4.5	9,553	加賀電子	10.3	12.1	24,611		12.1	24,611	きちりホールディングス	6	9.5	24,434		9.5	24,434
マルカカイ	3.6	4	7,836		4	7,836	ソーダニッカ	12.9	14	12,166		14	12,166	アークソフサービスホールディングス	39.7	76.3	182,662		76.3	182,662
I DOM	33.9	40.7	16,402		40.7	16,402	立花エレクトク	14.6	15.9	43,263		15.9	43,263	J. フロントリテイリング	2.5	2.5	1,487		2.5	1,487
日本エム・ディ・エム	7.5	7	7,476		7	7,476	フォーバル	10.1	9	13,986		9	13,986	ココカラファイン	2.4	2.7	5,548		2.7	5,548
進和	6.6	7.1	14,966		7.1	14,966	P A L T A C	11.6	12.7	6,896		12.7	6,896	プロンコピリー	3.1	3.1	2,157		3.1	2,157
エスケイジャパン	2.4	2.9	1,844		2.9	1,844	三谷産業	7.6	9	13,986		9	13,986	Z O Z O	9.3	8.9	18,245		8.9	18,245
ダイトロン	5.1	5.5	7,694		5.5	7,694	太平洋興発	4.9	5.3	4,478		5.3	4,478	トレジャー・ファクトリー	133.4	154.5	186,945		154.5	186,945
シークス	7.1	15.3	23,454		15.3	23,454	ヤマトホールディングス	15.7	21.8	115,758		21.8	115,758	物語コーポレーション	19.6	21.2	44,583		21.2	44,583
田中商事	3.5	3.7	2,205		3.7	2,205	邦際紙パルプ商事	12.1	14.4	3,916		14.4	3,916	物産コーポレーション	46.2	50	167,250		50	167,250
オーハシテクニカ	6.3	6.8	9,520		6.8	9,520	丸紅建材リース	4.7	4.9	3,572		4.9	3,572	H a m e e	19.6	208.8	225.9		208.8	225.9
白銅	4	4	6,724		4	6,724	丸紅住金物産	2.3	2.8	13,258		2.8	13,258	ウエルシアホールディングス	5.8	6.3	16,317		6.3	16,317
伊藤忠商事	819.6	845.4	1,716,584		845.4	1,716,584	トラスコ中山	0.9	0.9	1,215		0.9	1,215	クリエイトSDホールディングス	109.7	130.6	234,427		130.6	234,427
丸紅	917.8	1,191.9																		

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	株 数 評 価 額	株	数	株 数 評 価 額		株	数	株 数 評 価 額	株	数	株 数 評 価 額		株	数	株 数 評 価 額	株	数	株 数 評 価 額
ティールライフ		千株	千円		千株	千円	VTホールディングス		千株	千円		千株	千円	愛眼		千株	千円		千株	千円
イー・ピーカンパニー	1.5	1.6	1,427	1.6	1.6	1,427	魚力	37.8	41	17,015	37.8	41	17,015	ケユーホールディングス	9.1	9.7	2,919	9.1	9.7	2,919
チムエー	2.2	2.3	1,053	2.3	2.3	1,053	ポブラ	3.1	3.4	4,851	3.1	3.4	4,851	吉野家ホールディングス	5.8	6.2	4,848	5.8	6.2	4,848
シュッピン	3.4	3.8	9,591	3.8	3.8	9,591	フジ・コーポレーション	3	3.1	1,819	3	3.1	1,819	松屋ホールディングス	36.7	42.3	74,659	36.7	42.3	74,659
ネクステージ	6.8	8.1	5,904	8.1	8.1	5,904	ユニテッドアローズ	1.9	2.5	5,120	1.9	2.5	5,120	関西スーパーマーケット	5.4	5.8	20,590	5.4	5.8	20,590
ジョイフル本田	11.4	18.6	17,279	18.6	18.6	17,279	ハイデイ日高	13.8	13.9	52,333	13.8	13.9	52,333	サガミホールディングス	14.9	16.2	21,448	14.9	16.2	21,448
扇屋	16.4	35.4	48,568	35.4	35.4	48,568	京都きもの友禅	12.2	15.9	34,757	12.2	15.9	34,757	王将フードサービス	8.4	9.2	9,089	8.4	9.2	9,089
キリン堂ホールディングス	4.1	4	7,024	4	4	7,024	ココロイド	7.3	7.7	3,226	7.3	7.7	3,226	プレナス	8.2	8.9	63,813	8.2	8.9	63,813
ホットランド	3.9	4.8	6,897	4.8	4.8	6,897	ピーシーダゴコーポレーション	37.1	40.2	94,952	37.1	40.2	94,952	ミニストップ	12.5	13.6	24,792	12.5	13.6	24,792
すかいらーくホールディングス	6.5	6.3	7,938	6.3	6.3	7,938	トッパカルチャー	16.7	16	6,960	16.7	16	6,960	アークス	8.3	9	17,379	8.3	9	17,379
綿半ホールディングス	69.3	112.6	204,256	112.6	112.6	204,256	PLANT	7.9	8.6	39,259	7.9	8.6	39,259	パローホールディングス	20.9	22.7	55,319	20.9	22.7	55,319
ヨシックス	4.2	4.5	9,103	4.5	4.5	9,103	上野電機	4.1	4.6	1,329	4.1	4.6	1,329	藤久	26	26.1	70,835	26	26.1	70,835
コナカ	1.8	2	6,060	2	2	6,060	日本瓦斯	2.6	2.9	2,917	2.6	2.9	2,917	ベルク	0.9	0.9	674	0.9	0.9	674
ブックオフコーポレーション	37.1	35.2	41,360	35.2	35.2	41,360	ライフコーポレーション	24.5	26.5	121,502	24.5	26.5	121,502	大 庄	5	5.9	28,674	5	5.9	28,674
ゴルフダイジェスト・オンライン	6.4	-	-	-	-	-	ライオンホールディングス	9.8	14.8	9,723	9.8	14.8	9,723	ファーストリテイリング	6	6.5	9,925	6	6.5	9,925
BEENOS	4.5	4.9	3,332	4.9	4.9	3,332	スクロール	17.4	18.6	7,235	17.4	18.6	7,235	サンドラッグ	18.7	16.2	777,924	18.7	16.2	777,924
あさひ	1.5	2.8	3,029	2.8	2.8	3,029	ヨドシホールディングス	11.4	13.5	29,038	11.4	13.5	29,038	サックスホールディングス	47.3	45.4	157,084	47.3	45.4	157,084
日本調剤	8.3	10	15,080	10	10	15,080	ユニファミリーマートホールディングス	35.7	33.8	425,880	35.7	33.8	425,880	ヤマザワ	10.5	10.2	11,046	10.5	10.2	11,046
コスモス薬品	3.9	4.3	16,813	4.3	4.3	16,813	木曾路	13.7	14.8	36,570	13.7	14.8	36,570	やまや	2.3	2.4	4,260	2.3	2.4	4,260
トーエル	5.6	5.3	109,816	5.3	5.3	109,816	SRSホールディングス	13.2	14.3	14,271	13.2	14.3	14,271	ペルーナ	2.3	2.1	4,741	2.3	2.1	4,741
一六堂	5.5	5.8	4,007	5.8	5.8	4,007	千趣会	20.2	21.9	5,037	20.2	21.9	5,037	島根銀行	27.4	29.6	25,633	27.4	29.6	25,633
オンリー	2.5	-	-	-	-	-	タカキュー	9	9.2	1,692	9	9.2	1,692	じもとホールディングス	2.4	2.7	1,871	2.4	2.7	1,871
セパン&アイ・ホールディングス	1.7	2.2	2,217	2.2	2.2	2,217	ケーヨー	20.7	22.4	11,760	20.7	22.4	11,760	めざきフィナンシャルグループ	75.7	82.1	9,852	75.7	82.1	9,852
薬王堂	468.1	506.6	2,415,468	506.6	506.6	2,415,468	上新電機	13.2	14.3	33,161	13.2	14.3	33,161	東宝ホールディングス	581.1	628.6	184,808	581.1	628.6	184,808
クワイエット・レストランホールディングス	4.9	5.2	13,119	5.2	5.2	13,119	日本瓦斯	19.5	19.6	81,046	19.5	19.6	81,046	あさひフィナンシャルグループ	15.1	16.3	25,313	15.1	16.3	25,313
ツルハホールディングス	30	32.6	40,424	32.6	32.6	40,424	ロイヤルホールディングス	20.8	21.4	56,538	20.8	21.4	56,538	九州フィナンシャルグループ	183.4	198.5	87,538	183.4	198.5	87,538
サマルクホールディングス	24.2	26.2	259,380	26.2	26.2	259,380	東天虹	0.8	0.8	1,038	0.8	0.8	1,038	ゆうちょ銀行	316.8	343.1	430,247	316.8	343.1	430,247
フェリシモ	8.2	9.5	23,674	9.5	9.5	23,674	いなげや	12.4	13.6	18,890	12.4	13.6	18,890	富士第一銀行	28.5	29.2	11,008	28.5	29.2	11,008
トリドールホールディングス	2.9	2.7	2,926	2.7	2.7	2,926	島忠	27	27.3	83,811	27	27.3	83,811	ココロシティフィナンシャルグループ	68.0	77.0	339,878	68.0	77.0	339,878
TOKYO BASE	13.8	14.9	29,338	14.9	14.9	29,338	チヨダ	13.2	12.7	23,583	13.2	12.7	23,583	西日本フィナンシャルホールディングス	75.8	77.4	74,304	75.8	77.4	74,304
WILPLASホールディングス	2.2	10.7	9,223	10.7	10.7	9,223	ライフコーポレーション	8.5	9.2	22,512	8.5	9.2	22,512	関西フィナンシャルグループ	-	56.8	45,326	-	56.8	45,326
ジャパネット	-	1.1	843	1.1	1.1	843	リンガーハット	13.8	14.9	34,985	13.8	14.9	34,985	三十三フィナンシャルグループ	-	10.4	16,650	-	10.4	16,650
サツドラホールディングス	-	4.6	7,787	4.6	4.6	7,787	さき美グループホールディングス	10	-	-	10	-	-	野村ホールディングス	-	21	62,958	-	21	62,958
デファクトスタンダード	1.5	2	3,666	2	2	3,666	Mr Ma x HD	14	16.6	8,316	14	16.6	8,316	新生銀行	96.8	88.8	128,582	96.8	88.8	128,582
ダイエーホールディングス	-	0.7	277	0.7	0.7	277	テンアライド	10.6	11.5	4,531	10.6	11.5	4,531	あおぞら銀行	66.6	67.5	210,600	66.6	67.5	210,600
パロックスパルミテッド	5.2	6.5	6,376	6.5	6.5	6,376	AOKIホールディングス	22.3	24.2	30,371	22.3	24.2	30,371	三井住友フィナンシャルグループ	7,901.7	8,428.8	4,872,689	7,901.7	8,428.8	4,872,689
グスリのアオキホールディングス	8.9	9.7	8,778	9.7	9.7	8,778	オーワーク	16	17.2	17,905	16	17.2	17,905	りそなホールディングス	1,227.4	1,328	687,505	1,227.4	1,328	687,505
カノ源ホールディングス	8.9	12	86,520	12	12	86,520	コメリ	17.2	18.7	51,574	17.2	18.7	51,574	三井住友トラストホールディングス	219.9	237.9	971,107	219.9	237.9	971,107
スローローバルホールディングス	-	3.4	2,652	3.4	3.4	2,652	青山商事	21.4	21.1	57,265	21.4	21.1	57,265	三井住友フィナンシャルグループ	846.5	853	3,350,584	846.5	853	3,350,584
LIXILビバ	10.7	13.3	86,450	13.3	13.3	86,450	しまむら	13	14.1	133,950	13	14.1	133,950	第四銀行	13.7	-	-	13.7	-	-
メディカルシステムネットワーク	10.6	10.2	14,983	10.2	10.2	14,983	はせがわ	5.9	6.1	2,403	5.9	6.1	2,403	北越銀行	11.2	-	-	11.2	-	-
総合メディカル	12.7	12.9	5,830	12.9	12.9	5,830	高島屋	175	94.7	135,610	175	94.7	135,610	千葉銀行	401	428.7	288,943	401	428.7	288,943
はるやまホールディングス	4.9	-	-	-	-	-	松屋	22.5	24.3	25,636	22.5	24.3	25,636	群馬銀行	227.1	242	112,046	227.1	242	112,046
ノジマ	5.2	5.5	4,526	5.5	5.5	4,526	エイチ・ツー・オー リテイリング	52.9	62.1	95,261	52.9	62.1	95,261	武蔵野銀行	17.8	18	43,182	17.8	18	43,182
カッパ・クリエイト	19.6	21.6	42,098	21.6	21.6	42,098	近鉄百貨店	4.3	4.7	15,933	4.3	4.7	15,933	千葉興業銀行	30.8	33.3	11,322	30.8	33.3	11,322
ライトオン	13.9	16.9	23,085	16.9	16.9	23,085	パルコ	10.7	11.7	12,343	10.7	11.7	12,343	筑波銀行	46.6	50.4	10,735	46.6	50.4	10,735
ジーンズメイト	9.4	10.2	8,282	10.2	10.2	8,282	丸井グループ	107	102.3	206,134	107	102.3	206,134	七十七銀行	35.1	37.9	68,182	35.1	37.9	68,182
良品計画	3.4	3.7	1,439	3.7	3.7	1,439	アクシアル リテイリング	9.3	10	34,350	9.3	10	34,350	青森銀行	8.7	9.4	24,947	8.7	9.4	24,947
三城ホールディングス	14.8	17.1	458,622	17.1	17.1	458,622	井筒屋	6.3	6.4	1,267	6.3	6.4	1,267	秋田銀行	7.2	7.7	16,285	7.2	7.7	16,285
アドヴァン	13.8	15.1	6,160	15.1	15.1	6,160	イオン	429.7	465.1	1,040,196	429.7	465.1	1,040,196	山形銀行	12.6	13.7	26,098	12.6	13.7	26,098
アルビス	11.4	18.6	18,432	18.6	18.6	18,432	イズミ	20.2	24.5	130,830	20.2	24.5	130,830	岩手銀行	7.8	8.5	27,497	7.8	8.5	27,497
コナカ	2.5	4.6	10,925	4.6	4.6	10,925	東武ストア	1.3	-	-	1.3	-	-	東邦銀行	99.9	108.2	32,676	99.9	108.2	32,676
ハウス オブ ローゼ	14.3	15.7	6,923	15.7	15.7	6,923	平和堂	22.7	24.5	61,127	22.7	24.5	61,127	東北銀行	5.8	6.3	6,659	5.8	6.3	6,659
G-7ホールディングス	3.4	1.5	2,755	1.5	1.5	2,755	フジ	13.1	14.6	26,980	13.1	14.6	26,980	みちのく銀行	7.2	7.7	12,435	7.2	7.7	12,435
イオン北海道	1.3	3.5	8,011	3.5	3.5	8,011	ヤオコー	12.7	13.8	80,454	12.7	13.8	80,454	ふくおかフィナンシャルグループ	454	98.3	229,235	454	98.3	229,235
コジマ	11.2	12.3																		

