

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 | 2016年2月24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 | ダイナミック・ナビゲーション | 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（ETF）、短期金融資産等に投資する場合があります。 |
| | 国内債券バッシブ・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。 |
| | 国内株式バッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。 |
| | 外国債券バッシブ・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。 |
| | 外国株式バッシブ・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。 |
| | エマーシング債券バッシブ・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。 |
| | エマーシング株式バッシブ・マザーファンド | 海外の証券取引所に上場している株式 [※] を主要投資対象とします。 ※DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 |
| | J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| | 外国リート・バッシブ・ファンド・マザーファンド | 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 [※] を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。 |
| | DIAMマナーマザーファンド | 国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | 主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、債券および不動産投資信託証券（リート）の8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（ETF）、短期金融資産等 ^(**) に投資する場合があります。 （*）一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。 （**）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。 8資産への投資配分（戦略的資産配分比率）は、主として統計的手法の活用により、市場環境や運用環境等の短期的な状況変化に応じて、原則として月に1回、変更を行います。 現金等 ^(*) を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて、8資産の合計資産比率 ^(**) 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利益の獲得をめざし、資産価値下落時には基準価額の下落を抑制することをめざします。 （*）現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマナーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。 （**）合計資産比率とは、「DIAMマナーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。 日次で下値サポートライン ^(*) を設定し、基準価額の下落を下値サポートラインまでに抑えることをめざします。 （*）基準価額が下値サポートラインを下回らないことを委託会社が保証等するものではありません。相場急落の場合などには、基準価額が下値サポートラインを下回る場合があります。また、下値サポートラインの水準は、委託会社の判断により変更する場合があります。 | |
| | 実質的な組入外資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。 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。 外資産への実質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。 | |
| 組入制限 | | |
| 分配方針 | 決算日（原則として6月、12月の各2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。 | |

運用報告書（全体版）

第6期<決算日2018年12月3日>

ダイナミック・ナビゲーション

愛称：「ダイナビ」

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、「ダイナミック・ナビゲーション」は、2018年12月3日に第6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/>

ダイナミック・ナビゲーション

■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 | | | | | | | | |
| 2期 (2016年12月2日) | 円 | 円 | % | % | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 3期 (2017年6月2日) | 10,331 | 0 | 2.2 | 70.0 | 1.4 | 22.0 | — | — | — | 5.6 | 11 |
| 4期 (2017年12月4日) | 11,121 | 0 | 7.6 | 77.4 | 2.5 | 12.8 | — | — | — | 5.9 | 13 |
| 5期 (2018年6月4日) | 12,001 | 0 | 7.9 | 78.0 | 2.2 | 12.8 | — | — | — | 5.4 | 14 |
| 6期 (2018年12月3日) | 11,619 | 0 | △3.2 | 78.0 | 2.0 | 12.6 | — | — | — | 5.8 | 13 |
| 7期 (2018年12月3日) | 11,210 | 0 | △3.5 | 30.8 | 1.1 | 50.2 | — | — | — | 14.9 | 12 |

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 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5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

| 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 | 騰落率 | | | | | | | |
| (期首) 2018年6月4日 | 円 | % | % | % | % | % | % | % | % |
| 6月4日 | 11,619 | — | 78.0 | 2.0 | 12.6 | — | — | — | 5.8 |
| 6月末 | 11,467 | △1.3 | 67.6 | 2.6 | 12.6 | — | — | — | 15.5 |
| 7月末 | 11,712 | 0.8 | 68.1 | 2.2 | 12.5 | — | — | — | 15.4 |
| 8月末 | 11,754 | 1.2 | 51.5 | 1.6 | 29.4 | — | — | — | 15.3 |
| 9月末 | 11,964 | 3.0 | 68.3 | 1.9 | 12.4 | — | — | — | 15.4 |
| 10月末 | 11,125 | △4.3 | 16.1 | 0.8 | 40.7 | — | — | — | 5.0 |
| 11月末 | 11,180 | △3.8 | 31.1 | 0.7 | 50.6 | — | — | — | 14.9 |
| (期末) 2018年12月3日 | 11,210 | △3.5 | 30.8 | 1.1 | 50.2 | — | — | — | 14.9 |