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末				
	株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数		株	数	評 価 額	株	数	株	数	評 価 額
		千株		千株		千円			千株		千株		千円			千株		千株		千株		千円
百五銀行	107.3	108.8	40,256	40,256			保険業 (2.3%)								シーアールイー	1.8	4	3,612				
京都銀行	42.7	43.4	194,649	194,649			かんぽ生命保険	42.2	45.7	113,244					プロバリエーション	-	1.1	1,300				
紀陽銀行	42.2	42.9	65,250	65,250			SOMPホールディングス	219.3	213.3	853,839					ケイイスター不動産	4	3.2	6,092				
三重銀行	5	-	-	-			アニコム ホールディングス	7.6	9.4	27,664					アグレ都市デザイン	-	1.5	915				
ほくふくフィナンシャルグループ	74.4	80.6	97,284	97,284			MSADインフラストラクチャーホールディングス	292.4	316.5	1,019,763					グッドコムアセット	-	2.2	3,399				
広島銀行	165.1	178.5	107,635	107,635			ソニーフィナンシャルホールディングス	91.9	99.4	208,143					ジェイ・エス・ビー	-	0.4	1,570				
山陰合同銀行	66.3	71.8	54,137	54,137			第一生命ホールディングス	632.7	684.7	1,195,143					パーク24	62	70.6	184,124				
中国銀行	77.3	78.1	78,334	78,334			東京海上ホールディングス	421.3	438.8	2,343,630					パラカ	3.6	3.1	5,266				
鳥取銀行	3.6	4.3	5,779	5,779			T&Dホールディングス	345.9	374.2	506,105					三井不動産	558.5	642.2	1,702,793				
伊予銀行	159.6	160.3	95,218	95,218			アドバンスクリエイト	2.6	2.8	4,958					三菱地所	832.5	847.9	1,617,793				
百十四銀行	119	12.9	31,243	31,243			その他金融業 (1.2%)							平和不動産	19.8	23	47,564					
四国銀行	17.1	17.3	17,697	17,697			全国保証	31.5	34.1	133,331					東京建物	122.2	132.2	176,883				
阿波銀行	90	19.4	58,976	58,976			ジェイリース	-	2.6	949				ダイビル	28.8	35.6	38,092					
大分銀行	6.4	7.4	24,198	24,198			イントラスト	-	3.4	1,485				京阪神ビルディング	18.6	21.7	19,356					
宮崎銀行	7.4	8	21,120	21,120			日本モーゲージサービス	-	1.6	2,118				住友不動産	268	272	1,120,640					
佐賀銀行	6.8	7.3	12,577	12,577			CASA	-	4.1	4,739				大京	17.8	-	-					
十八銀行	69	7.4	19,158	19,158			アルヒ	9.6	11	25,300				テーオーシー	38.6	27.7	22,935					
沖縄銀行	10.9	11.1	34,798	34,798			プレミアグループ	-	2.5	7,975				東京楽天地	1.8	1.9	8,787					
琉球銀行	21.7	27.9	29,685	29,685			クレディセゾン	84.9	84.7	118,749				レオパレス21	133.5	149.3	76,889					
セブン銀行	419.5	408.8	139,400	139,400			アクリーティブ	6.3	-	-				スターツコーポレーション	15.2	16.4	40,508					
みずほフィナンシャルグループ	15,195.2	16,445.7	2,851,684	2,851,684			芙蓉総合リース	12.8	13.9	75,338				フジ住宅	14.3	15.4	13,167					
高知銀行	4.1	4.5	3,312	3,312			興銀リース	21	22.7	57,113				空港施設	11.7	14.4	7,804					
山口フィナンシャルグループ	105	151.1	165,152	165,152			東京センチュリー	22.5	24.4	122,976				明和地所	6.2	6.7	4,087					
長野銀行	3	4.1	6,154	6,154			日本証券金融	45.8	53.3	32,353				ゴールドクレスト	8.8	9.5	15,333					
名古屋銀行	9.7	9.8	31,556	31,556			アイフル	187.8	184.4	51,263				日本エスリード	4.4	4.7	7,440					
北洋銀行	168.6	182.3	51,773	51,773			リコーリース	8.8	9.5	32,347				日神不動産	14.9	17.8	7,938					
愛知銀行	3.8	4.4	14,960	14,960			イオンフィナンシャルサービス	79.4	77.2	162,274				日本エスコ	20.1	21.9	17,979					
第三銀行	6.3	-	-	-			アコム	224.9	243.2	88,768				タカラレーベン	52.4	56.6	19,753					
中京銀行	4.6	5	10,660	10,660			ジャックス	13.6	13.4	25,285				サンヨーハウジング名古屋	5.8	6.8	6,276					
大光銀行	3.8	4	6,564	6,564			オリエントコーポレーション	242.1	327.1	39,906				イオンモール	72.1	60.6	111,988					
愛媛銀行	15.6	16.9	17,491	17,491			日立キャピタル	30.8	28.6	70,070				ファースト住建	4.2	4.6	5,345					
トマト銀行	4.3	4.8	5,020	5,020			アプラスフィナンシャル	54.4	58.7	4,813				ランド	241.4	492.6	4,433					
みなと銀行	10.1	-	-	-			オリックス	746	807.5	1,328,337				カチヤス	11.4	13.5	47,452					
京葉銀行	99	53.4	34,977	34,977			三菱UFJリース	283.9	273.1	153,209				トーセイ	13.6	16.6	17,944					
関西アーバン銀行	15.6	-	-	-			九州リースサービス	4.8	5.9	4,082				穴吹興産	1.2	1.3	3,602					
栃木銀行	57.9	62.7	14,295	14,295			日本取引所グループ	328.6	326.8	615,691				エヌ・ティ・ティ都市開発	69.5	-	-					
北日本銀行	3.5	3.9	7,959	7,959			イー・ギャランティ	3	11.3	12,068				サンフロンティア不動産	12.6	16.7	20,958					
東和銀行	19.6	21.2	14,416	14,416			アサックス	1.6	4.9	2,631				エフ・ジェー・ネクスト	8.6	10.5	9,114					
福島銀行	10.6	10.5	4,021	4,021			NE(キャピタルソリューション)	4.6	5	8,020				インテリクス	3.2	3.5	2,271					
大東銀行	5.4	5.8	3,520	3,520			不動産業 (2.5%)							ランドビジネス	6.9	6.2	4,817					
トモニホールディングス	92.2	93.5	36,839	36,839			いちご	159.8	153.9	57,712				ブランドハウス	9.9	10.6	4,526					
フィデアホールディングス	108.6	117.8	15,903	15,903			日本駐車場開発	135.1	145.8	23,328				日本空港ビルディング	32.7	38.6	165,015					
池田泉州ホールディングス	118.6	128.5	38,164	38,164			ヒューリック	233.5	252.6	252,600				サービス業 (4.8%)								
証券・商品先物取引業 (0.8%)							三栄建築設計	4.5	4.9	8,202				日本工営	7.3	7.8	19,624					
FPG	39.1	38.7	39,938	39,938			スター・マイカ	4.1	5.5	8,019				LIFULL	37.7	40.7	27,798					
マセキリアルエステート	2.3	4.7	3,431	3,431			野村不動産ホールディングス	74.4	80.6	172,967				ジェイエイチリートメント	8.7	9.4	21,291					
SBIホールディングス	126.5	144.2	317,384	317,384			三重交通グループホールディングス	22.7	24.6	15,055				日本M&Aセンター	37.5	87.3	247,320					
日本アジア投資	10.1	10.5	2,089	2,089			サムティ	9.5	16.7	24,949				メンバーズ	2.7	4	5,588					
ジャフコ	16.1	19.8	74,646	74,646			ディア・ライフ	11.3	15.4	6,945				中広	1.2	1.1	612					
大和証券グループ本社	957	971.1	541,776	541,776			コーセーアールイー	1.9	3.7	2,793				タケエイ	11.3	12.2	9,064					
野村ホールディングス	1,924	2,129.4	925,224	925,224			エー・ディー・ワークス	150	171.5	5,831				E・Jホールディングス	-	1.5	1,570					
岡三証券グループ	95	103.1	48,766	48,766			日本商業開発	6.3	7.5	11,392				トラスト・テック	4.9	5.6	18,452					
丸三証券	35.6	35.9	28,684	28,684			フレックスコーポレーション	15.3	19.1	29,261				コジカホールディングス	5.7	31.3	50,048					
東洋証券	40	43.4	7,030	7,030			エニソホールディングス	13.1	18.3	39,820				アルトナー	-	2.2	1,975					
東証フィナンシャルホールディングス	123.8	144.3	67,676	67,676			THEグローバル社	5.3	5.5	2,695				パソナグループ	10.3	14.3	19,919					
光世証券	2.7	2.9	2,108	2,108			日本管理センター	7.4	7.9	6,809				CDS	3	2.9	3,262					
水戸証券	34.7	35.1	9,126	9,126			サンセイラディック	3.3	3.2	2,512				リクアンドモチベーション	19.9	21.6	19,548					
いちよし証券	23.5	25.4	21,793	21,793			エストラスト	1.6	1.6	1,228				GCA	12.4	12	9,408					
松井証券	54.7	59.3	68,788	68,788			フジヤースホールディングス	27.2	27	18,144				エス・エム・エス	21.4	43.1	79,691					
だいがう証券ビジネス	5.5	5	1,995	1,995			オープンハウス	18.2	19.7	89,438				パソルホールディングス	100	117.3	228,148					
マネックスグループ	118.7	113	42,488	42,488			東急不動産ホールディングス	270.8	325.4	197,192				リニカル	7	6.6	9,292					
カブドットコム証券	71.6	90.4	47,460	47,460			阪田グループホールディングス	93.3	101	202,808				クックパッド	34.1	36.7	11,010					
極東証券	15	16.2	18,500	18,500			イープランド	-	1.8	1,225				エスクリ	3.8	3.2	1,913					
岩井コスモホールディングス	11.4	12.4	14,892	14,892			ムゲンエステート	6.9	8.5	5,015				アイ・ケイ・ケイ	6.4	5.8	4,170					
藍澤證券	20.9	22.7	14,800																			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	
N J S		千株	千円		千株	千円			千株	千円			千株	千円			千株	千円			
総合警備保障	43.1	46.6	222,748		3,900	3,900	東京個別指導学院		3.8	4.2	5,590		6.7	7.2	24,048		6.7	7.2	24,048		
カカコム	83.3	88.3	177,306		46.6	222,748	サイバーエージェント		71.2	72.3	226,660		16.9	20.9	88,616		16.9	20.9	88,616		
アイロムグループ	3.7	4.5	6,984		88.3	177,306	楽天		555.6	546.6	442,199		2.1	2.3	4,462		2.1	2.3	4,462		
セントレア・ホールディング	4.6	6.4	3,545		4.5	6,984	クロー・アンド・リバー社		5.6	6.8	7,786		19.3	17.8	88,377		19.3	17.8	88,377		
サイネックス	1.6	1.8	1,314		3.7	3,545	テフ・オー・ダブリュー		9.7	11.2	8,142		12.1	12.3	15,153		12.1	12.3	15,153		
ルネサンス	5.3	6.5	12,707		1.6	1,314	セントラルスポーツ		4	4.4	14,850		7.5	8	11,192		7.5	8	11,192		
ディップ	15.3	18.9	37,308		5.3	12,707	フルキャストホールディングス		9.5	11.8	23,163		スベース	7	7.6	9,477		スベース	7	7.6	9,477
オプトホールディング	7.6	7.1	11,381		15.3	37,308	エン・ジャパン		-	12.8	54,848		3.3	4.7	3,755		3.3	4.7	3,755		
新日本科学	13.2	15.9	11,495		7.6	11,381	リソルホールディングス		1.2	1.3	5,434		2.6	2.6	6,492		2.6	2.6	6,492		
ツクイ	25.5	27.6	22,024		13.2	11,495	テクノプロ・ホールディングス		19.3	23.6	142,072		0.8	0.7	3,885		0.8	0.7	3,885		
キャリアデザインセンター	2.5	3	3,594		25.5	22,024	アトラ		1.9	2.3	931		4.5	4.6	5,805		4.5	4.6	5,805		
ベネフィット・ワン	-	16.2	61,803		2.5	3,594	インターワークス		2.4	2.3	1,720		2.1	2.3	2,948		2.1	2.3	2,948		
エムスリー	114	246.9	382,695		-	61,803	アイ・アールジャパンホールディングス		-	3.8	4,841		2.2	3.3	18,018		2.2	3.3	18,018		
ツカガ・グローバルホールディング	8.7	7.5	4,612		114	246,900	KeepPer 技研		3.5	3.9	3,681		2.4	2.6	10,530		2.4	2.6	10,530		
プラス	0.6	0.8	468		8.7	4,612	ファーストロジック		1.7	2.3	1,591		8.1	7.6	23,218		8.1	7.6	23,218		
アウトソーシング	32.3	61.8	81,205		0.6	468	三機サービス		1.2	1.9	2,696		4.4	4.8	7,603		4.4	4.8	7,603		
ウエルネット	11	11.9	12,387		32.3	81,205	Gunosy		4.9	7.2	18,194		16.5	17.4	51,591		16.5	17.4	51,591		
ワールドホールディングス	3.6	3.2	8,755		11	12,387	デザインワン・ジャパン		2.1	2.3	729		43.9	43.8	42,310		43.9	43.8	42,310		
ディー・エヌ・エー	58.4	63.2	109,209		3.6	8,755	イー・ガーディアン		5.5	5.5	12,012		9.5	12	39,300		9.5	12	39,300		
東映D Yホールディングス	150.6	163	267,809		58.4	109,209	リブセンス		7.1	6.3	1,814		62	63	1,827		62	63	1,827		
ぐるなび	17.2	16.6	11,387		150.6	267,809	ジャパネット東宝		9.9	32.1	42,660		12	13	27,079		12	13	27,079		
エスアールジータカミヤ	12.8	12.2	8,381		17.2	11,387	ベクトル		13	14.3	19,934		25.3	27.3	81,627		25.3	27.3	81,627		
ジャパネット東宝システム	13.5	9.3	11,522		12.8	8,381	ウチヤマホールディングス		5.4	5.9	2,708		4.3	4.7	12,657		4.3	4.7	12,657		
ファンコミュニケーションズ	30.2	32.2	18,450		13.5	9,300	ライクキッズネクスト		1.1	2.5	2,170		6.7	6.3	7,673		6.7	6.3	7,673		
ライク	4.3	4.6	4,604		30.2	18,450	キャリアリンク		3.1	4.3	1,522		11.6	12.6	24,028		11.6	12.6	24,028		
ビジネス・ブレークスルー	5.2	4.9	1,631		4.3	4,604	I B J		8.6	7.8	6,466		10.5	11.3	31,425		10.5	11.3	31,425		
WDBホールディングス	5	5.3	13,901		5.2	1,631	アサント		3.9	4.7	10,283		1.2	1.3	3,590		1.2	1.3	3,590		
ティア	5.7	5.4	3,348		5	13,901	N・フィールド		6.1	7.5	6,720		115	124.4	1,124,824		115	124.4	1,124,824		
CDG	1	1	1,324		5.7	3,348	パリュウHR		2.5	2.5	4,560		5.2	5.6	23,968		5.2	5.6	23,968		
パリュウコマース	9.7	7.8	15,038		1	1,324	M&Aキャピタルパートナーズ		2.2	3	17,070		22.2	22.2	25,885		22.2	22.2	25,885		
インフォーマット	54.8	64.3	76,517		9.7	15,038	ライドエクスプレスホールディングス		4.4	4.8	6,158		12.7	14.8	71,114		12.7	14.8	71,114		
J Pホールディングス	34.1	33.5	9,916		54.8	76,517	ER Iホールディングス		3.1	3.3	2,517		12.2	12.6	14,905		12.2	12.6	14,905		
Eコナックホールディングス	21.7	22.2	2,686		34.1	9,916	アビスト		1.5	1.9	9,596		22.5	24.3	55,209		22.5	24.3	55,209		
E P Sホールディングス	16.3	17.6	30,606		21.7	2,686	シグマクシス		4.3	5.5	4,515		5	5.2	3,078		5	5.2	3,078		
レップス	2.7	2.9	2,784		16.3	30,606	ウィルグループ		4.7	7.5	6,982		8.6	9.3	5,635		8.6	9.3	5,635		
フレタージ・インターナショナル	22.5	22	28,974		2.7	2,784	エスコロー・エージェンツ・ジャパン		14.9	16.1	4,025		2.2	2.3	2,267		2.2	2.3	2,267		
アミューズ	7.2	7.1	17,984		22.5	22,000	日本ビューホテル		2.4	3.8	4,195		3	4	5,500		3	4	5,500		
ドリムインキュベーター	3.6	3.5	5,155		7.2	17,984	リクルートホールディングス		835.9	839.9	2,449,148		39.7	43	125,732		39.7	43	125,732		
クイック	6.7	7.2	11,556		3.6	5,155	エラン		2.7	8	10,168		13.4	14.4	58,248		13.4	14.4	58,248		
T A C	6.7	6.8	1,591		6.7	11,556	土木管理総合試験所		3.3	5.1	2,754		7.3	7.4	7,718		7.3	7.4	7,718		
ケネディクス	143.5	103	61,491		6.7	1,591	日本郵政		614.8	961.1	1,270,574		20.6	16.7	21,693		20.6	16.7	21,693		
電通	132	142.9	718,787		143.5	103,000	ベルシテム24ホールディングス		18.2	19.6	27,871		18.2	19.6	50,509		18.2	19.6	50,509		
テイクアンドグヴ・ニーズ	5.1	4.5	8,883		132	718,787	鎌倉新書		1.5	8.6	13,295		4	4.4	6,261		4	4.4	6,261		
ぴあ	3.6	3.3	12,952		5.1	8,883	一蔵		1.4	1.5	933										
オンファンタジー	3.5	3.8	9,975		3.6	12,952	L I T A L I C O		1.9	2.7	5,470										
シーティーエス	11.1	13.3	8,684		3.5	9,975	グローバルグループ		1.2	1.4	1,332										
ネクシィーズグループ	4.3	3.7	6,278		11.1	13,300	エポラブルアジア		2.2	3.3	7,652										
みらかホールディングス	32.3	32.9	94,686		4.3	6,278	アトラエ		-	2.3	4,935										
アルプス技研	9.5	10.2	18,492		32.3	94,686	ストライク		1	3	6,429										
サンックス	17.4	20.5	4,223		9.5	18,492	ソラスト		6.5	28.5	30,922										
ダイオーズ	2.2	2.8	3,628		17.4	20,500	セラク		1.9	2.6	1,549										
日本空調サービス	11.4	13.4	8,656		2.2	3,628	インソース		1.3	3.9	8,572										
オリエンタルランド	128	138.6	1,608,453		11.4	13,400	ペイカレント・コンサルティング		-	6.2	19,313										
ダスキン	29.1	31.6	79,537		128	1,608,453	アイモパイル		-	2.8	2,007										
明光ネットワークジャパン	13.7	14.8	13,571		29.1	79,537	キャリアインテックス		1.1	4	5,116										
ファルコホールディングス	5.6	6.5	9,321		13.7	13,571	MS - Japan		0.8	4.7	8,460										
秀英予備校	2.4	2.5	1,215		5.6	9,321	船場		-	2.1	1,801										
田谷	2	2.1	1,316		2.4	1,215	グレイステクノロジー		-	3.2	7,120										
ラウンドワン	33.6	36.3	46,972		2	1,316	ジャウエレクトロニクスホールディングス		-	6.9	11,964										
リゾートトラスト	45.9	49.6	77,921		33.6	46,972	フルテック		-	1.3	1,433										
ビー・エム・エル	13.9	15.1	46,885		45.9	77,921	グリーンズ		-	2.6	3,751										
ワタベウェディング	1.8	1.9	1,265		13.9	46,885	ツナグ・ソリューションズ		-	1	648										
りらいあコミュニケーションズ	17.1	21.2	19,398		1.8	1,265	日総工業		-	2.9	6,162										
リソー教育	18.4	59.5	27,608		17.1	19,398	キュービーネットホールディングス		-	5.9	11,522										
早稲田アカデミー	1.6	1.6	2,892		18.4	27,608	スプリックス		-	3.3	7,850										
ユー・エス・エス	132.3	143.3	276,425		1.6	2,892	アドバテックシステムズ		2.7	4.6	4,508										
					132.3	276,425	リログループ		59.3	64.1	186,338										

(注1)

(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 4,121		百万円 -

■投資信託財産の構成

2019年2月7日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	281,168,547,397円
一 等 株 式 (評 価 額)	4,125,464,360
未 収 入 金	275,040,369,410
未 収 配 当 金	89,044,788
差 入 委 託 証 拠	424,228,839
(B) 負 債	1,984,233,000
未 払 託 証 拠 金 代 用 約 有 価 証 券	376,733,000
差 入 委 託 証 拠 金 代 用 約 有 価 証 券	1,607,500,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	279,184,314,397
元 次 期 繰 越 損 益 金	115,232,523,115
(D) 受 取 益 権 総 額 (C / D)	163,951,791,282
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	115,232,523,115円 24,228円

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2018年2月8日 至2019年2月7日

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

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

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

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

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第16期（決算日 2019年2月21日）

（計算期間 2018年2月22日～2019年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月10日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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	債券先物率	純資産額
	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			
12期（2015年2月23日）	18,820	14.8	ポイント 117,697.87	% 14.9	% 97.5	% -	百万円 345,838
13期（2016年2月22日）	17,881	△5.0	111,769.89	△5.0	97.6	-	267,780
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9	108,792.68	△2.7	97.9	-	248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

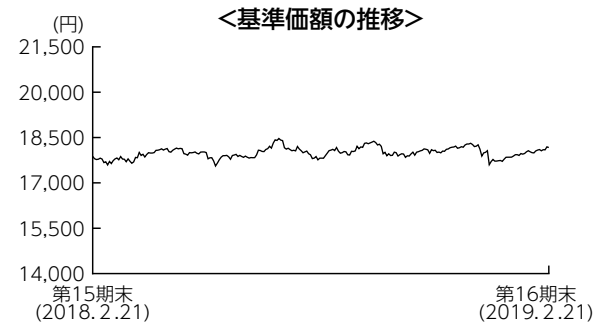
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (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			
(期 首) 2018 年 2 月 21 日	円 17,876	% -	ポイント 111,885.82	% -	% 97.7	% -
2 月 末	17,790	△0.5	111,369.59	△0.5	98.1	-
3 月 末	17,907	0.2	112,110.56	0.2	96.6	-
4 月 末	18,127	1.4	113,447.49	1.4	101.8	-
5 月 末	17,660	△1.2	110,306.34	△1.4	97.4	-
6 月 末	17,925	0.3	112,167.37	0.3	97.3	-
7 月 末	18,060	1.0	113,026.89	1.0	97.4	-
8 月 末	18,047	1.0	112,887.86	0.9	97.0	-
9 月 末	18,348	2.6	115,005.76	2.8	97.2	-
10 月 末	18,016	0.8	112,853.40	0.9	97.9	-
11 月 末	18,179	1.7	113,725.26	1.6	97.5	-
12 月 末	18,064	1.1	112,822.19	0.8	97.6	-
2019 年 1 月 末	17,952	0.4	111,997.50	0.1	98.1	-
(期 末) 2019 年 2 月 21 日	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月22日から2019年2月21日まで）



基準価額の推移

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

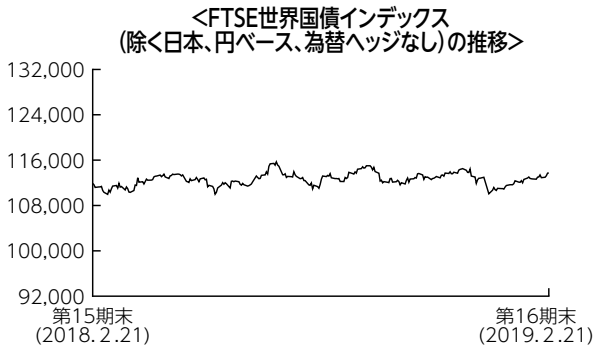
基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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



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

ポートフォリオについて

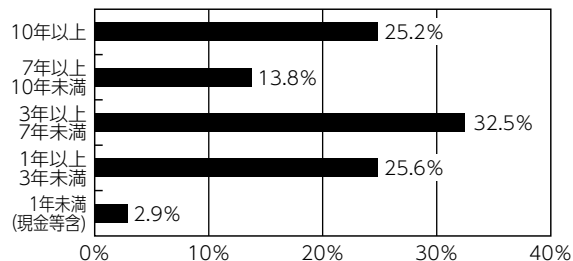
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

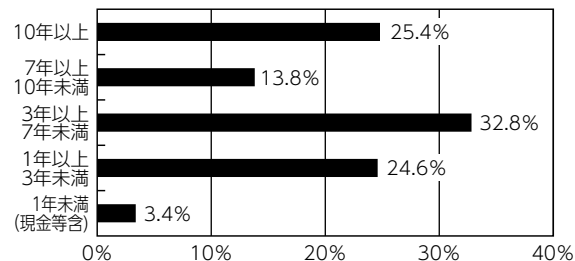
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

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

期末

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

(注) 世界国債インデックスとは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1.7%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,996円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2018年2月22日から2019年2月21日まで）

公社債

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

(注) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当	種	利	率	額	期		末		
						面	評		額	
							金			外
(ユーロ…スペイン)				%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
SPAIN 0.75 07/30/21	国	債	証	0.7500	1,700	1,737	218,075	2021/07/30		
SPAIN 1.15 07/30/20	国	債	証	1.1500	2,100	2,143	268,994	2020/07/30		
SPAIN 0.35 07/30/23	国	債	証	0.3500	1,460	1,470	184,474	2023/07/30		
SPAIN 2.75 10/31/24	国	債	証	2.7500	2,390	2,695	338,316	2024/10/31		
SPAIN 5.15 10/31/28	国	債	証	5.1500	1,900	2,581	323,932	2028/10/31		
SPAIN 5.15 10/31/44	国	債	証	5.1500	1,500	2,337	293,283	2044/10/31		
SPAIN 2.9 10/31/46	国	債	証	2.9000	1,800	2,002	251,305	2046/10/31		
SPAIN 2.7 10/31/48	国	債	証	2.7000	950	1,007	126,380	2048/10/31		
SPAIN 4.85 10/31/20	国	債	証	4.8500	2,900	3,151	395,483	2020/10/31		
SPAIN 2.15 10/31/25	国	債	証	2.1500	2,100	2,300	288,714	2025/10/31		
SPAIN 1.45 10/31/27	国	債	証	1.4500	2,200	2,271	284,989	2027/10/31		
SPAIN 1.3 10/31/26	国	債	証	1.3000	2,400	2,476	310,720	2026/10/31		
SPAIN 4.4 10/31/23	国	債	証	4.4000	2,300	2,743	344,230	2023/10/31		
SPAIN 0.45 10/31/22	国	債	証	0.4500	1,340	1,362	170,921	2022/10/31		
小計					75,970	88,720	11,133,550			
(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	5.7500	2,240	2,863	359,298	2033/02/01		
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国	債	証	4.0000	3,020	3,276	411,117	2037/02/01		
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国	債	証	2.0000	2,090	1,981	248,701	2028/02/01		
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国	債	証	2.7000	1,650	1,416	177,780	2047/03/01		
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国	債	証	3.4500	1,430	1,379	173,051	2048/03/01		
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国	債	証	4.5000	2,390	2,680	336,316	2024/03/01		
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国	債	証	2.8000	660	538	67,608	2067/03/01		
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国	債	証	5.0000	2,400	2,777	348,544	2025/03/01		
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国	債	証	5.0000	2,590	2,878	361,226	2022/03/01		
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国	債	証	4.5000	2,110	2,398	300,979	2026/03/01		
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	国	債	証	4.2500	4,600	4,787	600,788	2020/03/01		
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国	債	証	3.7500	3,300	3,501	439,398	2021/03/01		
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国	債	証	1.6500	2,260	1,932	242,447	2032/03/01		
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国	債	証	3.3500	1,100	1,103	138,468	2035/03/01		
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国	債	証	3.5000	2,570	2,692	337,867	2030/03/01		
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国	債	証	0.9500	2,500	2,439	306,164	2023/03/15		
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国	債	証	0.9500	2,420	2,361	296,297	2023/03/01		
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国	債	証	1.3500	2,500	2,508	314,775	2022/04/15		
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国	債	証	1.2000	770	769	96,617	2022/04/01		
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国	債	証	6.0000	3,100	4,006	502,729	2031/05/01		
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国	債	証	4.5000	1,400	1,560	195,831	2023/05/01		
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国	債	証	3.7500	2,300	2,446	307,012	2021/05/01		
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国	債	証	1.8500	2,100	2,090	262,316	2024/05/15		
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国	債	証	1.4500	2,630	2,518	315,998	2025/05/15		
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国	債	証	1.6000	1,500	1,424	178,804	2026/06/01		
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国	債	証	1.5000	2,500	2,396	300,786	2025/06/01		
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国	債	証	2.2000	2,040	1,983	248,857	2027/06/01		
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国	債	証	0.4500	910	904	113,453	2021/06/01		
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国	債	証	3.7500	3,200	3,415	428,553	2021/08/01		
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国	債	証	5.0000	2,510	3,023	379,424	2034/08/01		
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国	債	証	5.0000	2,430	2,934	368,276	2039/08/01		
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国	債	証	4.7500	1,900	2,146	269,355	2023/08/01		

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

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

■投資信託財産の構成

2019年2月21日現在

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

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月21日)現在

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

(注1) 期首元本額	121,875,729,918円	クルーズコントロール<DC年金>	2,093,489円
追加設定元本額	28,217,327,604円	D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	8,556,081円
一部解約元本額	41,303,335,221円	D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	22,578,913円
(注2) 期末における元本の内訳		ダイナミック・ナビゲーション	1,609,469円
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	8,079,391,033円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	15,793,100円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	9,105,775円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	11,075円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	25,280,519円	D I AMパッシブ資産分散ファンド	1,310,116,672円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	30,864,769円	D I AM海替フルハッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	7,061,418,108円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	76,286,272円	D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	3,712,393,566円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	72,349,714円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	3,093,632,320円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	38,058,966円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	6,083,990,824円
たわらノーロード 先進国債券	3,275,191,858円	D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	94,789,701円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	758,173,712円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	159,226,230円	D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	602,968,210円
たわらノーロード バランス (堅実型)	3,033,012円	D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	47,915,924円
たわらノーロード バランス (標準型)	16,033,815円	D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	86,538,439円
たわらノーロード バランス (積極型)	4,324,944円	D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	22,844,836円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	461,289円	D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	6,207,173円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	28,022,793円	D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	54,280,724円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	52,535,294円	D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	74,645,150円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	15,391,137円	D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,247,776,538円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	18,472,796円	D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,149,670,139円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	404,775円	D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,653,553,398円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	1,631,952円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	665,748,223円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	562,231円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	248,926,518円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,090,262円	D I AM アクサグローバル・バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	3,039,294,314円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,431,832,485円	D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	1,707,250,047円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>>1安定型	533,531,954円	D I AMグローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け)	14,665,687円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>>2安定・成長型	1,686,524,738円	D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	15,979,183円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>>3成長型	1,750,349,034円	D I AM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	122,749,235円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	372,685,112円	D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	7,941,548,622円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	812,192,171円	D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	18,779,521,088円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	621,735,533円	D I AMバランス30VA (適格機関投資家限定)	20,111,944円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	22,571,041円	D I AMバランス50VA (適格機関投資家限定)	999,297円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	600,919,427円	D I AMバランス70VA (適格機関投資家限定)	4,973,567円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	3,924,410円	D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	16,716,206,595円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	119,017,497円	D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	88,655,549円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	71,193,232円	D I AMバランス20VA (適格機関投資家限定)	109,040,954円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	115,407,689円	D I AMバランス40VA (適格機関投資家限定)	362,862円
クルーズコントロール	2,914,474,463円	D I AMバランス60VA (適格機関投資家限定)	162,392円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	87,907,821円	期末元本合計	108,789,722,301円
D I AM DC バランス・F (成長型)	149,376,214円		

■損益の状況

当期 自2018年2月22日 至2019年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

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

変更前：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）

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

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

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2019年2月15日）

（計算期間 2018年2月16日～2019年2月15日）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年9月2日から無期限です。
運用方針	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 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）	ポイント			
13期(2015年2月16日)	28,826	27.1	920,295.73	27.4	94.1	3.4	319,197
14期(2016年2月15日)	23,909	△17.1	764,772.48	△16.9	96.1	1.2	242,694
15期(2017年2月15日)	30,270	26.6	971,437.64	27.0	95.6	1.7	278,963
16期(2018年2月15日)	33,302	10.0	1,070,930.74	10.2	95.7	2.2	284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

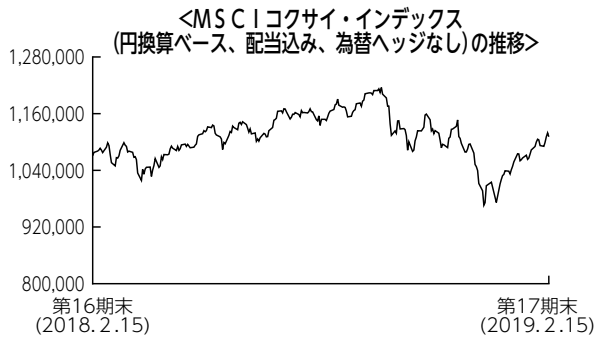
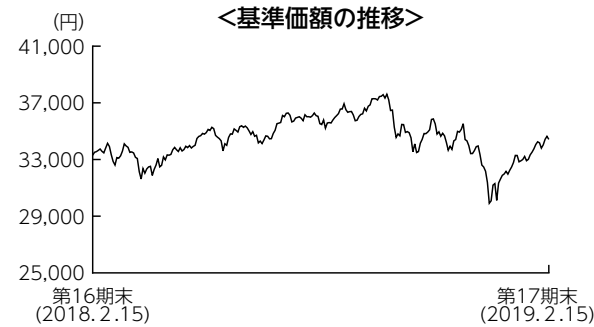
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (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) 2018年 2月 15日	33,302	% -	1,070,930.74	% -	% 95.7	% 2.2
2月 末	33,921	1.9	1,092,375.78	2.0	97.4	3.1
3月 末	32,479	△2.5	1,046,334.72	△2.3	93.9	1.1
4月 末	33,937	1.9	1,093,785.41	2.1	95.2	2.5
5月 末	34,109	2.4	1,098,796.93	2.6	95.2	2.3
6月 末	34,381	3.2	1,108,957.47	3.6	94.7	2.9
7月 末	35,743	7.3	1,153,118.50	7.7	95.4	2.3
8月 末	36,518	9.7	1,177,937.59	10.0	96.1	1.4
9月 末	37,443	12.4	1,208,801.25	12.9	95.5	2.1
10月 末	34,147	2.5	1,102,226.36	2.9	93.1	4.5
11月 末	34,935	4.9	1,127,410.37	5.3	95.8	1.0
12月 末	31,298	△6.0	1,009,333.65	△5.8	94.2	3.1
2019年 1月 末	33,329	0.1	1,074,489.99	0.3	93.8	3.5
(期 末) 2019年 2月 15日	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月16日から2019年2月15日まで）



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

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

期末

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



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は各決算日時点のGICS（世界産業分類基準）によるものです。

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(34,450円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2018年2月16日から2019年2月15日まで)

(1) 株 式

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

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

(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	4.807 (-)	588 (-)	2.467 (-)	307 (-)
BOSTON PROPERTIES INC	5.023 (-)	596 (-)	2.882 (-)	378 (-)
SL GREEN	4.015 (-)	385 (-)	2.3 (-)	224 (-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	48.026 (-)	485 (-)	- (-)	- (-)
PROLOGIS INC	16.198 (-)	1,056 (-)	- (-)	- (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.711 (-)	471 (-)	- (-)	- (-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.777 (-)	164 (-)	- (-)	- (-)
EQUINIX INC	1.516 (-)	571 (-)	- (-)	- (-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	3.105 (-)	152 (-)	- (-)	- (-)
DUKE REALTY TRUST	18.889 (-)	525 (-)	10.405 (-)	296 (-)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	7.368 (-)	775 (-)	- (-)	- (-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.129 (-)	281 (-)	- (-)	- (-)
EQUITY RESIDENTIAL	5.906 (-)	394 (-)	- (-)	- (-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3.856 (-)	437 (-)	2 (-)	237 (-)
GGP INC	7.4 (-)	150 (△281)	50.863 (-)	15 (-)
HCP INC	5.147 (-)	148 (-)	- (-)	- (-)
SBA COMMUNICATIONS CORP	2.108 (-)	372 (-)	- (-)	- (-)
WELLTOWER INC	6.793 (-)	474 (-)	- (-)	- (-)

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

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
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
SCENTRE GROUP	93.268 (-)	360 (-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	22 (-)	1,735 (-)	(-)	(-)
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	(-)	(△2)	(-)	(-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	384.8 (-)	673 (-)	178.5 (-)	305 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	(-)	(△2)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
LAND SECURITIES GROUP PLC	33.384 (-)	311 (-)	12.296 (-)	114 (-)
SEGRO PLC	42.887 (-)	247 (-)	21.086 (-)	138 (-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	3.332 (10.338)	493 (-)	1.609 (-)	244 (-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
COVIVIO	2.332 (-)	196 (-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO SE	3.117 (△10.338)	602 (-)	(-)	(-)

(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 109,193	百万円 108,526	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	92,002,372千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	299,138,263千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.30

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

(1) 外国株式

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
TELEFLEX INC	32.03	39.05	1,099	121,410		ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	638.53	805.53	1,391	153,727		医薬品
ANDEAVOR	115	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
TEXAS INSTRUMENTS INC	696.26	846.28	9,052	999,775		半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	190.76	221.99	1,198	132,389		航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	280.65	353.36	8,697	960,563		ライフサイエンス・ツール/サービス
TIFFANY & CO	87.33	87.33	788	87,120		専門小売り
TOLL BROTHERS INC	95.26	—	—	—		家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	76.99	106.61	872	96,346		保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	112.79	143.84	1,324	146,307		情報技術サービス
DAVITA INC	108.78	108.78	631	69,787		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	92.76	110.88	1,062	117,288		専門小売り
TRIMBLE INC	200.73	200.73	779	86,036		電子装置・機器・部品
TYSON FOODS INC	216.21	246.07	1,505	166,262		食品
UGI CORP	120.68	147.25	780	86,238		ガス
MARATHON OIL CORP	587.47	718.46	1,214	134,175		石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	566.17	638.7	10,834	1,196,536		陸運・鉄道
UNITED TECHNOLOGIES CORP	536.9	709.43	8,806	972,551		航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	683.78	839.99	22,287	2,461,426		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	63.51	77.43	1,035	114,357		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	68.48	84.38	1,111	122,795		ヘルスケア機器・用品
VF CORP	243.09	300.57	2,584	285,376		繊維・アパレル・贅沢品
CBS CORP	237.81	307.11	1,507	166,533		メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	177.42	223.69	4,154	458,808		バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	89.64	121.42	1,368	151,113		建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	632.86	719.45	5,187	572,957		食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,061.26	1,270.54	12,517	1,382,417		食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	322.16	369.86	3,655	403,735		商業サービス・用品
WATERS CORP	59.63	69.53	1,609	177,766		ライフサイエンス・ツール/サービス
ALLERGAN PLC	233.13	296.2	4,107	453,621		医薬品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	76.71	104.59	1,062	117,288		食品
VAIL RESORTS INC	25.98	37.73	781	86,325		ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	205.16	260.76	1,251	138,174		コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	54.97	75.3	542	59,917		機械
WHIRLPOOL CORP	55.53	55.53	763	84,368		家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	135.29	162.96	1,362	150,529		半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	62.79	92.4	1,140	125,956		ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	91.32	91.32	795	87,904		資本市場
CME GROUP INC	242.03	304.37	5,399	596,323		資本市場
WILLIAMS COS INC	610.81	1,061.74	2,851	314,956		石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	229.48	266.9	706	77,994		販売
ALLIANT ENERGY CORP	163.83	199.1	893	98,684		電力
WEC ENERGY GROUP INC	231.17	280.63	2,084	230,183		総合公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	186.31	256.64	1,424	157,305		資本市場
CARMAX INC	135.13	159.79	977	107,930		専門小売り
XEROX CORP	174.55	174.55	520	57,504		コンピュータ・周辺機器
XILINX INC	168.37	210.93	2,478	273,764		半導体・半導体製造装置
CIMAREX ENERGY CO	70.03	92.53	692	76,509		石油・ガス・消耗燃料
TJX COMPANIES INC	439.99	1,073.99	5,316	587,126		専門小売り
ZIONS BANCORP NA	165.84	165.84	811	89,617		銀行
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	—	274	243	26,931		食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	764	764	545	60,244		不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	157	157	1,109	122,587		コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	171	667	73,746		コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	60.51	81.92	680	75,119		バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	41.71	41.71	554	61,251		銀行
CBRE GROUP INC	209.76	294.99	1,459	161,199		不動産管理・開発

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル 千円	
LIBERTY GLOBAL PLC	124.35	198.35	494 54,589	メディア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	-	43.5	1,190 131,484	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	844.86	929.92	1,442 159,288	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	32.56	32.56	935 103,267	ホテル・レストラン・レジャー
WESTLAKE CHEMICAL CORP	-	30	233 25,776	化学
T-MOBILE US INC	211.88	302.13	2,130 235,239	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	283.87	333.32	1,978 218,552	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	265.25	314.33	1,003 110,878	化学
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	273.32	390.26	1,936 213,906	娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	753.4	917.84	4,589 506,831	娯楽
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	54.73	-	-	運送インフラ
CELANESE CORP	94.91	118.8	1,182 130,599	化学
DEXCOM INC	-	76.65	1,133 125,141	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	104.23	104.23	299 33,117	メディア
EXPEDIA GROUP INC	87.09	103.73	1,314 145,215	インターネット販売・通信販売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	184.75	785 86,797	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	105.78	124.93	1,588 175,446	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	418.18	418.18	1,006 111,210	メディア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	420.85	494.25	3,753 414,572	資本市場
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	146.96	146.96	320 35,430	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOM INC-CLASS B	246.12	302.82	864 95,481	娯楽
LIVE NATION	88.64	136.82	757 83,666	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	18.07	22.24	1,344 148,459	ホテル・レストラン・レジャー
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	61.91	61.91	545 60,271	旅客航空輸送業
TRANSDIGM GROUP INC	38.12	43.12	1,853 204,663	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	670.15	806.15	17,719 1,956,994	情報技術サービス
QURATE RETAIL INC	295.31	357.33	783 86,504	インターネット販売・通信販売
WYNDHAM DESTINATIONS INC	74.36	-	-	ホテル・レストラン・レジャー
HANESBRANDS INC	276.19	276.19	516 57,070	繊維・アパレル・贅沢品
WESTERN UNION CO	352.22	352.22	625 69,046	情報技術サービス
OWENS CORNING	73.33	105.91	567 62,717	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	93.22	131.82	821 90,741	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	115.86	115.86	552 61,009	商社・流通業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	75.76	91.75	859 94,894	航空宇宙・防衛
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	180.99	180.99	387 42,775	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	83.3	105.19	1,046 115,544	情報技術サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	227.46	296.53	502 55,509	銀行
DELTA AIR LINES INC	94.73	138.98	701 77,481	旅客航空輸送業
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	63.54	63.54	286 31,690	石油・ガス・消耗燃料
DISCOVER FINANCIAL	271.77	290.57	2,024 223,639	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	243.11	296.1	2,394 264,422	電子装置・機器・部品
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	105.52	178.07	2,125 234,753	石油・ガス・消耗燃料
WABCO HOLDING INC	31.76	40.76	474 52,433	機械
LULULEMON ATHLETICA INC	66.83	90.8	1,406 155,282	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	54.91	66.48	1,116 123,331	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	28.61	37.5	1,349 149,027	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	43.32	50.2	1,531 169,094	専門小売り
INVESCO LTD	298.24	421.25	769 84,997	資本市場
MSCI INC	64.62	75.37	1,312 144,943	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,089.48	1,360.77	11,137 1,230,069	タバコ
VISA INC	1,300.02	1,551.28	22,208 2,452,665	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	125.72	-	-	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	119.92	159.33	1,549 171,125	水道
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	65.85	-	-	メディア
DISCOVERY INC-C	160.85	294.84	801 88,536	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	366.73	599.29	3,837 423,852	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	116.24	116.24	546 60,387	建設関連製品

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	18.26	—	—	—	—	家庭用品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,339.61	1,769.14	3,340	368,884	368,884	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	128.73	151.11	1,095	120,958	120,958	機械
ALKERMES PLC	120.53	120.53	391	43,261	43,261	バイオテクノロジー
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	230.62	289.87	2,502	276,338	276,338	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.79	34.79	746	82,407	82,407	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	106.74	122.4	1,646	181,855	181,855	ソフトウェア
HCA HEALTHCARE INC	201.73	241.78	3,438	379,758	379,758	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	100.53	134.05	1,660	183,338	183,338	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	39.87	54.74	686	75,762	75,762	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	65.44	74.43	1,641	181,252	181,252	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	106.68	136.76	1,361	150,342	150,342	銀行
CIT GROUP INC	92.87	92.87	465	51,395	51,395	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	226.52	306	2,807	310,065	310,065	半導体・半導体製造装置
TARGA RESOURCES CORP	164.45	178.11	803	88,713	88,713	石油・ガス・消耗燃料
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	4.056	—	—	—	—	運送インフラ
LEAR CORP	51.32	61.72	960	106,076	106,076	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	70.4	100.84	934	103,171	103,171	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	106.33	170	957	105,777	105,777	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	193.55	222.91	2,641	291,774	291,774	複合小売り
FORTINET INC	113.99	113.99	948	104,728	104,728	ソフトウェア
AON PLC	184.87	209.42	3,552	392,302	392,302	保険
TESLA INC	93.57	109.91	3,338	368,730	368,730	自動車
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	113.92	—	—	—	—	電気設備
GENERAL MOTORS CO	911.38	1,100.5	4,279	472,666	472,666	自動車
WORLDPAY INC	104.48	265.92	2,319	256,120	256,120	情報技術サービス
XPO LOGISTICS INC	—	128.25	763	84,346	84,346	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC	92.63	92.63	535	59,088	59,088	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALLY FINANCIAL INC	314.09	398.19	1,058	116,932	116,932	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD	99.58	121.38	544	60,175	60,175	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC	135.25	135.25	656	72,549	72,549	各種金融サービス
APTIV PLC	190.69	225.71	1,797	198,546	198,546	自動車部品
PHILLIPS 66	309.76	381.15	3,645	402,631	402,631	石油・ガス・消耗燃料
FACEBOOK INC	1,675.84	2,102.8	34,475	3,807,463	3,807,463	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	100.51	134.26	1,894	209,262	209,262	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	70.54	131.09	1,361	150,320	150,320	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	122.06	150.71	3,527	389,529	389,529	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	62.15	79.35	1,786	197,317	197,317	ソフトウェア
TESARO INC	26.46	—	—	—	—	バイオテクノロジー
WORKDAY INC	91.87	123.76	2,333	257,697	257,697	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,122.99	1,319.76	10,626	1,173,613	1,173,613	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	344.25	422.09	3,936	434,737	434,737	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	122.24	198.21	1,034	114,245	114,245	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	314.4	385.41	427	47,161	47,161	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	302.63	378	41,778	41,778	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC	128.91	128.91	560	61,887	61,887	商社・流通業
CDW CORP	108.24	130.4	1,223	135,156	135,156	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	638.82	638.82	394	43,600	43,600	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	101.99	101.99	368	40,673	40,673	旅客航空輸送業
ARCONIC INC	275.13	367.61	642	71,007	71,007	航空宇宙・防衛
ENVISION HEALTHCARE CORP	86.92	—	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	131.75	178.52	555	61,335	61,335	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	50.06	50.06	201	22,308	22,308	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	133.68	179.31	723	79,924	79,924	メディア
XL GROUP LTD	171.66	—	—	—	—	保険
BROADCOM LTD	287.37	—	—	—	—	半導体・半導体製造装置
DELL TECHNOLOGIES INC	150.74	—	—	—	—	ソフトウェア