(注1) 騰落率は期首比です。

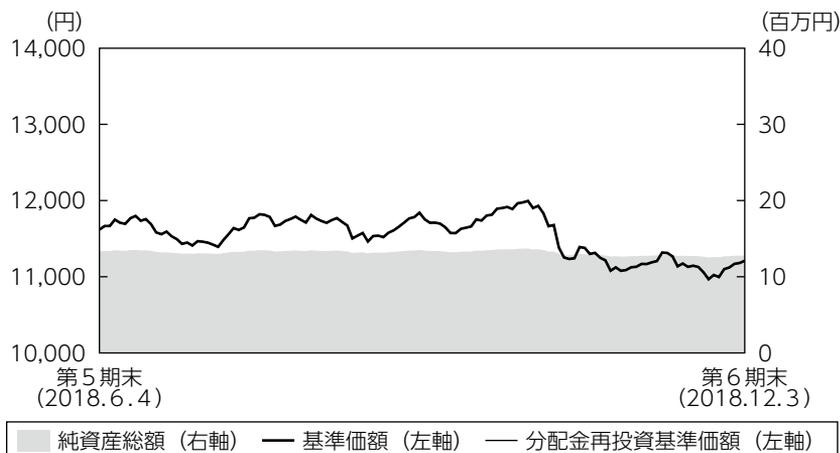
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

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

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年6月5日から2018年12月3日まで）

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (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9月までは、米国を中心に株価が上昇したことを主因に基準価額は概ね堅調な推移となりました。しかし10月以降は、米国の長期金利上昇や、景気や企業業績の先行きに対する楽観的な見方が後退したこと等を背景に世界的にリスク回避の動きが強まり、各国で株式市場が急落したことが大きなマイナス要因となって、基準価額は下落しました。

◆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 | △0.2% |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | △3.9% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1.9% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1.6% |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 2.2% |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | △7.7% |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 6.6% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 6.5% |
| D I A Mマネーマザーファンド | △0.0% |

投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）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、10年国債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を受けて低下基調に転じましたが、通期では10年国債利回りは上昇しました。

国内株式市場は下落しました。期初から9月半ばまでは、米中を始めとした貿易摩擦、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をにらみつつ、一進一退の展開となりました。9月後半には、米国の長期金利上昇に伴い円安が進行したことや自動車関税問題が後退したことなどを要因として上昇しましたが、10月以降は、米国株安や中国経済の先行き不透明感、企業決算に対する警戒感の高まりなどを受けて大きく下落しました。

先進国債券市場では、債券利回りは概ねレンジ内で揉み合う展開となりました。米国では堅調な経済情勢を背景に段階的に利上げが行われましたが、米中貿易摩擦の経済への悪影響懸念などが債券利回りの上昇を抑える要因となり、米国債利回りは概ねレンジ内での推移となりました。欧州圏ではECB（欧州中央銀行）が金融緩和策を継続する中で金利上昇は抑えられ、欧州債の利回りも概ねレンジ内で揉み合う動きとなりました。

先進国株式市場はまちまちの動きとなりました。米国市場は、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10月初旬までは堅調に推移しましたが、その後は、米国長期金利の上昇が嫌気され、世界同時株安の展開となりました。期末にかけては、米中首脳会談への期待感などから値を戻し、前期末比で小幅に上昇しました。欧州市場は、9月までは方向感の定まらない展開となりました。10月に入ると、イタリア財政への懸念などから軟調な展開となり、各国市場は通期では概ね下落しました。

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、期末にかけては低下する局面もありましたが、期を通して見ればFRB（米連邦準備理事会）による利上げや良好な米雇用統計等を受けてやや上昇しました。対米国債スプレッド（利回り格差）は、貿易摩擦や原油価格の下落などを背景に、新興国を中心にリスク回避の動きが強まったことから、拡大しました。

新興国株式市場は下落しました。期前半は、米国長期金利の上昇を背景に新興国通貨が下落したことや、米国トランプ政権が通商面での対外強硬姿勢を強め米中貿易摩擦拡大への不安が強まったことなどが嫌気され、下落しました。期の後半は、中国当局による景気下支えへの期待や米国長期金利の低下などが好感された一方で、世界景気の先行きに対する警戒感が強まり、方向感の定まらない展開となりました。

国内リート市場は上昇しました。米中貿易摩擦が悪化するとの懸念からリスク回避姿勢が強まる中、比較的リスクが低いリート市場が世界的に選好される展開となりました。特に、国内リート市場は、海外の長期金利が上昇する局面でも国内金利の上昇が限定的なものにとどまるとの見方などから、堅調な動きとなりました。期末にかけても、国内不動産市況の強さ等も意識され、底堅い展開となりました。