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
PRUDENTIAL PLC	1,829.73	2,219.79	3,367	475,816	保険
RIO TINTO PLC	859.76	996.24	4,331	611,991	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	19,065.94	23,320.41	3,255	460,006	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	472.31	582.78	3,495	493,916	家庭用品
RELX PLC	723.05	1,736.66	3,025	427,469	専門サービス
OLD MUTUAL PLC	3,392.96	—	—	—	保険
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,169.66	1,389.93	1,318	186,341	航空宇宙・防衛
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,461.07	4,494.43	1,085	153,431	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	408.84	611.91	576	81,465	資本市場
TRAVIS PERKINS PLC	203.57	—	—	—	商社・流通業
SSE PLC	730.43	844.79	1,011	142,944	電力
BP PLC	13,848.28	17,559.46	9,497	1,342,054	石油・ガス・消耗燃料
SHIRE PLC	654.57	—	—	—	バイオテクノロジー
SAGE GROUP PLC(THE)	852.71	852.71	565	79,859	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	317.2	317.2	469	66,334	コンゴロマリット
STANDARD CHARTERED PLC	2,375.33	2,583.66	1,627	229,958	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	50,551.36	61,338.35	3,520	497,492	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	2,530.22	2,530.22	415	58,669	家庭用耐久財
TESCO PLC	5,629.88	8,771.57	1,911	270,070	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	667.84	886.62	829	117,161	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	661.55	749.03	1,093	154,576	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,455.37	4,360.21	6,828	964,808	医薬品
WEIR GROUP	183.36	183.36	280	39,666	機械
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	218.88	262.66	1,216	171,874	資本市場
BABCOCK INT'L GROUP	213.02	213.02	117	16,645	商業サービス・用品
WPP PLC	906.28	1,074.94	902	127,465	メディア
FERGUSON PLC	182.38	210.79	1,140	161,134	商社・流通業
ASTRAZENECA PLC	887.62	1,112.61	6,841	966,695	医薬品
WHITBREAD PLC	121.59	156.39	769	108,677	ホテル・レストラン・レジャー
CARNIVAL PLC	131.53	164.92	715	101,112	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,202.9	1,202.9	347	49,036	複合小売り
JOHN WOOD GROUP PLC	489.88	489.88	250	35,440	エネルギー設備・サービス
INTERTEK GROUP PLC	112.73	143.35	751	106,138	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	298.93	387.27	757	107,034	繊維・アパレル・贅沢品
INVESTEC PLC	506.55	506.55	245	34,749	資本市場
INTERCONTINENTAL HOTELS	123.62	151.25	700	98,918	ホテル・レストラン・レジャー
ITV PLC	2,472.1	3,709.08	499	70,595	メディア
SAINSBURY (J) PLC	1,094.1	1,372.15	389	55,024	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	69.98	—	—	—	金属・鉱業
G4S PLC	1,222.5	1,222.5	250	35,325	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	158.93	341	48,214	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	107.26	107.26	406	57,455	家庭用耐久財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,194.45	4,047.66	9,823	1,388,084	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,619.72	3,247.53	7,988	1,128,834	石油・ガス・消耗燃料
TUI AG-DI	301.53	450.43	364	51,502	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,841.83	2,147.15	533	75,392	各種金融サービス
EXPERIAN PLC	622.14	803.95	1,641	231,967	専門サービス
MONDI PLC	240.61	283.18	537	75,925	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	212.9	212.9	353	49,892	資本市場
FRESNILLO PLC NPR	156.39	156.39	152	21,541	金属・鉱業
INFORMA PLC	—	1,024.75	728	102,892	メディア
GLENCORE PLC	8,654.23	9,828.06	2,919	412,584	金属・鉱業
GVC HOLDINGS PLC	—	496.18	318	44,975	ホテル・レストラン・レジャー
NMC HEALTH PLC	—	81.49	224	31,711	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,126.94	1,126.94	392	55,446	保険
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	306.16	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
COCA-COLA HBC AG	134.06	194.47	478	67,679	飲料

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

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

銘柄	期首(前期末)		当期			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
SIMON PROPERTY GROUP INC	21.825	26.5	4,869	537,803		0.2
PUBLIC STORAGE	11.151	13.721	2,856	315,419		0.1
VENTAS INC	25.041	30.244	1,957	216,241		0.1
VORNADO REALTY TRUST	12.211	15.346	1,047	115,704		0.0
WEYERHAEUSER CO	51.939	63.699	1,619	178,827		0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	8.141	11.885	1,176	129,919		0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	15.118	18.388	2,092	231,122		0.1
AGNC INVESTMENT CORP	25.741	44.741	791	87,409		0.0
VEREIT INC	72.429	93.429	772	85,332		0.0
AMERICAN TOWER CORP	30.693	38.497	6,767	747,390		0.2
WP CAREY INC	-	15.148	1,138	125,705		0.0
INVITATION HOMES INC	22.567	30.427	692	76,448		0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21.975	-	-	-		-
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	19.124	381	42,177		0.0
COLONY CAPITAL INC	39.311	-	-	-		-
小計	910.976	1,082.101	65,889	7,276.820		-
	40銘柄<1.7%>	39銘柄<2.1%>	-	-		2.1
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	2.582	9.288	317	26,346		0.0
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10.748	10.748	240	19,971		0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9.675	9.675	247	20,506		0.0
小計	23.005	29.711	805	66,824		-
	3銘柄<0.0%>	3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	295.783	757	59,326		0.0
GPT GROUP	144.955	144.955	843	66,099		0.0
LENDLEASE GROUP	37.363	60.871	811	63,574		0.0
STOCKLAND	126.459	194.018	715	56,092		0.0
WESTFIELD CORP	140.035	-	-	-		-
DEXUS	63.819	80.596	967	75,776		0.0
GOODMAN GROUP	121.619	147.572	1,846	144,643		0.0
VICINITY CENTRES	270.443	270.443	695	54,456		0.0
SCENTRE GROUP	383.688	476.956	1,888	147,983		0.0
小計	1,584.164	1,671.194	8,525	667,952		-
	9銘柄<0.2%>	8銘柄<0.2%>	-	-		0.2
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円		%
LINK REIT	163.5	185.5	16,073	226,155		0.1
小計	163.5	185.5	16,073	226,155		-
	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	-	-		0.1
(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	473	38,524		0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200.806	200.806	552	44,917		0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	-	206.3	383	31,211		0.0
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	192.1	359	29,219		0.0
小計	591.906	798.206	1,768	143,872		-
	3銘柄<0.0%>	4銘柄<0.0%>	-	-		0.0
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		%
BRITISH LAND CO PLC	71.871	71.871	419	59,307		0.0
HAMMERSON PLC	58.616	58.616	222	31,481		0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	37.974	59.062	522	73,857		0.0
SEGRO PLC	61.113	82.914	537	75,941		0.0
小計	229.574	272.463	1,702	240,587		-
	4銘柄<0.1%>	4銘柄<0.1%>	-	-		0.1
(オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円		%
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	-	12.061	1,729	215,670		0.1
小計	-	12.061	1,729	215,670		-
	1銘柄<-%>	1銘柄<0.1%>	-	-		0.1
(フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		%
GECINA SA	3.67	3.67	462	57,700		0.0

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

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

■投資信託財産の構成

2019年2月15日現在

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

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月15日)現在

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

(注1)	期首元本額	85,414,197,806円
	追加設定元本額	42,163,749,070円
	一部解約元本額	25,975,635,351円
(注2)	期末における元本の内訳	
	DIAM外国株式パッシブ・ファンド	2,617,753,619円
	MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,665,744円
	MITO ラップ型ファンド (中立型)	8,231,580円
	MITO ラップ型ファンド (積極型)	16,074,086円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	22,332,727円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	23,592,520円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	19,511,274円
	たわらノーロード 先進国株式	8,653,055,227円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	423,862円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,132,564,401円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	81,659,165円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	6,355,387円
	たわらノーロード バランス (標準型)	57,012,813円
	たわらノーロード バランス (積極型)	90,265,532円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	251,550円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	20,129,423円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	60,351,621円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	45,644,551円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	115,690,976円
	たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	26,534円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	143,098円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	869,061円
	たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	667,205円
	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,472,482円
	DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	40,530,877,161円
	DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	177,133,387円
	DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	908,186,447円
	DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,088,583,348円
	DIAM DC バランス30インデックスファンド	128,572,029円
	DIAM DC バランス50インデックスファンド	360,021,829円
	DIAM DC バランス70インデックスファンド	323,498,598円
	マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	30,117,672円
	マネックス資産設計ファンド (育成型)	800,847,222円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	211,264,940円
	DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	215,665,489円
	DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	144,342,457円
	DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	249,688,816円
	投資のソムリエ	1,214,413,350円
	クルーズコントロール	462,306,913円
	投資のソムリエ<DC年金>	113,522,125円
	DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	164,698,295円
	DIAM DC バランス・F (成長型)	95,711,034円
	クルーズコントロール<DC年金>	328,099円
	DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,148,634円

DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	8,330,426円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	40,452,146円
ダイナミック・ナビゲーション	388,924円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	677,295,161円
ワールドアセットバランス (基本コース)	610,427,443円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,868,456,055円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	724,126円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	562,792円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	267,666円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	436,307円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,484,883円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	97,310,489円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	13,989円
DIAM外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	90,212,011円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	2,386,078,283円
DIAM先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	12,399,994,368円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	206,166,728円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	21,819,707円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	84,992,541円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	203,822,815円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,034,426円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	69,806,746円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,136,844円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	6,677,114円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	19,449,829円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	60,207,131円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	499,415,290円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	622,804,311円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,971,721,205円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	715,995,121円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	114,907,490円
DIAM アサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	817,522,480円
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	85,003,032円
DIAMグローバル私募ファンド (適格機関投資家向け)	2,754,975円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	25,760,341円
DIAM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	14,513,929円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	4,330,444,265円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	117,506,788円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,323,905,558円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	5,050,880,568円
DIAMバランス30VA (適格機関投資家限定)	17,998,120円
DIAMバランス50VA (適格機関投資家限定)	860,549円
DIAMバランス70VA (適格機関投資家限定)	9,815,345円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	6,744,194,888円
DIAMバランス20VA (適格機関投資家限定)	58,588,772円
DIAMバランス40VA (適格機関投資家限定)	234,611円
DIAMバランス60VA (適格機関投資家限定)	262,654円
期末元本合計	101,602,311,525円

■損益の状況

当期 自2018年2月16日 至2019年2月15日

項	目	当	期
(A)	配当 受取 受取 その 支取 の 他 の 払 金	等配 利 益 金	6,947,143,194円
(B)	有価 証券 の 買 取 引 損 益	買 取 引 損 益	5,056,491,180
(C)	先物 取引 の 取 引 損 益	取 引 損 益	32,377,087,657 △27,320,596,477
(D)	その 他 の 費 用	引 取 引 損 益	217,753,623 1,940,038,819 △1,722,285,196 △54,363,769
(E)	当期 損 益	金(A+B+C+D)	12,167,024,228
(F)	前期 繰 越 損 益	金	199,033,935,190
(G)	解約 差 損 益	金	△63,448,458,649
(H)	追加 信 託 差 損 益	金	100,335,008,930
(I)	合計	金(I)	248,087,509,699
	当期 繰 越 損 益	金(I)	248,087,509,699

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

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

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

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

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10期 (決算日 2018年4月18日)

(計算期間 2017年4月19日～2018年4月18日)

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第10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、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) 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		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) (ベンチマーク)		債券組入率	債券先物率	純資産総額
	円	%	ポイント	%			
6期 (2014年4月18日)	14,588	0.3	70,225.03	1.8	96.1	—	百万円 38,833
7期 (2015年4月20日)	18,383	26.0	84,996.05	21.0	96.5	—	51,976
8期 (2016年4月18日)	17,120	△6.9	81,716.02	△3.9	96.5	—	51,487
9期 (2017年4月18日)	17,917	4.7	88,609.40	8.4	96.8	—	80,269
10期 (2018年4月18日)	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4	—	111,615

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 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)。

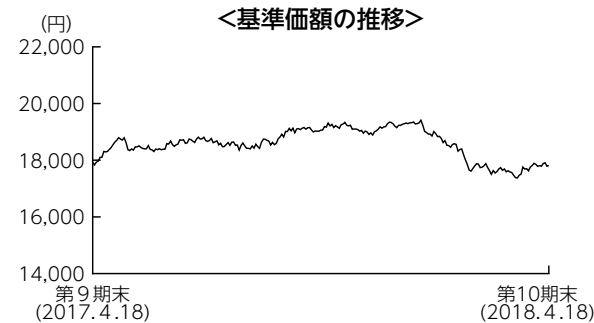
■当期中の基準価額と市況の推移

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	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017 年 4 月 18 日	円 17,917	% -	ポイント 88,609.40	% -	% 96.8	% -
4 月 末	18,310	2.2	90,839.08	2.5	96.2	-
5 月 末	18,400	2.7	91,461.20	3.2	95.5	-
6 月 末	18,594	3.8	91,987.11	3.8	95.5	-
7 月 末	18,475	3.1	90,853.52	2.5	95.2	-
8 月 末	18,742	4.6	92,518.04	4.4	96.4	-
9 月 末	19,077	6.5	94,279.65	6.4	96.0	-
10 月 末	19,127	6.8	94,889.37	7.1	94.9	-
11 月 末	19,035	6.2	93,154.63	5.1	96.5	-
12 月 末	19,277	7.6	94,436.09	6.6	94.7	-
2018 年 1 月 末	18,458	3.0	90,231.09	1.8	96.3	-
2 月 末	17,878	△0.2	87,510.37	△1.2	109.2	-
3 月 末	17,687	△1.3	87,022.13	△1.8	96.6	-
(期 末) 2018 年 4 月 18 日	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4	-

(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（2017年4月19日から2018年4月18日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は17,815円となり、前期末比で0.6%下落しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場での円高米ドル安が進行した結果、基準価額は下落しました。

投資環境

当期の新興国債券の利回りは上昇しました。

ベースとなる米国の長期金利は、北朝鮮情勢の緊迫化等を背景に低下する局面もありましたが、その後は利上げ観測やF R B（米連邦準備理事会）で政策金利の引き上げが正式決定したこと等を背景に上昇しました。

新興国債券の対米国債スプレッド（利回り格差）は、堅調な株式市場や原油価格の上昇等を背景に縮小しましたが、期末にかけて米国金利の上昇による新興国からの資金流出懸念や米中間での貿易摩擦の懸念等を背景として拡大に転じました。

為替市場では、期初から2018年1月にかけては、北朝鮮情勢の緊迫化や米国の政治不透明感が円高要因

となる一方、米国の追加利上げ観測がドル高要因となり、1ドル＝110円を挟んで揉み合いの動きとなりましたが、2月以降は世界的な株式市場の下落や米中貿易戦争への懸念からリスク回避の円買いが進みました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである J P モルガン・エマーGING・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%	9.1%	△9.1%
	ブラジル	10.2%	8.4%	1.9%
	メキシコ	12.6%	10.8%	1.9%
	パナマ	4.7%	2.7%	2.0%
	ペルー	4.3%	2.5%	1.9%
	ベネズエラ	0.0%	4.9%	△4.9%
	コロンビア	8.5%	6.6%	1.9%
計	40.4%	45.0%	△4.6%	
欧州	ハンガリー	4.8%	4.4%	0.4%
	ロシア	12.4%	10.5%	1.9%
	トルコ	14.3%	12.7%	1.6%
	ウクライナ	0.0%	3.7%	△3.7%
	クロアチア	2.8%	2.5%	0.3%
	ルーマニア	2.1%	1.9%	0.2%
計	36.4%	35.8%	0.7%	
アジア・オセアニア	インドネシア	9.6%	9.3%	0.3%
	フィリピン	7.2%	6.9%	0.2%
計	16.7%	16.2%	0.5%	
アフリカ	南アフリカ	3.2%	3.0%	0.2%
	計	3.2%	3.0%	0.2%
現金など	3.2%	-	-	
合計	100%	100%	-	

期末

国	ファンド	ベンチマーク	差	
中南米	アルゼンチン	0.0%	11.5%	△11.5%
	ブラジル	9.8%	8.0%	1.8%
	メキシコ	12.8%	11.0%	1.9%
	パナマ	4.8%	3.1%	1.8%
	ペルー	4.2%	2.5%	1.8%
	ベネズエラ	0.0%	2.7%	△2.7%
	コロンビア	8.7%	6.8%	1.8%
計	40.4%	45.5%	△5.1%	
欧州	ハンガリー	4.6%	4.0%	0.6%
	ロシア	10.9%	9.1%	1.8%
	トルコ	13.9%	12.2%	1.7%
	ウクライナ	0.0%	4.5%	△4.5%
	クロアチア	3.0%	2.5%	0.5%
	ルーマニア	2.0%	1.9%	0.1%
計	34.5%	34.2%	0.3%	
アジア・オセアニア	インドネシア	10.1%	9.4%	0.7%
	フィリピン	7.1%	6.9%	0.3%
計	17.2%	16.2%	1.0%	
アフリカ	南アフリカ	4.3%	4.0%	0.3%
	計	4.3%	4.0%	0.3%
現金など	3.6%	-	-	
合計	100%	100%	-	



※1 ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

※2 ベンチマークは、J P モルガン・エマーGING・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1.0%下落しました。当ファンドはベンチマークを0.5%上回りました。これは、運用の基本方針で規定さ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理由です。

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	0.009%
（保管費用）	(2)	(0.009)
（その他）	(0)	(0.000)
合 計	2	0.009

(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（18,582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7ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。また、その他費用（その他）には、余資運用に対してかかる費用を含みます。

■ 売買及び取引の状況（2017年4月19日から2018年4月18日まで）

公社債

			買 付 額	売 付 額
外国			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
	アメリ カ	国債証 券	734,858	405,245 (3,198)

(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（2017年4月19日から2018年4月18日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちＢＢ格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年末満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 949,163	千アメリカ・ドル 1,003,633	千円	%	%	%	%	%
合 計	—	—	107,589,494	96.4	26.7	72.6	18.1	5.7

(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) 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			
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	6.0500	11,900	13,557	1,453,318	2040/01/11		
BRAZIL 5.625 01/07/41	国債証券	5.6250	8,900	8,664	928,796	2041/01/07		
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国債証券	4.6000	10,600	10,170	1,090,299	2046/01/23		
BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	4.2500	16,100	16,063	1,722,036	2025/01/07		
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	5,000	6,118	655,930	2026/01/29		
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債証券	7.7500	5,900	8,012	858,977	2031/01/14		
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	3,000	3,613	387,392	2044/01/22		
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	国債証券	5.5500	11,400	12,560	1,346,524	2045/01/21		
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	国債証券	4.6650	4,700	4,734	507,512	2024/01/17		
TURKEY 11.875 01/15/30	国債証券	11.8750	5,100	7,557	810,129	2030/01/15		
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	国債証券	6.3750	3,000	3,725	399,330	2032/01/15		
COLOMBIA 6.125 01/18/41	国債証券	6.1250	10,000	11,525	1,235,480	2041/01/18		
INDONESIA 5.25 01/17/42	国債証券	5.2500	6,900	7,314	784,082	2042/01/17		
INDONESIA 6.75 01/15/44	国債証券	6.7500	7,700	9,773	1,047,673	2044/01/15		
BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	5.0000	13,200	11,688	1,253,032	2045/01/27		
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	国債証券	4.3500	7,000	6,498	696,641	2047/01/15		
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	国債証券	4.0000	5,200	5,320	570,355	2021/01/15		
TURKEY 6.0 01/14/41	国債証券	6.0000	11,700	10,852	1,163,420	2041/01/14		
INDONESIA 5.125 01/15/45	国債証券	5.1250	6,800	7,082	759,204	2045/01/15		
INDONESIA 5.25 01/08/47	国債証券	5.2500	4,200	4,455	477,583	2047/01/08		
BRAZIL 8.25 01/20/34	国債証券	8.2500	6,000	7,563	810,817	2034/01/20		
PANAMA 6.7 01/26/36	国債証券	6.7000	10,200	12,831	1,375,547	2036/01/26		
BRAZIL 7.125 01/20/37	国債証券	7.1250	8,100	9,436	1,011,592	2037/01/20		
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	6,300	8,577	919,489	2038/01/17		
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国債証券	3.9500	6,200	6,114	655,448	2040/01/20		
INDONESIA 5.95 01/08/46	国債証券	5.9500	4,000	4,651	498,591	2046/01/08		
BRAZIL 4.875 01/22/21	国債証券	4.8750	11,000	11,456	1,228,136	2021/01/22		
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	3.6000	9,200	9,085	973,912	2025/01/30		
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	国債証券	5.0000	4,000	4,470	479,184	2037/01/13		
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	10,200	10,310	1,105,249	2025/01/15		
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	4,200	4,264	457,169	2027/01/08		
ROMANIA 4.875 01/22/24	国債証券	4.8750	2,400	2,530	271,312	2024/01/22		
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	5,400	5,588	599,065	2026/01/28		
CROATIA 6.0 01/26/24	国債証券	6.0000	4,800	5,306	568,882	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	千	千	千	千	千	千		
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	国	債	証	券	4.1250	10,000	10,157	1,088,884				2026/01/21	
INDONESIA 5.875 01/15/24	国	債	証	券	5.8750	8,800	9,695	1,039,318				2024/01/15	
INDONESIA 4.75 01/08/26	国	債	証	券	4.7500	7,000	7,330	785,878				2026/01/08	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	国	債	証	券	6.5000	2,800	2,974	318,889				2020/01/20	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国	債	証	券	4.2000	5,000	5,211	558,624				2024/01/21	
PANAMA 5.2 01/30/20	国	債	証	券	5.2000	6,800	7,109	762,127				2020/01/30	
HUNGARY 6.25 01/29/20	国	債	証	券	6.2500	8,500	8,979	962,655				2020/01/29	
BRAZIL 2.625 01/05/23	国	債	証	券	2.6250	9,200	8,740	936,928				2023/01/05	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	国	債	証	券	3.5000	6,200	6,289	674,277				2021/01/21	
BRAZIL 8.75 02/04/25	国	債	証	券	8.7500	3,000	3,791	406,438				2025/02/04	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国	債	証	券	3.7000	5,000	4,729	506,980				2042/02/02	
TURKEY 7.375 02/05/25	国	債	証	券	7.3750	11,300	12,446	1,334,313				2025/02/05	
TURKEY 6.625 02/17/45	国	債	証	券	6.6250	10,700	10,490	1,124,535				2045/02/17	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国	債	証	券	9.5000	6,600	9,887	1,059,971				2030/02/02	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国	債	証	券	5.6250	10,200	11,204	1,201,143				2044/02/26	
ROMANIA 6.75 02/07/22	国	債	証	券	6.7500	8,300	9,220	988,461				2022/02/07	
BRAZIL 5.625 02/21/47	国	債	証	券	5.6250	11,400	10,981	1,177,168				2047/02/21	
COLOMBIA 4.0 02/26/24	国	債	証	券	4.0000	8,100	8,191	878,088				2024/02/26	
HUNGARY 5.375 02/21/23	国	債	証	券	5.3750	8,100	8,752	938,315				2023/02/21	
PANAMA 3.875 03/17/28	国	債	証	券	3.8750	6,200	6,215	666,301				2028/03/17	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国	債	証	券	7.5000	15,263	17,110	1,834,216				2030/03/31	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国	債	証	券	4.7500	16,000	15,648	1,677,465				2044/03/08	
TURKEY 5.625 03/30/21	国	債	証	券	5.6250	6,700	6,926	742,530				2021/03/30	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	国	債	証	券	5.5000	3,800	4,294	460,386				2026/03/30	
PERU 6.55 03/14/37	国	債	証	券	6.5500	6,200	7,943	851,536				2037/03/14	
HUNGARY 7.625 03/29/41	国	債	証	券	7.6250	3,800	5,509	590,643				2041/03/29	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	国	債	証	券	3.7000	7,400	7,025	753,100				2041/03/01	
TURKEY 5.125 03/25/22	国	債	証	券	5.1250	5,300	5,370	575,682				2022/03/25	
TURKEY 5.75 03/22/24	国	債	証	券	5.7500	9,300	9,500	1,018,444				2024/03/22	
HUNGARY 5.375 03/25/24	国	債	証	券	5.3750	5,800	6,322	677,811				2024/03/25	
PANAMA 3.75 03/16/25	国	債	証	券	3.7500	6,000	6,030	646,416				2025/03/16	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	国	債	証	券	3.6250	8,900	9,016	966,597				2022/03/15	
HUNGARY 6.375 03/29/21	国	債	証	券	6.3750	8,600	9,345	1,001,878				2021/03/29	
CROATIA 6.375 03/24/21	国	債	証	券	6.3750	4,500	4,862	521,257				2021/03/24	
COLOMBIA 2.625 03/15/23	国	債	証	券	2.6250	4,300	4,110	440,617				2023/03/15	
TURKEY 3.25 03/23/23	国	債	証	券	3.2500	5,100	4,712	505,180				2023/03/23	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	国	債	証	券	5.5000	6,000	6,236	668,522				2020/03/09	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国	債	証	券	4.1500	10,600	10,711	1,148,251				2027/03/28	
TURKEY 6.0 03/25/27	国	債	証	券	6.0000	10,400	10,426	1,117,711				2027/03/25	
PANAMA 9.375 04/01/29	国	債	証	券	9.3750	4,900	7,105	761,656				2029/04/01	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国	債	証	券	5.6250	11,200	11,702	1,254,476				2042/04/04	
TURKEY 4.25 04/14/26	国	債	証	券	4.2500	6,000	5,435	582,719				2026/04/14	
TURKEY 4.875 04/16/43	国	債	証	券	4.8750	10,100	8,098	868,124				2043/04/16	
INDONESIA 4.625 04/15/43	国	債	証	券	4.6250	4,000	3,936	422,024				2043/04/15	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	国	債	証	券	4.5000	9,000	9,108	976,474				2022/04/04	
INDONESIA 3.75 04/25/22	国	債	証	券	3.7500	9,000	9,043	969,488				2022/04/25	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国	債	証	券	5.0000	15,200	15,530	1,664,896				2020/04/29	
COLOMBIA 3.875 04/25/27	国	債	証	券	3.8750	9,400	9,241	990,700				2027/04/25	
CROATIA 5.5 04/04/23	国	債	証	券	5.5000	5,800	6,231	668,012				2023/04/04	
INDONESIA 3.375 04/15/23	国	債	証	券	3.3750	4,500	4,416	473,427				2023/04/15	
BRAZIL 6.0 04/07/26	国	債	証	券	6.0000	8,200	9,007	965,625				2026/04/07	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国	債	証	券	4.8750	4,600	4,604	493,627				2026/04/14	
COLOMBIA 8.125 05/21/24	国	債	証	券	8.1250	4,300	5,278	565,851				2024/05/21	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	国	債	証	券	5.8750	4,200	4,523	484,872				2022/05/30	
TURKEY 6.75 05/30/40	国	債	証	券	6.7500	6,700	6,784	727,253				2040/05/30	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	国	債	証	券	6.8750	6,300	6,561	703,353				2019/05/27	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		末	
				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		
TURKEY 5.75 05/11/47	国債証券	5.7500	10,400	9,159	981,874	2047/05/11	
PANAMA 4.5 05/15/47	国債証券	4.5000	5,000	5,054	541,837	2047/05/15	
INDONESIA 4.875 05/05/21	国債証券	4.8750	9,700	10,130	1,085,988	2021/05/05	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	4.7500	11,800	11,877	1,273,232	2026/05/27	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	14,800	15,059	1,614,324	2045/06/15	
TURKEY 7.0 06/05/20	国債証券	7.0000	8,700	9,195	985,753	2020/06/05	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	5.2500	24,800	23,839	2,555,593	2047/06/23	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	国債証券	8.3750	4,300	4,578	490,830	2019/06/17	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	国債証券	4.2500	8,800	8,475	908,616	2027/06/23	
PERU 7.35 07/21/25	国債証券	7.3500	11,000	13,675	1,465,981	2025/07/21	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	国債証券	5.3750	3,200	3,073	329,445	2044/07/24	
COLOMBIA 4.375 07/12/21	国債証券	4.3750	10,800	11,169	1,197,413	2021/07/12	
CROATIA 6.625 07/14/20	国債証券	6.6250	5,800	6,234	668,336	2020/07/14	
INDONESIA 3.85 07/18/27	国債証券	3.8500	4,000	3,915	419,765	2027/07/18	
PERU 4.125 08/25/27	国債証券	4.1250	6,600	6,920	741,834	2027/08/25	
ROMANIA 4.375 08/22/23	国債証券	4.3750	5,600	5,759	617,453	2023/08/22	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	6,200	6,627	710,500	2025/09/16	
COLOMBIA 7.375 09/18/37	国債証券	7.3750	6,800	8,772	940,358	2037/09/18	
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債証券	6.7500	6,000	7,399	793,194	2034/09/27	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	国債証券	5.8750	5,200	5,606	601,031	2043/09/16	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	国債証券	4.8750	10,200	10,504	1,126,122	2023/09/16	
TURKEY 6.25 09/26/22	国債証券	6.2500	8,500	8,966	961,261	2022/09/26	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	9,200	9,485	1,016,813	2110/10/12	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	6,200	7,893	846,199	2034/10/23	
BRAZIL 8.875 10/14/19	国債証券	8.8750	4,600	5,020	538,240	2019/10/14	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	6,200	5,828	624,808	2028/10/12	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	国債証券	5.0000	2,800	2,553	273,697	2046/10/12	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	4.0000	12,700	13,022	1,395,979	2023/10/02	
TURKEY 4.875 10/09/26	国債証券	4.8750	10,600	9,930	1,064,561	2026/10/09	
PERU 5.625 11/18/50	国債証券	5.6250	13,000	15,699	1,682,981	2050/11/18	
TURKEY 7.5 11/07/19	国債証券	7.5000	8,400	8,877	951,627	2019/11/07	
CROATIA 6.75 11/05/19	国債証券	6.7500	8,200	8,669	929,408	2019/11/05	
HUNGARY 5.75 11/22/23	国債証券	5.7500	8,200	9,068	972,165	2023/11/22	
合 計	-	-	949,163	1,003,633	107,589,494	-	

■投資信託財産の構成

2018年4月18日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
公 社 債	千円	%	
	107,589,494	96.4	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,040,840	3.6	
投 資 信 託 財 産 総 額	111,630,334	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、111,339,008千円、99.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.20円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年4月18日)現在

項	目	当	期	末
(A)	資 産	111,876,591,958	円	
	コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,857,407,644		
	社 債(評価額)	107,589,494,462		
	未 収 入 金	246,537,000		
	未 収 入 息	936,081,610		
	前 払 費 用	247,071,242		
(B)	負 債	261,518,320		
	未 払 金	246,257,320		
	未 払 解 約 金	15,261,000		
(C)	純 資 産 総 額(A-B)	111,615,073,638		
	元 本	62,651,486,172		
	次 期 繰 越 損 益 金	48,963,587,466		
(D)	受 益 権 総 額	62,651,486,172	円	
	1万円当たり基準価額(C/D)	17.815	円	

(注1) 期首元本額 44,801,349,582円
追加設定元本額 44,252,595,865円
一部解約元本額 26,402,459,275円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>	265,352,419円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	31,696,669円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,276,054円
たわらノーロード バランス(標準型)	3,409,421円
たわらノーロード バランス(積極型)	2,706,951円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	74,492円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	114,911円
たわらノーロード 最適化バランス(安成型)	468,720円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	224,993円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	343,828円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	59,295,344円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10)	30,468,731円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20)	104,407,098円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30)	231,884,436円
投資のソムリエ	8,030,523,614円
グループコントロール	878,591,978円
投資のソムリエ<DC年金>	573,807,004円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	122,747,118円
グループコントロール<DC年金>	341,245円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	4,182,056円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	13,011,019円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	376,827,557円
ダイナミック・ナビゲーション	177,753円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,413,104,090円
ワールドアセットバランス(基本コース)	859,189,179円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,176,151,984円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,313,456円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	959,305円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,837,939円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,591,303円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	16,514,072,473円
エマージング債券バップファンドVA(適格機関投資家専用)	3,261,708,145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)	7,576,092,789円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	4,968,287,970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)	2,951,435,236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II(適格機関投資家限定)	2,324,514,542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)	3,868,294,350円
期末元本合計	62,651,486,172円

■損益の状況

当期 自2017年4月19日 至2018年4月18日

項	目	当	期
(A)	配 当 等 収 益	4,730,514,573	円
	受 取 利 息	4,730,919,751	
	支 払 利 息	△405,178	
(B)	価 証 券 売 買 損 益	△5,545,889,985	
	有 売 買 益	642,531,914	
	有 売 買 損	△6,188,421,899	
(C)	そ の 他 費 用	△9,271,699	
(D)	当 期 損 益 金(A+B+C)	△824,647,111	
(E)	前 期 繰 越 損 益 金	35,468,257,167	
(F)	解 約 差 損 益 金	△22,544,128,725	
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金	36,864,106,135	
(H)	次 期 繰 越 損 益 金(H)	48,963,587,466	

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

《お知らせ》

■当ファンドにおいて、つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。
(平成29年9月29日)

■当ファンドにおいて、信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。
(平成30年3月1日)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第10期 (決算日 2018年4月18日)

(計算期間 2017年4月19日～2018年4月18日)

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第10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				
6期(2014年4月18日)	9,335	8.4	ポイント 203,185.39	% 8.7	% 97.3	% 1.7	% 1.0	百万円 39,802
7期(2015年4月20日)	11,412	22.2	250,241.33	23.2	95.4	3.6	0.9	41,339
8期(2016年4月18日)	8,600	△24.6	189,749.05	△24.2	92.8	6.1	1.0	36,196
9期(2017年4月18日)	10,121	17.7	224,042.80	18.1	95.8	3.2	0.9	40,863
10期(2018年4月18日)	12,241	20.9	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7	66,443

(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3) MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、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)。

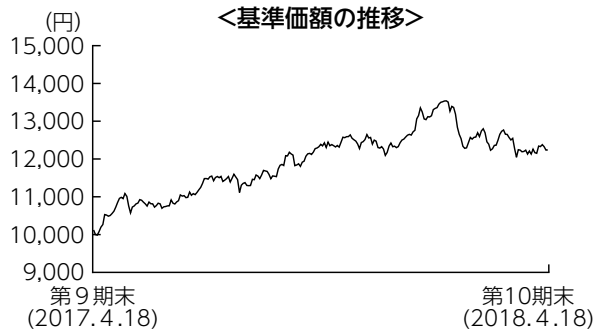
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2017年 4 月 18日	円	%	ポイント	%	%	%	%
	10,121	—	224,042.80	—	95.8	3.2	0.9
4 月 末	10,487	3.6	232,547.57	3.8	93.0	6.0	0.8
5 月 末	10,814	6.8	239,840.87	7.1	90.7	8.5	0.8
6 月 末	10,978	8.5	243,929.61	8.9	93.4	5.9	0.9
7 月 末	11,406	12.7	253,270.57	13.0	92.3	6.7	0.9
8 月 末	11,698	15.6	259,848.42	16.0	92.8	7.0	0.8
9 月 末	11,805	16.6	262,128.23	17.0	93.2	7.0	0.8
10 月 末	12,316	21.7	273,866.50	22.2	93.3	5.9	0.7
11 月 末	12,473	23.2	277,632.15	23.9	94.7	4.6	0.7
12 月 末	12,759	26.1	283,755.81	26.7	90.1	9.2	0.7
2018年 1 月 末	13,265	31.1	295,572.49	31.9	92.5	6.8	0.7
2 月 末	12,695	25.4	283,847.54	26.7	90.9	16.6	0.6
3 月 末	12,199	20.5	271,464.17	21.2	93.8	5.5	0.6
(期 末) 2018年 4 月 18日	12,241	20.9	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7

(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（2017年4月19日から2018年4月18日まで）

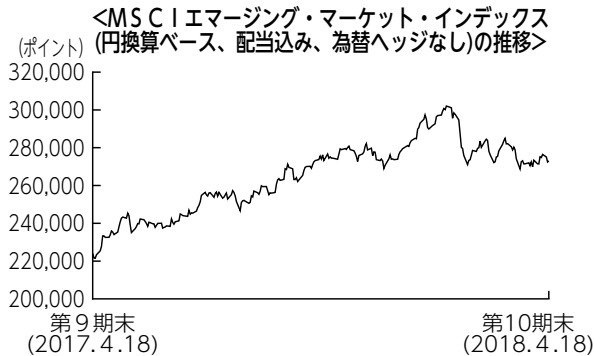


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,241円となり、前期末比で20.9%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場はまちまちの寄与となったものの、新興国株式指数を構成する多くの株式市場が前期末比で値上がりしたこと、基準価額は上昇しました。特に、指数に占める比率の大きい中国や韓国などの値上がりが大きくプラスに寄与しました。



投資環境

当期の新興国株式市場は前期末比で上昇しました。

中国インターネット関連銘柄の業績拡大や、米国の抑制的な利上げスタンスが継続されるとの見通しなどから上昇基調が続きました。しかし2018年2月に米国の長期国債利回りが急速に上昇したこと、新興国株式市場からの資金流出が懸念され下落し、その後も米中貿易摩擦の拡大が不安視されたことなどから上値の重い展開となりましたが、期末では前期末比で大幅なプラスとなりました。

為替市場では米政権幹部の米ドル安を容認する発言などから米ドル安が進み、前期末比で円高となりました。

新興国通貨では改革派の新大統領誕生が好感された南アフリカや、原油価格の回復により財政の改善期待が高まったマレーシアの通貨が買われ円安となったものの、米国の経済制裁を発動したロシアや、財政改革への期待が後退したブラジル、中央銀行の独立性が懸念されたトルコでは通貨が売られ円高となりました。

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	17.0%
2	ソフトウェア・サービス	10.4
3	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.3
4	素材	7.2
5	エネルギー	7.1
6	電気通信サービス	5.4
7	半導体・半導体製造装置	4.9
8	資本財	3.9
9	食品・飲料・タバコ	3.8
10	保険	3.3

期末

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



(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。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.9%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	6円 (5) (1) (0) (0)	0.054% (0.042) (0.011) (0.000) (0.000)
(b) 有価証券取引税 (株 式)	5 (5)	0.044 (0.044)
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	13 (12) (1)	0.109 (0.098) (0.011)
合 計	25	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(11,925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7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 (2017年4月19日から2018年4月18日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 9,793.61 (219.6)	千アメリカ・ドル 24,046 (-)	百株 3,554.77	千アメリカ・ドル 8,125
	香 港	百株 276,452.5 (1,936.36)	千香港・ドル 352,963 (△304)	百株 121,968.36	千香港・ドル 129,512
	台 湾	百株 126,899.77 (2,672.64)	千台湾・ドル 712,231 (△960)	百株 46,429.96	千台湾・ドル 244,870
	ト ル コ	百株 7,548.18 (93.85)	千トルコ・リラ 8,424 (-)	百株 2,817.12	千トルコ・リラ 2,934
	メ キ シ コ	百株 23,559.7 (-)	千メキシコ・ペソ 87,938 (△161)	百株 8,918.75	千メキシコ・ペソ 33,923
	フ ィ リ ピ ン	百株 29,141.03 (-)	千フィリピン・ペソ 126,556 (-)	百株 19,157.25	千フィリピン・ペソ 45,485
	チ リ	百株 288,050.36 (9,477.31)	千チリ・ペソ 1,600,362 (△94,107)	百株 151,278.23	千チリ・ペソ 615,637
	コ ロ ン ビ ア	百株 3,043.77 (-)	千コロンビア・ペソ 3,159,311 (-)	百株 611.18	千コロンビア・ペソ 1,194,203
	カ タ ー ル	百株 1,277.16 (20.7)	千カタール・リアル 4,255 (-)	百株 582.03	千カタール・リアル 1,435
	イ ン ド	百株 21,766.6 (7,392.22)	千インド・ルピー 1,197,253 (-)	百株 8,145.08	千インド・ルピー 421,305
パ キ ス タ ン	百株 2,522 (-)	千パキスタン・ルピー 59,274 (-)	百株 230	千パキスタン・ルピー 5,995	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	インドネシア	百株 96,545 (51,426)	千インドネシア・ルピア 58,415,025 (-)	百株 78,299	千インドネシア・ルピア 27,815,057
	アラブ首長国連邦	百株 8,213.41 (-)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 4,530 (-)	百株 2,343.98	千アラブ首長国連邦・ディルハム 1,385
	ブラジル	百株 19,419.42 (1,185.71)	千ブラジル・レアル 48,839 (△38)	百株 7,542.3	千ブラジル・レアル 18,520
	チエコ	百株 475.69 (-)	千チエコ・コルナ 7,945 (△22)	百株 202.35	千チエコ・コルナ 2,629
	韓国	百株 3,615.58 (177.17)	千韓国・ウォン 33,577,757 (△2,384)	百株 1,216.02	千韓国・ウォン 12,494,034
	マレーシア	百株 32,422 (5,735.33)	千マレーシア・リンギット 23,103 (-)	百株 13,609.51	千マレーシア・リンギット 7,987
	南アフリカ	百株 16,226.72 (925.76)	千南アフリカ・ランド 181,184 (△135)	百株 6,938.55	千南アフリカ・ランド 63,622
	タイ	百株 30,903 (-)	千タイ・バーツ 151,728 (-)	百株 14,569.33	千タイ・バーツ 52,224
	ポーランド	百株 2,264.87 (-)	千ポーランド・ズロチ 10,296 (-)	百株 1,975.68	千ポーランド・ズロチ 3,984
	ハンガリー	百株 209.51 (308)	千ハンガリー・フォリント 162,780 (-)	百株 133.91	千ハンガリー・フォリント 74,490
	ユー ロ 圏	百株 11,361.77 (△4,750)	千ユーロ 1,035 (△3)	百株 2,000.84	千ユーロ 139

(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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
トルコ EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	千□ 68.337 (-)	千トルコ・リラ 173 (-)	千□ - (-)	千トルコ・リラ - (-)
メキシコ FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV CEMEX SAB DE CV FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千□ 74.5 (-) 560.7 (45.964) 178.6 (-)	千メキシコ・ペソ 12,962 (-) 8,069 (-) 5,265 (△44)	千□ 27.6 (-) 208.9 (-) 44.8 (-)	千メキシコ・ペソ 4,759 (-) 3,029 (-) 1,302 (-)
南アフリカ HYPROP INVESTMENTS LTD RESILIENT REIT LTD	千□ 15.888 (-) 8.088 (-)	千南アフリカ・ランド 1,764 (-) 992 (-)	千□ 6.276 (-) - (-)	千南アフリカ・ランド 660 (-) - (-)

(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 51,639	百万円 48,621	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	30,948,697千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	50,605,692千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.61