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は、海外の経済動向の影響を受けにくいとの見方等からリートを好む動きが見られ、上昇しました。10月中旬にかけては、米国長期金利が上昇傾向を強めたことを受けて下落しましたが、通期では上昇しました。欧州リート市場はフランスやイギリスを中心に大幅な下落となりました。豪州リート市場は、豪州長期金利の上昇により調整する場面も見られましたが、堅調な小売売上高などを背景とした豪州経済への期待などから、期末にかけて上昇しました。

為替相場では円安・米ドル高となりました。米ドル/円相場は、米国の堅調な経済指標や、新たに導入された企業減税による米国への資金還流、FRBによる利上げ継続等を背景に、概ね上昇基調で推移しました。ユーロは、イタリアの予算案を巡る不透明感等から対米ドルでは下落し、対円では概ね横ばいとなりました。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは期初から△0.15%程度で推移していましたが、10月に入ると需給要因によって△0.32%程度まで低下しました。その後は反発し、期末にかけて概ね△0.17%程度まで上昇しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

【戦略的資産配分比率】

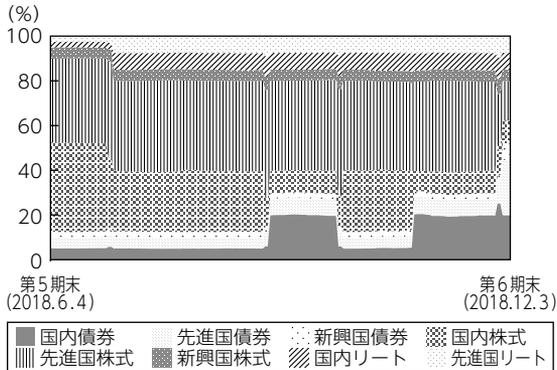
8資産への配分比率を月次で決定し、リバランスを行いました。配分比率は、主として統計的手法を活用し、リスクを一定程度に抑えつつ収益を獲得することをめざして、過去の騰落率の動き（トレンド）等に基づき決定しました。当期中は、主に国内株式・先進国株式・国内債券・先進国債券の間で配分比率の変更を行いました。国内・先進国株式は、概ね高位の配分比率が続いていましたが、期末にかけて配分比率を引き下げました。

【合計資産比率】

各資産の上昇を享受しつつ、基準価額が下値サポートラインを下回らないことを目標に、合計資産比率の調整を行いました。当期の合計資産比率は、期初から10月上旬にかけて100%近い高水準を維持しましたが、その後基準価額が急落したため大幅に引き下げ、一時32%程度まで低下させました。その後は、市場の動きが落ち着いてくると共に合計資産比率を徐々に上昇させ、再び高水準に引き上げました。

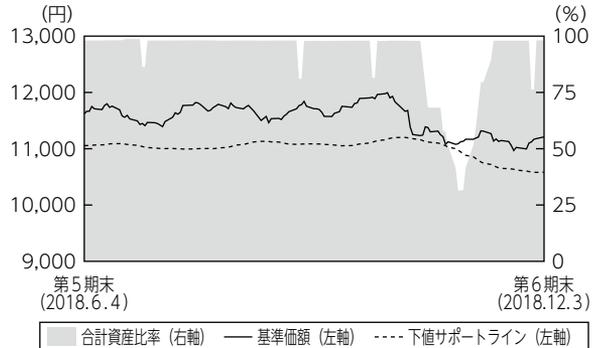
【運用状況】

＜戦略的資産配分比率の推移＞



- ※1 比率は各マザーファンド（「DIAMマネーマザーファンド」を除く）の評価額の合計に対する割合です。
- ※2 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、国内リート：J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド、外国リート：外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