(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 (2017年4月19日から2018年4月18日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	株数	当 期		業 種 等		
		株 数	株 数		評 価 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CTRIPOINTERNATIONAL LTD ADR	306	416	1,781	190,956	インターネット販売・通信販売	
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	217.73	235	385	41,314	金属・鉱業	
SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	654	755	362	38,849	石油・ガス・消耗燃料	
CREDICORP LTD	51.49	70.49	1,610	172,696	銀行	
SINA CORP	46	61	587	62,946	インターネットソフトウェア・サービス	
MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	419.25	607.25	595	63,860	無線通信サービス	
NETEASE INC-ADR	65	83	2,308	247,513	インターネットソフトウェア・サービス	
SOUTHERN COPPER CORP	87.8	87.8	496	53,272	金属・鉱業	
LUKOIL SPON ADR	365.09	462.85	2,940	315,170	石油・ガス・消耗燃料	
GAZPROM PAO ADR	4,572.19	5,826.6	2,650	284,135	石油・ガス・消耗燃料	
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	1,012.58	1,198.44	619	66,420	銀行	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	792.8	962.8	137	14,738	不動産管理・開発	
SURGUTNEFTEGAZ ADR	663.14	982.17	454	48,706	石油・ガス・消耗燃料	
SISTEMA PJSC GDR	158.37	-	-	-	無線通信サービス	
NOVATEK PJSC GDR	79.64	103.65	1,279	137,113	石油・ガス・消耗燃料	
BAIDU INC -SPON ADR	222	289	6,810	730,124	インターネットソフトウェア・サービス	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	-	139.7	333	35,792	金属・鉱業	
MMC NORILSK NICKEL ADR	493.94	726.38	1,202	128,910	金属・鉱業	
ROSTELECOM SPON ADR	225.58	-	-	-	各種電気通信サービス	
ROSNEFT OIL CO GDR	1,110.52	1,389.2	729	78,184	石油・ガス・消耗燃料	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	110	142	1,312	140,654	各種消費者サービス	
SEVERSTAL GDR	224.19	269.57	399	42,826	金属・鉱業	
TATNEFT ADR	208.22	284.7	1,816	194,716	石油・ガス・消耗燃料	
VTB BANK OJSC GDR	2,439.97	3,220	617	66,206	銀行	
DP WORLD LTD	136.96	183.2	403	43,225	運送インフラ	
MAGNIT PJSC GDR	260.52	388.47	741	79,540	食品・生活必需品小売り	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	331	434	694	74,439	インターネット販売・通信販売	
RUSHYDRO PJSC ADR	1,272.39	1,939.6	221	23,745	電力	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	36	339	1,227	131,590	各種消費者サービス	
SBERBANK ADR	2,295.14	2,890.2	4,098	439,338	銀行	
PHOSAGRO PJSC GDR	134.64	199.72	288	30,916	化学	
YY INC-ADR	24	43	409	43,943	インターネットソフトウェア・サービス	
58.COM INC ADR	68	97	803	86,181	インターネットソフトウェア・サービス	
AUTOHOME INC ADR	-	56	553	59,293	インターネットソフトウェア・サービス	
WEIBO CORP ADR	27	49	589	63,233	インターネットソフトウェア・サービス	
JD.COM INC ADR	554	692	2,786	298,732	インターネット販売・通信販売	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	920	1,208.8	21,601	2,315,654	インターネットソフトウェア・サービス	
MOMO INC SPON ADR	-	115	407	43,665	インターネットソフトウェア・サービス	
YUM CHINA HOLDINGS INC	309	405	1,649	176,833	ホテル・レストラン・レジャー	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,894.15 36銘柄	27,352.59 37銘柄	65,908 -	7,065,444 <10.6%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
JIANGXI COPPER CO LTD	1,000	1,380	1,484	20,283	金属・鉱業	
JIANGSU EXPRESS	1,020	1,240	1,339	18,293	運送インフラ	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	1,620	1,620	1,244	16,995	旅客航空輸送業	
CHINA MOBILE LIMITED	5,025	6,440	46,754	638,665	無線通信サービス	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	1,010	1,310	5,842	79,809	建設資材	
BEIJING ENTERPRISES	355	525	2,094	28,614	コングロマリット	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	3,580	4,240	2,090	28,553	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	2,760	3,720	1,499	20,478	ヘルスケア・テクノロジー	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	1,580	1,880	1,755	23,985	石油・ガス・消耗燃料	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	635	770	5,782	78,991	パーソナル用品	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	670.2	-	-	-	自動車	
CNOOC LTD	14,420	18,770	23,424	319,984	石油・ガス・消耗燃料	

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	2,440	3,220	4,585	62,634	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	3,540	4,980	10,034	137,074	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	3,131.2	4,051.2	10,614	144,989	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,268.88	2,928.88	8,244	112,623	不動産管理・開発
CITIC LTD	3,930	6,300	7,131	97,417	コンプロマリット
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	1,260	1,880	2,101	28,711	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	5,880	7,300	2,883	39,388	コンピュータ・周辺機器
PETRO CHINA CO LTD	17,100	22,000	12,144	165,887	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	4,887.42	6,487.42	6,552	89,504	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	1,317.9	1,741.9	4,154	56,749	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	20,712	26,652	19,615	267,952	石油・ガス・消耗燃料
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	770	1,020	2,295	31,349	情報技術サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	620	800	5,492	75,020	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	2,260	3,660	2,327	31,797	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,300	1,620	1,036	14,162	運送インフラ
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	1,040	1,320	2,275	31,085	運送インフラ
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	3,260	3,740	1,772	24,215	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT LTD	780	1,120	1,870	25,549	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,400	1,858	5,137	70,176	ガス
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	-	660	2,148	29,345	電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	4,350	5,220	11,692	159,723	自動車
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	760	860	2,390	32,658	ガス
BYD CO LTD	530	680	4,175	57,033	自動車
CHINA TELECOM CORP LTD	11,300	14,640	5,167	70,593	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	1,460	2,020	1,660	22,681	エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	9,500	11,700	1,099	15,023	メディア
SINOTRANS LTD	1,470	-	-	-	航空貨物・物流サービス
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	2,010	2,490	2,669	36,462	商業サービス・用品
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	-	1,700	1,460	19,947	紙製品・林産品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	3,731.92	4,851.92	6,491	88,678	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	1,640	2,250	1,149	15,705	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	1,652	1,952	2,736	37,383	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	2,600	2,900	2,192	29,948	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,210	7,790	16,826	229,848	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	5,830	5,850	2,158	29,487	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,600	1,600	784	10,709	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,057	3,172	3,010	41,119	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD	847.2	2,154.4	2,003	27,369	機械
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	2,970	3,530	1,761	24,061	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL	430	430	877	11,982	コンプロマリット
TINGYI HOLDING CORP	1,640	1,940	3,239	44,255	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	300	400	1,698	23,194	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	2,320	2,980	3,623	49,499	水道
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	1,213.33	1,733.33	6,101	83,344	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	1,160	1,460	1,124	15,356	運送インフラ
SINO BIOPHARMACEUTICAL	3,300	4,740	7,309	99,842	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,340	2,920	7,884	107,695	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	4,664	5,979	237,485	3,244,057	インターネットソフトウェア・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,315	5,470	44,334	605,607	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	3,180	5,660	2,422	33,091	水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	9,702.4	9,702.4	805	11,000	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,720	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	1,620	1,980	1,991	27,209	旅客航空輸送業
ZTE CORP	584.88	712.88	1,824	24,929	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	2,500	2,500	672	9,186	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	2,600	3,600	6,760	92,352	石油・ガス・消耗燃料
BANK OF COMMUNICATIONS	8,032.05	9,172.05	5,640	77,053	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	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	1,460	2,062.5	2,000	27,328	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	605	775	10,400	142,070	電子装置・機器・部品
CHINA CONSTRUCTION BANK	68,895.3	88,185.3	69,578	950,438	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	470	800	6,904	94,308	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,960	2,940	2,531	34,578	自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	-	1,600	2,640	36,062	不動産管理・開発
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	1,140	1,680	1,938	26,482	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	2,380	3,740	3,321	45,366	建設資材
BANK OF CHINA LTD	65,002	83,102	34,238	467,691	銀行
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,020	1,200	2,484	33,931	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	844	1,004	1,863	25,454	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	3,179.7	4,089.7	13,087	178,768	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	60,162.35	77,302.35	50,942	695,871	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	1,996	2,756	1,226	16,752	各種電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	3,670	4,830	3,960	54,101	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	1,620	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	540	640	1,404	19,189	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	400	607	2,285	31,217	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	880	1,250	3,450	47,127	家庭用耐久財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	4,181.42	5,691.42	8,833	120,659	不動産管理・開発
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	-	3,690	1,985	27,118	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	8,358	9,388	5,097	69,634	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,690	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	580	757	11,127	152,007	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	750	1,150	5,175	70,690	繊維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL	2,155.28	2,795.28	4,802	65,599	コンプロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	3,160	5,680	2,504	34,216	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	2,495	3,085	1,761	24,062	不動産管理・開発
SOHO CHINA LTD	1,780	1,780	724	9,896	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	850	810	2,008	27,440	ソフトウェア
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	10,960	13,620	1,321	18,046	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD	3,010	4,470	2,556	34,926	建設・土木
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	-	790	976	13,338	通信機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	1,610	1,875	1,578	21,565	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,700	4,970	3,170	43,313	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	2,152	2,768	9,286	126,855	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,490	3,490	8,672	118,468	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD - H	3,164.5	4,034.5	2,646	36,152	機械
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	1,040	1,530	2,861	39,082	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,005	2,400	2,140	29,243	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO	984	1,280	4,441	60,672	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	2,138.05	2,078.05	3,000	40,989	自動車
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	2,120	2,850	1,710	23,358	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	2,660	3,170	2,117	28,925	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	568	900	1,872	25,571	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	3,420	4,720	1,449	19,793	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	-	3,250	656	8,967	医薬品
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,630	2,570	8,172	111,637	不動産管理・開発
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	1,215	1,615	3,730	50,960	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	581	814	2,840	38,806	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	4,548.8	5,428.8	3,984	54,431	銀行
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,570	2,570	981	13,410	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	21,460	27,260	11,585	158,257	銀行
FAR EAST HORIZON LTD	1,660	2,020	1,583	21,633	各種金融サービス
CITIC SECURITIES CO LTD	1,650	2,425	4,452	60,818	資本市場
HAITONG SECURITIES CO LTD	2,352	3,636	3,810	52,051	資本市場
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	5,060	6,910	2,529	34,546	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	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	335	490	2,197	30,019	医薬品
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	—	3,820	2,444	33,395	不動産管理・開発
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	1,575	—	—	—	建設・土木
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	2,185	3,455	1,720	23,503	資本市場
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	9,860	9,860	0	0	半導体・半導体製造装置
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	—	1,000	1,240	16,938	自動車部品
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	3,230	3,230	0	0	食品
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,450	9,040	2,567	35,070	資本市場
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	940	1,640	3,780	51,637	機械
CHINA VANKE CO LTD-H	1,125.61	1,254.61	3,995	54,584	不動産管理・開発
CGN POWER CO LTD	7,740	12,130	2,498	34,133	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
FULLSHARE HOLDINGS LTD	5,750	7,025	2,746	37,520	不動産管理・開発
GF SECURITIES CO LTD	1,030	1,332	1,878	25,655	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	544	512	1,461	19,967	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	1,222	1,794	2,698	36,857	資本市場
3SBIO INC	900	1,130	1,993	27,228	バイオテクノロジー
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	—	2,120	2,310	31,565	医薬品
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,300	10,000	3,180	43,438	資本市場
MEITU INC	—	1,050	932	12,736	コンピュータ・周辺機器
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	18,400	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	623,271.39 136銘柄	779,691.89 139銘柄	999,014 —	13,646,535 <20.5%>
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACER INC	3,365.32	3,145.32	6,888	25,142	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	575.54	745.54	20,390	74,425	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	376.16	466.16	5,990	21,864	半導体・半導体製造装置
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	5,338.06	7,378.06	32,832	119,838	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	1,979.28	2,629.28	7,664	27,974	建設資材
TAIWAN BUSINESS BANK	3,263.8	3,361.71	2,965	10,822	銀行
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	580	—	—	—	化学
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	780	990	6,286	22,945	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	570	730	6,935	25,312	コンピュータ・周辺機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	313.12	725.43	5,433	19,832	コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC	2,228.58	2,668.58	14,356	52,402	コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	950.7	900.7	4,012	14,646	不動産管理・開発
EVA AIRWAYS CORP	1,535.55	2,861.61	4,335	15,823	旅客航空輸送業
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	537.6	687.6	24,856	90,727	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	4,111.96	5,397.55	9,175	33,491	銀行
CHINA AIRLINES	2,321.56	2,321.56	2,426	8,855	旅客航空輸送業
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	1,591.69	2,011.69	9,545	34,840	自動車部品
CHINA STEEL CORP	10,180.58	13,500.58	31,456	114,815	金属・鉱業
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	2,601.62	2,641.46	8,228	30,032	保険
ADVANTECH CO LTD	262.64	368.89	7,433	27,130	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	2,983.04	4,503.04	8,825	32,214	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,686.63	2,066.63	24,799	90,518	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	570	1,100	9,845	35,934	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,133.27	3,903.27	44,302	161,702	各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	6,461.94	8,801.94	11,090	40,480	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,338	1,718	18,812	68,664	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	1,603.92	1,786.58	2,626	9,585	海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	2,208.24	3,418.24	9,058	33,062	コングロマリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	298.25	298.25	4,160	15,186	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	150.22	183.22	6,577	24,008	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	602.85	612.85	7,721	28,184	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	3,396.33	4,366.33	46,283	168,933	化学
FORMOSA TAFFETA CO LTD	330	650	2,122	7,746	繊維・アパレル・贅沢品
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	2,655.94	3,105.94	33,544	122,436	化学

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
TRANSCEND INFORMATION INC	128.97	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
GIANT MANUFACTURING	231.51	301.51	4,462	16,287	レジャー用品
MEDIATEK INC	1,225.07	1,575.07	53,552	195,466	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,829.36	7,039.36	35,161	128,339	各種金融サービス
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	6,136.32	7,093.13	12,590	45,954	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	180	310	9,160	33,435	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	1,340	1,770	13,806	50,391	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,311.41	10,461.41	14,332	52,312	資本市場
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	6,739.2	8,589.2	44,320	161,768	保険
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	10,914.03	13,614.03	14,090	51,430	銀行
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,962.4	9,070.28	18,185	66,378	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	12,735.32	16,345.32	141,387	516,062	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	8,504.95	11,374.95	28,835	105,249	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	82.2	102.2	36,587	133,544	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	7,177.48	9,989.77	14,185	51,776	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	6,947.24	8,567.24	10,195	37,211	保険
INVENTEC CO LTD	2,070.05	2,680.05	6,030	22,009	コンピュータ・周辺機器
HTC CORPORATION	568.32	568.32	3,512	12,819	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,558.45	2,188.45	8,983	32,790	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	8,343.32	10,955.33	11,393	41,586	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	14,440.48	18,500.48	39,036	142,481	銀行
MACRONIX INTERNATIONAL	—	1,930	9,042	33,003	半導体・半導体製造装置
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,522.82	8,913.27	18,049	65,880	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD	169.5	—	—	—	レジャー用品
POWERTECH TECHNOLOGY INC	555.6	685.6	6,499	23,723	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	3,908.28	4,998.28	41,185	150,328	化学
WISTRON CORP	2,091.1	2,593.01	6,288	22,951	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	1,619.9	2,369.9	9,041	33,000	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	4,022.97	5,112.97	36,046	131,569	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	473.92	573.92	17,303	63,158	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	934.8	1,374.8	16,153	58,961	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	126.58	166.58	4,714	17,206	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	755.47	906.56	3,227	11,779	不動産管理・開発
RUENTEX INDUSTRIES LTD	787.15	687.15	3,903	14,245	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	765.88	945.88	7,330	26,756	コンピュータ・周辺機器
SILICONWARE PRECISION INDS	1,637.43	2,277.43	11,614	42,394	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP	356.53	706.39	4,761	17,377	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	1,148.99	1,448.99	6,404	23,376	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT CORP	2,738.74	3,898.74	14,815	54,075	建設資材
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	1,560	2,280	5,506	20,097	電気設備
TAIWAN SEMICONDUCTOR	20,210.83	25,800.83	614,059	2,241,318	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	9,875.25	12,005.25	18,428	67,262	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	—	3,240	6,026	21,996	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORP	—	220	13,288	48,501	電子装置・機器・部品
YULON MOTOR CO	651.49	—	—	—	自動車
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	—	2,270	5,266	19,222	運送インフラ
INNOLUX CORPORATION	6,693.45	9,643.45	11,138	40,654	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	1,225.26	1,995.26	7,861	28,693	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	172.16	205.6	10,567	38,572	機械
TAI MEDICAL BIOTECH INC	130	180	4,491	16,392	バイオテクノロジー
PEGATRON CORP	1,465.54	1,955.54	13,493	49,250	コンピュータ・周辺機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	—	130	7,696	28,090	機械
WIN SEMICONDUCTORS CORP	—	340	10,591	38,657	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	690.76	1,300.76	13,267	48,427	各種金融サービス
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,880	1,880	1,669	6,093	各種電気通信サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	343.85	483.85	3,135	11,444	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	6,435.23	8,528.28	14,583	53,229	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	
OBI PHARMA INC	90	—	—	—	バイオテクノロジー
CASETEK HOLDINGS LTD	120	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
GLOBALWAFERS CO LTD	—	210	10,605	38,708	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	120	150	4,005	14,618	家庭用耐久財
GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	—	180	3,042	11,103	電子装置・機器・部品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	260,587.95 88銘柄	343,730.4 90銘柄	1,955,891 —	7,139,005 <10.7%>
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
AKBANK TAS	1,666.71	2,165.63	1,979	51,840	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	165.7	215.2	571	14,969	飲料
ARCELIK	275.96	304.29	502	13,149	家庭用耐久財
AELSAN ELEKTRONIK SANAYI	—	176.77	467	12,231	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	1,126.25	1,527.76	1,624	42,532	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	55.84	89.14	536	14,054	自動車
KOC HOLDING AS	526.99	845.07	1,250	32,755	コングロマリット
PETKIM PETROKIMYA HOLDING	476.02	801.59	609	15,955	化学
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	568.71	796.24	376	9,863	コングロマリット
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	103.7	177.97	475	12,454	自動車
TURK HAVA YOLLARI	399.58	578.27	1,052	27,563	旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	748.6	1,108.41	1,573	41,221	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI AS	1,752.7	2,430.61	2,318	60,729	銀行
TURKIYE IS BANKASI	1,099.94	1,625.02	1,041	27,280	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	105.59	129.01	1,443	37,808	石油・ガス・消耗燃料
ULKER BISKUVI SANAYI AS	76.96	131.21	271	7,120	食品
YAPI VE KREDI BANKASI AS	477.21	735.99	311	8,153	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING AS	796.25	983.54	990	25,939	各種金融サービス
COCA-COLA ICECEK AS	64.51	64.51	229	6,004	飲料
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	180.94	218.17	1,551	40,625	食品・生活必需品小売り
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	636.08	907.31	557	14,590	銀行
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	287.06	137.35	344	9,028	運送インフラ
TURKIYE HALK BANKASI AS	514.8	619.7	543	14,233	銀行
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	399.75	562	345	9,037	各種電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,505.85 23銘柄	17,330.76 24銘柄	20,967 —	549,143 <0.8%>
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
ALFA SAB DE CV	2,057	3,062	7,137	42,468	コングロマリット
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	423	538	6,736	40,080	飲料
EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	156	191	2,638	15,696	複合小売り
GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	1,525	—	—	—	銀行
GRUPO TELEVISIA SAB	1,995	2,614	17,166	102,138	メディア
GRUPO BIMBO SAB DE CV	1,216	1,644	7,059	42,003	食品
GRUMA SAB DE CV	160.6	245.7	5,552	33,034	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	178.45	220.3	4,163	24,775	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	469	543	3,534	21,029	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	2,164	2,616	31,214	185,723	銀行
MEXICHEM SAB DE CV	876.25	1,082.25	6,370	37,902	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	119.05	147	5,815	34,603	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	1,303	1,567	5,464	32,511	家庭用品
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	211.7	206.85	6,773	40,303	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	3,144.52	4,110.52	26,077	155,158	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE CV	27,113.78	35,278.78	62,760	373,427	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	1,694	2,447	7,722	45,950	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	297	434	5,807	34,553	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	4,272	5,462	27,391	162,981	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	300	397	7,846	46,687	運送インフラ
OHL MEXICO SAB DE CV	702	—	—	—	運送インフラ
GENTERA SAB DE CV	849	1,030	1,591	9,468	消費者金融

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	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	455	532	4,722	28,099	ガス
BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	—	1,953.9	5,388	32,063	銀行
GRUPO LALA SAB DE CV	504	504	1,228	7,311	食品
小計	株数・金 銘柄数<比率>	52,185.35 24銘柄	66,826.3 23銘柄	260.163 —	1,547.975 <2.3%>
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	5,530	7,964	31,656	65,213	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,577.2	2,309.4	16,050	33,063	コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	594.86	1,040.86	10,720	22,084	銀行
AYALA CORP	232.33	248.03	22,545	46,444	各種金融サービス
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,698	3,406	4,836	9,963	コングロマリット
DMCI HOLDINGS INC	3,518.5	3,518.5	4,257	8,770	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC	20.7	27.85	4,302	8,863	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	406.8	406.8	3,966	8,170	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,639.4	2,900.5	17,983	37,045	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP	360.3	441.3	12,735	26,235	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	474.51	820.37	6,759	13,925	銀行
BDO UNIBANK INC	1,472.83	2,130.13	28,330	58,361	銀行
MEGAWORLD CORP	9,620	9,620	4,232	8,719	不動産管理・開発
PLDT INC	69.75	95.2	13,375	27,553	無線通信サービス
ROBINSONS LAND CORP	1,724	2,187.22	4,199	8,650	不動産管理・開発
SECURITY BANK CORP	94.5	234.2	5,246	10,806	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC	6,336.75	9,369.75	31,388	64,660	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	728.6	902.1	12,304	25,347	食品
SM INVESTMENTS CORP	199.88	241.58	22,177	45,684	コングロマリット
ENERGY DEVELOPMENT CORP	8,090	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	11,808	18,109	8,348	17,197	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	1,229	2,163	8,143	16,776	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY	—	240	7,776	16,018	電力
GT CAPITAL HOLDINGS INC	56.8	90.7	9,723	20,029	各種金融サービス
小計	株数・金 銘柄数<比率>	58,482.71 23銘柄	68,466.49 23銘柄	291.061 —	599,587 <0.9%>
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	53,738.43	70,291.7	366,500	65,860	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	30.83	45.34	203,549	36,577	銀行
BANCO DE CHILE	20,493.63	27,488.49	275,929	49,584	銀行
EMPRESAS CMPC SA	879.42	1,248.39	298,877	53,708	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	411.53	392.14	382,842	68,796	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	93.89	151.7	134,741	24,213	飲料
ENTEL CHILE SA	125.43	165	117,763	21,162	無線通信サービス
ENEL GENERACION CHILE SA	2,195.57	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ENEL AMERICAS SA	22,143.6	30,871.2	431,085	77,466	電力
COLBUN SA	6,165.27	9,365.35	138,588	24,904	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AGUAS ANDINAS SA	2,241.16	3,253.57	128,786	23,142	水道
EMBOTELLADORA ANDINA SA	213.8	272.7	83,061	14,926	飲料
LATAM AIRLINES GROUP SA	273.96	326.04	306,223	55,028	旅客航空輸送業
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	94.32	93.43	297,453	53,452	化学
SACI FALABELLA	506.96	774.28	459,705	82,609	複合小売り
ITAU CORPBANCA	93,801.82	194,162.26	116,846	20,997	銀行
CENCOSUD SA	1,069.32	1,483.98	273,720	49,187	食品・生活必需品小売り
AES GENER SA	2,571.35	2,571.35	44,528	8,001	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ENEL CHILE SA	16,648.38	26,991.19	207,184	37,231	電力
小計	株数・金 銘柄数<比率>	223,698.67 19銘柄	369,948.11 18銘柄	4,267.387 —	766,849 <1.2%>
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	300.75	453.24	651,759	25,614	電力
CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA	77.87	—	—	—	各種金融サービス

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	
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
ECOPETROL SA	4,130.49	4,479.53	1,285,625	50,525	石油・ガス・消耗燃料
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	148.29	101.38	370,037	14,542	各種金融サービス
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	2,478.61	3,736.94	459,643	18,063	銀行
CEMENTOS ARGOS SA	281.29	622.75	609,049	23,935	建設資材
GRUPO ARGOS SA	271.99	271.99	536,908	21,100	建設資材
BANCOLOMBIA SA	-	259.2	894,240	35,143	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	337.32	471.49	1,606,837	63,148	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	191.6	254.28	968,806	38,074	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>	7,382,907	290,148	
			-	<0.4%>	
(カタール)	百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR INSURANCE CO SAQ	114.62	174.87	650	19,190	保険
QATAR NATIONAL BANK	192.29	242.17	3,487	102,866	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	166.51	217.11	736	21,712	銀行
OOREDOO QSC	67.37	84.1	696	20,554	各種電気通信サービス
DOHA BANK QSC	64.24	180.35	474	13,992	銀行
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	24.06	32.22	634	18,724	総合公益事業
INDUSTRIES QATAR QSC	134.42	155.52	1,718	50,700	コンプロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	50.54	69.65	736	21,717	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	160.79	285.29	415	12,270	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN	307.92	389.23	1,412	41,680	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	79.16	79.16	278	8,208	不動産管理・開発
EZDAN HOLDING GROUP QSC	663.39	844.31	902	26,625	不動産管理・開発
DOHA BANK QSC-RTS	12.84	-	-	-	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	12,143	358,244	
			-	<0.5%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,081.63	2,984.36	281,798	462,149	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	391.09	748.55	30,739	50,412	石油・ガス・消耗燃料
ASIAN PAINTS LTD	215.77	286.21	33,658	55,199	化学
EICHER MOTORS LTD	12.64	14.43	44,772	73,427	機械
GRASIM INDUSTRIES LTD	199.88	356.29	39,004	63,967	建設資材
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	304.28	800.51	64,789	106,254	自動車
SHREE CEMENT LTD	7.09	8.3	14,091	23,109	建設資材
ICICI BANK LTD	833.69	2,503.82	73,048	119,800	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	307.63	657.34	21,695	35,580	石油・ガス・消耗燃料
STATE BANK OF INDIA LTD	1,325.33	1,838.08	45,611	74,803	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	56.63	36.57	4,993	8,189	陸運・鉄道
LIC HOUSING FINANCE LTD	246.16	343.15	19,293	31,641	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LTD	210.15	374.27	22,308	36,585	金属・鉱業
TATA MOTORS LTD	1,288.86	1,746.54	58,762	96,370	自動車
JSW STEEL LTD	651.22	860	26,586	43,602	金属・鉱業
TATA POWER CO LTD	919.86	1,147.7	10,036	16,460	電力
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	-	33.39	17,837	29,253	食品
NESTLE INDIA LTD	19.63	23.43	21,118	34,634	食品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	490.99	736.48	6,492	10,646	電気設備
GAIL INDIA LTD	401.28	689.58	22,456	36,828	ガス
VEDANTA LTD	776.89	1,603.88	46,320	75,964	金属・鉱業
AXIS BANK LTD	1,369.82	1,895.45	100,913	165,498	銀行
TITAN COMPANY LTD	253.02	311.53	31,078	50,968	繊維・アパレル・贅沢品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	942.54	1,215.18	21,970	36,031	石油・ガス・消耗燃料
LUPIN LTD	183.2	225	18,113	29,706	医薬品
ACC LTD	33	39.22	6,224	10,207	建設資材
BAJAJ FINANCE LTD	138.4	175.42	33,944	55,669	消費者金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,242.88	1,591.84	300,810	493,328	貯蓄・抵当・不動産金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	474.19	581.63	33,469	54,890	メディア
INFOSYS LTD	1,507.33	1,833.01	206,250	338,250	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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
WIPRO LTD	461.82	1,215.45	34,609	56,760	情報技術サービス
INDIAN OIL CORP LTD	—	1,166.92	19,510	31,997	石油・ガス・消耗燃料
HINDUSTAN UNILEVER LTD	536.74	683.93	98,865	162,139	家庭用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	64.54	—	—	—	ヘルスケア・アドバイザー/ヘルスケア・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	464.34	592.5	59,901	98,238	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	443.19	613.72	21,096	34,598	パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	41.16	47.9	18,053	29,607	自動車
DR REDDYS LABORATORIES LTD	94.67	115.96	24,415	40,042	医薬品
BHARTI AIRTEL LTD	818.79	1,486.01	56,773	93,107	無線通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	54.44	63.66	22,203	36,413	飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	787.58	1,027.77	52,637	86,325	医薬品
DIVI'S LABORATORIES LTD	69.22	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	87.09	112.21	102,788	168,572	自動車
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	116.18	170.84	9,796	16,066	医薬品
AUROBINDO PHARMA LTD	192.51	304.26	18,877	30,959	医薬品
HAVELLS INDIA LTD	203.4	248	13,646	22,379	電気設備
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	295.34	644.6	22,129	36,291	自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	127.85	150.42	23,520	38,573	消費者金融
PETRONET LNG LTD	—	702.38	17,064	27,985	石油・ガス・消耗燃料
CIPLA LTD/INDIA	288.76	355	20,588	33,764	医薬品
LARSEN & TOUBRO LTD	241.88	504.12	68,537	112,401	建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	66.6	96.16	37,668	61,775	建設資材
ASHOK LEYLAND LTD	979.6	1,138.2	17,004	27,887	機械
BOSCH LTD	5.23	7.74	14,998	24,597	自動車部品
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	387.33	481.21	152,379	249,903	情報技術サービス
NTPC LTD	1,277.52	1,803.33	31,909	52,332	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	82.69	82	21,299	34,931	医薬品
YES BANK LTD	277.41	1,816.38	55,926	91,719	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	501.74	722.16	17,682	28,998	建設資材
BHARAT FORGE LTD	87.86	237.4	17,523	28,738	自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	816.14	1,156.54	27,687	45,407	金属・鉱業
ITC LTD	2,799.77	3,583.67	95,899	157,274	タバコ
UNITED PHOSPHORUS LTD	292.11	361.1	27,355	44,862	化学
SIEMENS INDIA LTD	101.47	62.19	6,711	11,007	コンプロマリット
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	88.83	238.24	25,644	42,056	パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	436.55	467.41	31,237	51,228	情報技術サービス
CAIRN INDIA LTD	372.31	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
IDEA CELLULAR LTD	1,035.91	1,965.27	14,041	23,028	無線通信サービス
MARICO LTD	386	453.8	14,514	23,804	パーソナル用品
POWER FINANCE CORP LTD	515.3	659.1	5,757	9,441	各種金融サービス
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	616.29	716.16	27,457	45,030	運送インフラ
RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	—	856.77	11,005	18,048	各種金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD	39.79	37.2	20,185	33,103	保険
BAJAJ AUTO LTD	61.91	84.02	24,065	39,466	自動車
COAL INDIA LTD	521.77	759.01	21,829	35,799	石油・ガス・消耗燃料
TATA MOTORS LTD	315.68	315.68	6,084	9,978	自動車
VAKRANGEE LTD	—	359.54	4,309	7,066	情報技術サービス
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	237.15	329.95	16,735	27,445	消費者金融
BHARTI INFRATEL LTD	473.37	283.64	9,473	15,536	各種電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	243.48	344.12	46,705	76,597	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	—	23.33	360	590	金属・鉱業
CADILA HEALTHCARE LTD	181.46	181.46	7,035	11,537	医薬品
IDFC BANK LTD	1,144.21	1,144.21	5,623	9,223	銀行
小計	株数	株数	金額	金額	
	35,620.06	56,633.8	3,179,319	5,214,083	
	77銘柄	80銘柄	—	<7.8%>	
(パキスタン)	百株	百株	千パキスタン・ルピー	千円	
LUCKY CEMENT LTD	—	99	6,806	6,330	建設資材

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			
(パキスタン)	百株	百株	千円	千円			
MCB BANK LTD	—	390	8,361	7,776			銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	—	745	12,298	11,437			石油・ガス・消耗燃料
UNITED BANK LTD	—	514	10,363	9,638			銀行
HABIB BANK LTD	—	544	11,199	10,415			銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,292	49,029	45,597			
(インドネシア)	百株	百株	千円	千円			
AKR CORPORINDO TBK PT	1,504	1,504	846,000	6,598			商社・流通業
UNITED TRACTORS TBK PT	1,654.01	1,692.01	6,175,836	48,171			石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	3,129	4,792	3,402,320	26,538			食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,263	1,673	8,607,585	67,139			家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	16,573	21,705	16,550,062	129,090			自動車
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	41,309	53,615	19,783,935	154,314			各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	6,209	8,456	3,086,440	24,074			食品
GUDANG GARAM TBK PT	405	486	3,637,710	28,374			タバコ
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	7,820	9,248	3,745,440	29,214			タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	1,217	1,856	3,456,800	26,963			建設資材
SUMMARECON AGUNG TBK PT	8,705	—	—	—			不動産管理・開発
BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	2,904.16	2,904.16	1,974,828	15,403			銀行
BANK MANDIRI	7,630	19,918	15,735,220	122,734			銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	1,994	2,765	2,882,512	22,483			複合小売り
BANK RAKYAT INDONESIA	9,071	58,799	21,108,841	164,648			銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	7,876	10,641	2,351,661	18,342			ガス
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	5,436	7,443	6,661,485	51,959			銀行
KALBE FARMA TBK PT	17,484	24,762	3,937,158	30,709			医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	2,416	3,303	3,303,000	25,763			建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	10,087	10,390	23,663,225	184,573			銀行
XL AXIATA TBK PT	2,907	2,907	758,727	5,918			無線通信サービス
LIPPO KARAWACI TBK PT	15,603	—	—	—			不動産管理・開発
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	4,685	—	—	—			メディア
JASA MARGA PERSERO TBK PT	2,001.25	2,001.25	902,563	7,039			送迎インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT	5,928	8,517	1,524,543	11,891			不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT	12,230	14,345	3,055,485	23,832			石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK	31,945	19,128	1,195,500	9,324			不動産管理・開発
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	1,826	2,390	2,013,575	15,705			食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	1,808	1,808	1,030,560	8,038			各種電気通信サービス
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	—	4,803	1,743,489	13,599			銀行
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	3,920	3,920	921,200	7,185			建設・土木
PT SURYA CITRA MEDIA TBK	3,673	5,113	1,360,058	10,608			メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	241,212.42	310,884.42	165,415.761	1,290,242		
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千円	千円			
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	1,012	1,260	711	20,808			銀行
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	1,434.15	1,869.09	3,214	93,969			各種電気通信サービス
DUBAI INVESTMENTS PJSC	—	1,322.22	275	8,038			コングロマリット
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	1,446.52	2,083.32	1,495	43,722			銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	1,392.12	1,528.79	1,918	56,081			銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	2,938.19	3,868.87	2,263	66,155			不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,742.03	3,000	639	18,677			不動産管理・開発
EMAAR MALLS PJSC	1,781.66	1,781.66	383	11,196			不動産管理・開発
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	2,727.83	2,727.83	123	3,596			ホテル・レストラン・レジャー
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	—	1,902.35	574	16,792			不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,474.7	21,344.13	11,599	339,041		
(ブラジル)	百株	百株	千円	千円			
BRF SA	497.92	442.92	931	29,308			食品
VALE SA	1,042.27	3,340.21	15,341	482,492			金属・鉱業

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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	80.18	—	—	—	電力
VALE SA-PREF A	1,589.96	—	—	—	金属・鉱業
RAIA DROGASIL SA	228	234	1,650	51,912	食品・生活必需品小売り
TIM PARTICIPACOES SA	697	950	1,425	44,816	無線通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	194.5	194.5	420	13,212	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	245	294	543	17,087	電力
BANCO DO BRASIL SA	702	907	3,371	106,027	銀行
INVESTIMENTOS ITAU SA	3,364.78	4,166.86	5,500	172,983	銀行
LOJAS AMERICANAS SA	545.74	744.74	1,376	43,283	複合小売り
LOJAS AMERICANAS SA	146.7	—	—	—	複合小売り
GERDAU SA	680.3	1,022.3	1,717	54,014	金属・鉱業
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	131.06	170.06	1,215	38,240	食品・生活必需品小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,420.1	3,075.1	7,168	225,435	石油・ガス・消耗燃料
PETROLEO BRASILEIRO SA	3,224.12	4,104.12	8,630	271,443	石油・ガス・消耗燃料
KROTON EDUCACIONAL SA	1,129.68	1,482.68	2,080	65,422	各種消費者サービス
CCR SA	986.2	1,328.2	1,613	50,752	運送インフラ
WEG SA	414.4	564.4	1,255	39,494	機械
BANCO BRADESCO SA PREF	2,308.15	3,513.25	11,832	372,136	銀行
BANCO BRADESCO SA	639.41	1,079.18	3,384	106,436	銀行
NATURA COSMETICOS SA	148	194	622	19,591	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	505.06	616.06	535	16,836	金属・鉱業
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	—	470	1,780	56,007	紙製品・林産品
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	314	—	—	—	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA	174.74	—	—	—	電力
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2,641.98	3,386.98	17,111	538,141	銀行
PORTO SEGURO SA	94	126	555	17,471	保険
FIBRIA CELULOSE SA	214.9	246.9	1,666	52,413	紙製品・林産品
BRASKEM SA	120.3	170.3	812	25,563	化学
ENGIE BRASIL SA	139.7	173.7	659	20,731	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LOCALIZA RENT A CAR	131.05	511.8	1,485	46,727	陸運・鉄道
TELEFONICA BRASIL S.A.	361.28	472.28	2,330	73,285	各種電気通信サービス
LOJAS RENNEN SA	527	772.7	2,576	81,020	複合小売り
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	260.64	318.64	447	14,069	電力
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	290.52	381.52	2,384	74,992	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	95	165	648	20,388	石油・ガス・消耗燃料
EQUATORIAL ENERGIA SA	167	224	1,577	49,616	電力
EMBRAER SA	497.6	670.6	1,542	48,507	航空宇宙・防衛
M DIAS BRANCO SA	84	104	469	14,767	食品
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETTRICA SA	—	250	520	16,377	電力
ODONTOPREV SA	223	322	471	14,815	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BR MALLS PARTICIPACOES SA	411	855.65	960	30,193	不動産管理・開発
JBS SA	532	899	810	25,502	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	643.49	962.49	779	24,518	電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	253.98	346.98	1,167	36,720	水道
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	73.8	103.8	668	21,023	不動産管理・開発
DURATEX SA	277.34	—	—	—	紙製品・林産品
SUL AMERICA SA	178.69	178.69	363	11,436	保険
HYPERA SA	257	350	1,272	40,034	医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	1,656.16	2,181.16	5,599	176,089	資本市場
QUALICORP SA	178	220	492	15,491	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL SA	349	408	1,544	48,580	銀行
CIELO SA	995.07	1,293.07	2,460	77,389	情報技術サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	533	740	2,054	64,629	保険
ITAUSA - INVESTIMENTOS ITAU SA-RCT	—	76.42	100	3,162	銀行
ITAUSA - INVESTIMENTOS ITAU SA-RCT	49.08	—	—	—	銀行
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	—	445	628	19,761	食品・生活必需品小売り
AMBEV SA	3,907.95	4,941.95	11,420	359,185	飲料

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千円	千円	
KLABIN SA	467	643	1,356	42,669	容器・包装
RUMO SA	687	1,082	1,508	47,436	陸運・鉄道
AES TIETE ENERGIA SA	147.58	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	39,854.38 58銘柄	52,917.21 54銘柄	140,847 —	4,429,654 <6.7%>	
(チェコ)	百株	百株	千円	千円	
KOMERCNI BANKA AS	57.07	71	6,571	34,498	銀行
O2 CZECH REPUBLIC AS	56.77	56.77	1,623	8,524	各種電気通信サービス
CEZ	135.6	179.78	9,771	51,297	電力
MONETA MONEY BANK AS	357.35	572.58	4,924	25,851	銀行
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	金額 <比率>	金額 <比率>	
	606.79 4銘柄	880.13 4銘柄	22,889 —	120,171 <0.2%>	
(韓国)	百株	百株	千円	千円	
CHEIL WORLDWIDE INC	70.97	70.97	135,197	13,627	メディア
HANMI SCIENCE CO LTD	11.42	11.64	103,596	10,442	医薬品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	32.05	41	420,250	42,361	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	27.26	32.87	864,481	87,139	保険
DB INSURANCE CO LTD	41.92	50.6	306,130	30,857	保険
COWAY CO LTD	40.55	52.8	466,224	46,995	家庭用耐久財
KT&G CORP	96.52	123.85	1,227,353	123,717	タバコ
S-1 CORPORATION	15.79	21.26	215,789	21,751	商業サービス・用品
KOREA GAS CORP	29.97	29.97	145,354	14,651	ガス
CJ CORP	10.41	15.47	244,426	24,638	コングロマリット
KAKAO CORP	25.69	48.77	575,486	58,008	インターネットソフトウェア・サービス
SK TELECOM CO LTD	16.58	20.3	453,705	45,733	無線通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO	19.67	29.87	233,882	23,575	建設・土木
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	307.31	406.12	365,914	36,884	資本市場
NCSOFT CORPORATION	14.49	18.7	716,210	72,193	ソフトウェア
LG UPLUS CORP	110.86	—	—	—	各種電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	40.5	40.5	61,357	6,184	電気設備
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	85.16	135.4	76,907	7,572	建設・土木
POSCO DAEWOO CORP	36	36	81,540	8,219	商社・流通業
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	7.13	10.15	1,325,590	133,619	パーソナル用品
LG CHEM LTD	35.13	49.4	1,820,390	183,495	化学
LG CHEM LTD	9.01	6.41	129,161	13,019	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	2.6	1.77	132,042	13,309	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	361.51	450.23	2,046,295	206,266	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	48.15	59.1	251,766	25,378	建設・土木
S-OIL CORP	33.39	43.83	512,811	51,691	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	77.71	77.71	223,804	22,559	化学
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	55.3	66	237,270	23,916	資本市場
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	11.72	16.65	683,482	68,895	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	29.55	29.55	305,842	30,828	専門小売り
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	34.75	36.2	441,640	44,517	機械
HYUNDAI MOBIS	55.73	71.83	1,784,975	179,925	自動車部品
SK HYNIX INC	476.96	612.13	5,068,436	510,898	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	60.56	79.26	321,399	32,397	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	19.07	19.97	180,928	18,237	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	125.72	163.75	2,579,062	259,969	自動車
HYUNDAI STEEL CO	58.66	80.09	401,250	40,446	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	184.31	250.79	393,740	39,689	銀行
KCC CORP	4.83	6.7	240,865	24,279	建設関連製品
KIA MOTORS CORP	214.67	280.9	883,430	89,049	自動車
KOREA ZINC CO LTD	6.3	8.27	361,812	36,470	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	217.55	274.52	948,466	95,605	電力
HANWHA CORP	37.85	37.85	146,290	14,746	コングロマリット
KOREAN AIR CO LTD	36.52	53.01	178,643	18,007	旅客航空輸送業

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
OCI COMPANY LTD	15	18.29	296,298	29,866	化学
CJ LOGISTICS	5.91	8.6	125,990	12,699	陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	14.23	19.3	185,280	18,676	化学
KT CORP	20.48	20.48	55,603	5,604	各種電気通信サービス
LG ELECTRONICS INC	87.25	113.15	1,188,075	119,757	家庭用耐久財
LOTTE CORP	4.3	33.66	212,394	21,409	コングロマリット
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	0.47	—	—	—	飲料
HANSSEM CO LTD	8.69	11	136,950	13,804	家庭用耐久財
LG CORP	71.2	102.15	861,124	86,801	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	115.9	170.37	244,480	24,643	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	39.45	54.9	185,836	18,732	建設・土木
NAVER CORP	23.02	29.52	2,208,096	222,576	インターネットソフトウェア・サービス
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	16.89	11.87	106,236	10,708	複合小売り
DONGSUH CO INC	27.98	27.98	74,566	7,516	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	32.87	40.61	341,936	34,467	資本市場
OTTOGI CORP	1.12	1.12	88,480	8,918	食品
AMOREPACIFIC GROUP	20.88	28.91	419,195	42,254	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	87.15	120.47	326,473	32,908	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	62.04	78.3	2,607,390	262,824	金属・鉱業
SAMSUNG SDI CO LTD	45.13	58.31	1,125,383	113,438	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	47.16	60.07	768,896	77,504	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	80.8	101.45	25,352,355	2,555,517	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	203.01	299.01	219,772	22,153	機械
HANWHA TECHWIN CO LTD	31.41	31.41	83,079	8,374	航空宇宙・防衛
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	14.28	18.33	3,715,491	374,521	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	6.69	8.27	327,492	33,011	複合小売り
HYOSUNG CORP	17.81	21.65	266,295	26,842	化学
ORION HOLDINGS	2.99	—	—	—	食品
YUHAN CORP	7.33	10.37	261,324	26,341	医薬品
HANON SYSTEMS	189.67	190.93	214,796	21,651	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	52.81	64.8	233,604	23,547	保険
GS HOLDINGS CORP	53.17	52.69	315,086	31,760	石油・ガス・消耗燃料
LG DISPLAY CO LTD	191.37	250.72	645,604	65,076	電子装置・機器・部品
SK NETWORKS CO LTD	102.8	148.1	79,974	8,061	商社・流通業
CELLTRION INC	65.83	85.57	2,481,530	250,138	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL GROUP	243.44	313.14	1,366,856	137,779	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	13.73	20.57	386,716	38,980	航空貨物・物流サービス
LOTTE SHOPPING CO	9.28	12.27	311,044	31,353	複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	57.7	74.58	846,483	85,325	保険
AMOREPACIFIC CORP	26.27	34.95	1,183,057	119,252	パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	7.52	7.52	131,976	13,303	パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	28.77	28.77	101,126	10,193	消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	52.83	67.27	1,335,309	134,599	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	7.56	8.7	279,705	28,194	食品
STX PAN OCEAN CO LTD	—	183.95	93,446	9,419	海運業
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	18.25	18.25	84,041	8,471	商業サービス・用品
LG INNOTEK CO LTD	11.96	14.4	196,560	19,813	電子装置・機器・部品
SK HOLDINGS CO LTD	37.91	34.4	999,320	100,731	コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	326.8	419.35	2,474,165	249,395	銀行
MEDY-TOX INC	—	4.64	334,544	33,722	バイオテクノロジー
HYUNDAI WIA CORP	14.54	14.54	76,480	7,709	自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	50.77	68.72	316,799	31,933	航空宇宙・防衛
BNK FINANCIAL GROUP INC	218.9	300.24	312,249	31,474	銀行
HANMI PHARM CO LTD	4.7	6.9	355,350	35,819	医薬品
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	168.82	264.3	161,487	16,277	保険
O MEDIA HOLDINGS CO LTD	15.37	19.5	185,835	18,732	メディア
E-MART CO LTD	14.45	22.47	613,431	61,833	食品・生活必需品小売り

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	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
DGB FINANCIAL GROUP INC	135.39	185.75	216,398	21,812	銀行
GS RETAIL CO LTD	24.82	24.82	83,643	8,431	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	54.99	75.17	384,118	38,719	自動車部品
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	—	9.78	418,095	42,143	機械
BGF RETAIL CO LTD	—	8.54	149,023	15,021	食品・生活必需品小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	—	23.81	304,768	30,720	食品
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	—	37.35	136,514	13,760	保険
NETMARBLE CORP	—	27.66	370,644	37,360	ソフトウェア
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD-RTS	—	123.01	22,756	2,293	機械
BGF CO LTD	15.94	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SAMSUNG SDS CO LTD	26.09	36.75	869,137	87,609	情報技術サービス
WOORI BANK	254.32	508.29	759,893	76,597	銀行
SAMSUNG C&T CORP	62.59	80.72	1,122,008	113,098	コンプロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	13.33	17.59	969,209	97,696	ライフサイエンス・ツール/サービス
DOOSAN BOBCAT INC	—	46.79	145,984	14,715	機械
SILLAJEN INC	—	53.78	562,001	56,649	バイオテクノロジー
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	—	34.9	327,711	33,033	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 107銘柄	9,498.66 114銘柄	93,036.180 —	9,378,046 <14.1%>
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
AMMB HOLDINGS BHD	2,271	1,902	751	20,705	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	226	434	433	11,937	食品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	2,515	4,847	3,538	97,515	銀行
DIGI.COM BHD	2,899	3,591	1,666	45,921	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	432.2	878.2	802	22,121	運送インフラ
RHB BANK BHD	1,245.8	680.8	367	10,131	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	547	700	682	18,809	コンプロマリット
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	692.35	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
GAMUDA BHD	1,357	1,946	992	27,352	建設・土木
GENTING BHD	2,049	2,482	2,233	61,563	ホテル・レストラン・レジャー
YTL CORP BHD	3,700.1	5,191.1	742	20,458	総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	166.56	202.56	390	10,751	銀行
HONG LEONG BANK BHD	480.08	630.08	1,188	32,750	銀行
IJM CORP BHD	1,827.6	3,455.6	929	25,618	建設・土木
IOI CORP BHD	1,896.13	2,402.13	1,145	31,578	食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	297	555	1,417	39,065	食品
MALAYAN BANKING BHD	2,745.75	4,437.75	4,712	129,887	銀行
LAFARGE MALAYSIA BHD	267	—	—	—	建設資材
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	861	861	370	10,203	銀行
MISC BHD	748.8	1,400.8	979	26,985	海運業
NESTLE MALAYSIA BHD	—	58	858	23,657	食品
PPB GROUP BHD	298	478	890	24,555	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	175	314	840	23,174	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	587	732	1,357	37,402	ガス
GENTING MALAYSIA BHD	2,156	3,019	1,545	42,600	ホテル・レストラン・レジャー
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	114	147	338	9,318	タバコ
TELEKOM MALAYSIA BHD	950	1,325	728	20,084	各種電気通信サービス
SP SETIA BHD	—	1,785	539	14,856	不動産管理・開発
TENAGA NASIONAL BHD	2,675.5	3,566.5	5,685	156,678	電力
UMW HOLDINGS BHD	766	390	238	6,578	自動車
DIALOG GROUP BHD	2,434.44	3,298.44	1,019	28,089	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	2,247.3	3,038.3	7,285	200,797	銀行
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,458.63	1,487.8	141	3,895	総合公益事業
AIRASIA BHD	1,072	—	—	—	旅客航空輸送業
AIRASIA GROUP BHD	—	1,479	573	15,815	旅客航空輸送業
SIME DARBY BERHAD	1,921	2,327	646	17,828	コンプロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	352	1,454	940	25,926	ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円			
AXIATA GROUP BERHAD	1,844	2,697	1,467	40,435			無線通信サービス
MAXIS BHD	1,542	1,886	1,091	30,095			無線通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,963	2,362	2,010	55,397			化学
SAPURA ENERGY BHD	3,192	3,192	245	6,773			エネルギー設備・サービス
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,255	1,405	273	7,550			メディア
IHH HEALTHCARE BHD	2,529	2,117	1,289	35,531			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	2,066	1,264	232	6,409			食品
WESTPORTS HOLDINGS BHD	835	1,300	434	11,966			運送インフラ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	-	1,531	763	21,054			金属・鉱業
SIME DARBY PROPERTY BHD	-	2,327	321	8,850			不動産管理・開発
SIME DARBY PLANTATION BHD	-	2,628	1,471	40,559			食品
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	1,745.48	1,745.48	267	7,360			不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
	61,402.72 43銘柄	85,950.54 46銘柄	-	56,843	1,566,604		<2.4%>
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円			
BIDVEST GROUP LTD	238.38	358.98	8,437	75,515			コングロマリット
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	366.73	443.26	4,561	40,826			専門小売り
DISCOVERY LTD	256.44	352.4	6,030	53,977			保険
REDEFINE PROPERTIES LTD	3,803.54	5,100	6,002	53,724			エクイティ不動産投資信託(REITs)
MASSMART HOLDINGS LTD	79.92	-	-	-			食品・生活必需品小売り
GOLD FIELDS LTD	781.54	972.28	4,569	40,898			金属・鉱業
REMGRO LTD	434.23	563.29	12,778	114,365			各種電気通信サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	173.01	220	4,616	41,313			専門小売り
MMI HOLDINGS LTD	827.06	1,114.71	2,499	22,367			保険
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	1,732.91	3,222.27	9,251	82,797			エクイティ不動産投資信託(REITs)
EXXARO RESOURCES LTD	199.85	253.4	2,767	24,768			石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	31.84	38.5	3,317	29,692			銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	85.24	151.37	1,910	17,095			保険
MTN GROUP LTD	1,448.02	1,784.39	21,020	188,130			無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	363.66	477.74	5,150	46,097			金属・鉱業
TELKOM SA SOC LTD	202.27	315.88	1,813	16,227			各種電気通信サービス
FIRSTRAND LTD	2,768.63	3,533.55	23,713	212,237			各種金融サービス
PSG GROUP LTD	62.5	155.46	3,536	31,652			各種金融サービス
NASPERS LTD	358.96	460.1	138,439	1,239,029			メディア
CORONATION FUND MANAGERS LTD	190	267	2,106	18,856			資本市場
NEDBANK GROUP LTD	163.21	220.7	6,506	58,232			銀行
NETCARE LTD	770.25	1,067.07	2,985	26,721			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	302.12	433.75	2,973	26,611			食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	526.84	706.97	5,482	49,068			各種金融サービス
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	52.51	62	1,891	16,924			金属・鉱業
SAPPI LTD	553.58	562.31	4,427	39,622			紙製品・林産品
SASOL LTD	449.72	584.19	25,183	225,395			化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	349.38	469.66	11,647	104,245			食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	202.54	259.11	7,159	64,081			専門小売り
BRAIT SE	289.31	370.6	1,426	12,769			資本市場
STANDARD BANK GROUP LTD	1,045.74	1,355.46	29,616	265,070			銀行
SPAR GROUP LTD/THE	131.19	218.08	4,523	40,488			食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	800.18	991.54	6,375	57,061			複合小売り
IMPERIAL HOLDINGS LTD	132.78	167.74	3,970	35,535			販売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	297.33	411.88	10,731	96,043			医薬品
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	317.49	758.62	13,404	119,973			銀行
TIGER BRANDS LTD	133.75	162.62	6,407	57,344			食品
SANLAM LTD	1,134.59	1,486.83	12,061	107,947			保険
INVESTEC LTD	214.36	293.12	2,827	25,302			資本市場
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	575.77	-	-	-			金属・鉱業
KUMBA IRON ORE LTD	-	53.27	1,414	12,660			金属・鉱業
PIONEER FOODS LTD	107.07	155	1,956	17,507			食品

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	
(南アフリカ)	百株	百株	千円	千円	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	230.65	—	—	—	不動産管理・開発
MONDI LTD	82.93	115.2	3,847	34,436	紙製品・林産品
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	793.7	1,358.45	3,775	33,787	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
RMI HOLDINGS	528.87	638.4	2,605	23,317	保険
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	475.22	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
VODACOM GROUP PTY LTD	305.22	640.73	9,680	86,643	無線通信サービス
SIBANYE GOLD LTD	720.04	1,720	1,737	15,547	金属・鉱業
NEPI ROCKCASTLE PLC	—	375.46	4,993	44,692	不動産管理・開発
FORTRESS REIT LTD-A	789.47	1,029.5	1,682	15,055	エクイティ不動産投資信託(REITs)
FORTRESS REIT LTD-B	651.13	953.02	1,476	13,212	エクイティ不動産投資信託(REITs)
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	2,424.17	2,678.66	624	5,585	家庭用耐久財
BID CORP LTD	271.64	356.89	9,850	88,158	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数	465,767	4,168,619	
	52銘柄	50銘柄	—	<6.3%>	
(タイ)	百株	百株	千円	千円	
BANGKOK BANK PCL	197	277	5,872	20,142	銀行
BEC WORLD PLC	862	—	—	—	メディア
BERLI JUCKER PCL NVDR	1,001	1,355	7,621	26,143	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	2,939	3,480	6,333	21,724	銀行
ROBINSON PCL-NVDR	394	643	4,083	14,004	複合小売り
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	1,421	1,927	26,303	90,221	銀行
TRUE CORP PCL NVDR	10,845.55	10,307.55	7,318	25,101	各種電気通信サービス
KASIKORN BANK PCL NVDR	490	712	14,204	48,721	銀行
TMB BANK PCL -NVDR	10,100	10,100	2,525	8,660	銀行
IRPC PCL NVDR	8,634	10,655	7,724	26,496	石油・ガス・消耗燃料
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	3,028	2,559	5,169	17,730	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	101	131	2,947	10,109	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	2,290	2,932	6,860	23,532	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL	843	1,113	22,705	77,878	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,382.2	3,587.2	5,057	17,348	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	316	442	3,049	10,460	電子装置・機器・部品
PTT PCL	804	1,094	59,732	204,882	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,641	2,613	4,729	16,222	食品
SIAM CEMENT PCL NVDR	84.5	116.5	5,615	19,260	建設資材
KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	249	249	1,780	6,106	電子装置・機器・部品
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	3,550	4,556	31,892	109,389	運送インフラ
SIAM CEMENT PCL FOREIGN	227	295	14,219	48,771	建設資材
KASIKORN BANK PCL - FOREIGN	921	1,231	24,866	85,291	銀行
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	1,136	1,390	10,981	37,664	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	3,238	4,114	9,503	32,596	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	303	389	8,402	28,820	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,503.1	2,368.1	9,353	32,084	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR	702	1,189	10,998	37,723	石油・ガス・消耗燃料
GLOW ENERGY PCL NVDR	416	540	4,698	16,114	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CP ALL PCL NVDR	4,075	5,231	43,548	149,369	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	3,016	5,448	4,658	15,977	陸運・鉄道
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	1,000.45	1,343.45	16,390	56,218	石油・ガス・消耗燃料
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	974.22	1,740.22	10,006	34,321	化学
INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	549.33	—	—	—	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,829.08	2,395.08	22,992	78,865	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	930	1,180	3,894	13,356	石油・ガス・消耗燃料
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	5,784	7,407	5,481	18,800	運送インフラ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数	431,519	1,480,112	
	78銘柄	35銘柄	—	<2.2%>	
(ポーランド)	百株	百株	千円	千円	
BANK MILLENNIUM SA	526.47	526.47	453	14,458	銀行
MBANK	12.6	15.95	700	22,318	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	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	25.96	25.96	201	6,426	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	102.75	141.9	1,317	41,972	金属・鉱業
BANK PEKAO SA	118.44	157.27	1,943	61,906	銀行
ORANGE POLSKA SA	586	586	337	10,753	各種電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	260.78	317.67	2,794	89,024	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA	1.12	1.3	1,170	37,296	繊維・アパレル・贅沢品
BANK ZACHODNI WBK SA	25.93	38.88	1,448	46,154	銀行
CD PROJEKT RED SA	—	75.17	902	28,738	ソフトウェア
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	711.72	997.25	4,155	132,395	銀行
CCC SA	26.38	33.09	906	28,886	繊維・アパレル・贅沢品
SYNTHOS SA	465.08	—	—	—	化学
EUROCASH SA	95	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GRUPA LOTOS SA	114.12	94.8	526	16,786	石油・ガス・消耗燃料
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	1,691.28	1,671.92	1,023	32,599	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA	167.4	228.1	583	18,575	メディア
GRUPA AZOTY SA	38.53	38.53	217	6,935	化学
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	612.51	811	852	27,156	電力
TAURON POLSKA ENERGIA SA	1,260.18	893.18	223	7,114	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	424.49	651.15	2,819	89,828	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	44.03	61.7	540	17,224	金属・鉱業
ALIOR BANK SA	74.34	94.05	679	21,634	銀行
DINO POLSKA SA	—	60.68	570	18,172	食品・生活必需品小売り
PLAY COMMUNICATIONS SA	—	152.28	493	15,719	無線通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,385.11 22銘柄	7,674.3 23銘柄	24,861 —	792,079 <1.2%>
(ハンガリー)	百株	百株	千ハンガリー・フォリント	千円	
RICHTER GEDEON NYRT	122.49	148.3	78,673	33,624	医薬品
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	35.01	337.62	100,880	43,116	石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT	200.37	255.55	286,216	122,328	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	357.87 3銘柄	741.47 3銘柄	465,770 —	199,070 <0.3%>
(ユーロ圏・ギリシャ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PIRAEUS BANK S.A	5,000	250	79	10,508	銀行
ALPHA BANK A.E.	1,000	1,540.71	315	41,840	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE	39.98	6,600.69	202	26,870	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.	35.18	52.17	113	15,115	建設資材
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	100.04	254.9	290	38,531	各種電気通信サービス
FF GROUP	31.3	31.3	52	6,947	専門小売り
EUROBANK ERGASIAS	16.3	1,941	184	24,450	銀行
OPAP SA	85.01	200	192	25,512	ホテル・レストラン・レジャー
JUMBO SA	56.23	104.2	157	20,891	専門小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,364.04 9銘柄	10,974.97 9銘柄	1,588 —	210,667 <0.3%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,786,086.36 822銘柄	2,382,094.46 837銘柄	—	61,196,927 <92.1%>

(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) < >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
(トルコ)		千□		千□	千トルコ・リラ 千円
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM		162.734		231.071	559 14,645
小計	□	数 銘柄	□	数 銘柄	金額 比率
		1銘柄<0.0%>		1銘柄<0.0%>	559 14,645
(メキシコ)		千□		千□	千メキシコ・ペソ 千円
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D		157		203.9	36,345 216,253
CEMEX SAB DE CV		1,149,111		1,546,875	19,985 118,914
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		188.8		322.6	10,190 60,636
小計	□	数 銘柄	□	数 銘柄	金額 比率
		3銘柄<0.8%>		3銘柄<0.6%>	66,521 395,804
(南アフリカ)		千□		千□	千南アフリカ・ランド 千円
HYPROP INVESTMENTS LTD		20,095		29,707	3,334 29,839
RESILIENT REIT LTD		20,512		28.6	1,826 16,343
小計	□	数 銘柄	□	数 銘柄	金額 比率
		2銘柄<0.1%>		2銘柄<0.1%>	5,160 46,183
合計	□	数 銘柄	□	数 銘柄	金額 比率
		6銘柄<0.9%>		6銘柄<0.7%>	— 456,632

(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	当期		期末
		買	建	額
外国	MINI MSCI EMG MKT		百万円 4,747	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

2018年4月18日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	率
株	千円		％
株式	61,196,927		92.1
投資信託受益証券、投資証券	456,632		0.7
コール・ローン等、その他	4,820,397		7.3
投資信託財産総額	66,473,957		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、66,356,793千円、99.8%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、2018年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.20円、1香港・ドル=13.66円、1台湾・ドル=3.65円、1トルコ・リラ=26.19円、1メキシコ・ペソ=5.95円、1フィリピン・ペソ=2.06円、100チリ・ペソ=17.97円、100コロンビア・ペソ=3.93円、1カタール・リアル=29.50円、1インド・ルピー=1.64円、1パキスタン・ルピー=0.93円、100インドネシア・ルピア=0.78円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.23円、1ブラジル・レアル=31.45円、1チェコ・コルナ=5.25円、100韓国・ウォン=10.08円、1マレーシア・リンギット=27.56円、1南アフリカ・ランド=8.95円、1タイ・バーツ=3.43円、1ポーランド・ズロチ=31.86円、100ハンガリー・フォリント=42.74円、1ユーロ=132.60円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年4月18日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	66,535,297,684円
コ ー ル ・ オ ー ン 等	3,159,747,715
株 式(評価額)	61,196,927,280
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	335,168,260
投 資 証 券(評価額)	121,464,424
未 収 入 金	66,134,990
未 収 配 当 金	92,333,926
差 入 委 託 証 拠 金	1,563,521,089
(B) 負 債	91,556,922
未 払 金	77,511,922
未 払 解 約 金	14,045,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	66,443,740,762
元 本	54,278,179,845
次 期 繰 越 損 益 金	12,165,560,917
(D) 受 益 権 総 口 数	54,278,179,845口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,241円

(注1) 期首元本額	40,377,016,196円	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	499,825円
追加設定元本額	34,751,524,923円	マネックス資産設計ファンド エボリューション	429,132,057円
一部解約元本額	20,850,361,274円	DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10)	43,983,763円
(注2) 期末における元本の内訳		DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20)	150,861,940円
DIAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>	3,441,256,718円	DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30)	334,818,063円
DIAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	489,621,999円	投資のソムリエ	6,969,149,974円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	5,858,861円	クルーズコントロール	1,270,017,724円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	15,725,843円	投資のソムリエ<DC年金>	497,851,493円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	18,210,990円	DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	177,667,170円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	32,046,647円	クルーズコントロール<DC年金>	493,741円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	33,302,831円	DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	15,100,712円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	18,874,652円	DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	47,035,027円
たわらノーロード 新興国株式	3,548,910,360円	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	109,132,260円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,108,649,964円	ダイナミック・ナビゲーション	1,539,998円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	46,087,081円	リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,864,479,581円
たわらノーロード バランス (堅実型)	231,164円	ワールドアセットバランス (基本コース)	1,787,762,556円
たわらノーロード バランス (標準型)	825,703円	ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	6,173,904,750円
たわらノーロード バランス (積極型)	2,623,761円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	1,141,571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)	22,478円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	835,867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)	1,736,519円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	532,814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)	2,911,111円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	2,248,337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)	2,316,179円	エマーシング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用)	4,783,607,576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)	4,884,872円	エマーシング株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,636,951,676円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	20,920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)	10,995,106,377円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	96,850円	DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	7,209,978,814円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	130,676円	期末元本合計	54,278,179,845円

■損益の状況

当期 自2017年4月19日 至2018年4月18日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	1,110,706,152円	
	受取配当	1,093,266,982	
	受取利息	13,524,688	
	その他の収益	4,119,612	
	支払利息	△205,130	
(B)	有価証券売買損益	7,556,962,010	
	売却益	11,067,084,761	
	売却損	△3,510,122,751	
(C)	先物取引等取引損益	655,745,118	
	取引益	1,200,537,340	
	取引損	△544,792,222	
(D)	その他費用	△59,461,883	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	9,263,951,397	
(F)	前期繰越損益金	486,674,169	
(G)	解約差損益金	△4,666,749,726	
(H)	追加信託差損益金	7,081,685,077	
(I)	計(E+F+G+H)	12,165,560,917	
	合次期繰越損益金(I)	12,165,560,917	

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

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(平成30年3月1日)