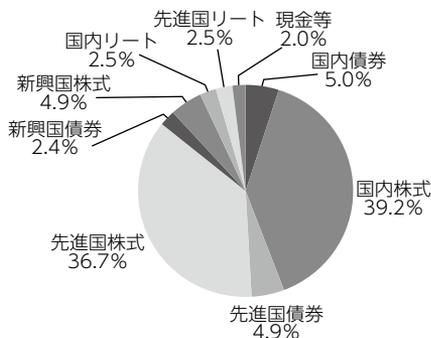
＜基準価額と合計資産比率の推移＞



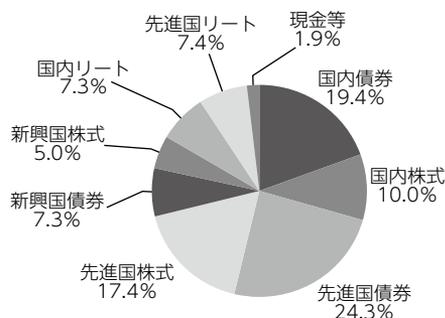
- ※ 比率は純資産総額に対する各マザーファンド（「DIAMマネーマザーファンド」を除く）評価額の合計の割合です。

<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、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「D I A Mマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●DIAMマネーマザーファンド

残存期間の短い政府保証債を中心とした運用を行いました。

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した。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6月5日 ～2018年12月3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 | 1,973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8資産に分散投資を行います。8資産への配分比率（戦略的資産配分比率）は、市場環境の変化等に応じて、原則として月次で見直します。また、基準価額の水準や市場環境等に応じて8資産の合計資産比率を機動的に変更することにより、各資産の上昇益を享受しつつ、基準価額が下値サポートラインを下回らない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、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を概ね一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

●エマージング債券パッシブ・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、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

●J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしてパッシブ運用を行います。

●D I A Mマネーマザーファンド

日銀の金融政策の物価目標2%までは依然として距離があるため、当面は政策の据え置きが予想されます。マイナス金利政策が継続されると考えられるため、政府保証債や地方債などを中心に運用を行っていきます。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第6期 | | 項目の概要 |
|-------------|----------------------------|---------|--|
| | (2018年6月5日 ～2018年12月3日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 103円 | 0.889% | (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11,536円です。 |
| (投信会社) | (50) | (0.431) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (50) | (0.431) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託銀行) | (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 | 0 | 0.003 | (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) | (0) | (0.002) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.001) | |
| (c) 有価証券取引税 | 1 | 0.005 | (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) | (0) | (0.003) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.002) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.014 | (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) | (0.005) | 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) | (0.001) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| (その他) | (1) | (0.008) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用 |
| 合計 | 105 | 0.911 | |

(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6月5日から2018年12月3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 | 3,569 | 4,580 | 2,154 | 2,758 |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 1,191 | 3,227 | 2,629 | 6,807 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,784 | 3,234 | 440 | 796 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,062 | 3,718 | 1,844 | 6,360 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 459 | 830 | 120 | 218 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 413 | 459 | 375 | 404 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 683 | 1,274 | 380 | 709 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,050 | 1,272 | 581 | 692 |
| D I A Mマネーマザーファンド | 4,951 | 5,000 | 4,951 | 5,000 |

■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 | 42,057,067千円 | 40,241,983千円 | 29,570,489千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 284,542,208千円 | 305,417,694千円 | 54,262,082千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.14 | 0.13 | 0.54 |

(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6月5日から2018年12月3日まで）

【ダイナミック・ナビゲーション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。

【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】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|--------------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 公 社 債 | 百万円 84,824 | 百万円 4,894 | % 5.8 | 百万円 80,102 | 百万円 1,640 | % 2.0 |

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。

(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 206 | 百万円 - |

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|--------------|---------------|--------------------|--------|---------------|--------------------|------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 株 式 | 百万円 17,825 | 百万円 - | % - | 百万円 24,231 | 百万円 5 | % 0.021 |

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 186 | 百万円 207 | 百万円 2,976 |

(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 28 |

【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。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|--------------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 投 資 証 券 | 百万円 16,635 | 百万円 514 | % 3.1 | 百万円 21,814 | 百万円 500 | % 2.3 |

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) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 | |
|---------|-----|------------|
| | 買 付 | 額 |
| 投 資 証 券 | | 百万円 966 |

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【D I A Mマネー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 403 | 百万円 202 | % 50.2 | 百万円 200 | 百万円 - | % - |

平均保有割合 0.1%

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

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、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。

■自社による当ファンドの設定・解約状況

| 期首残高 (元本) | 当期設定元本 | 当期解約元本 | 期末残高 (元本) | 取 引 の 理 由 |
|-----------|----------|----------|-----------|--------------------|
| 百万円 10 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 10 | 当初設定時又は当初運用時における取得 |

■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 | 514 | 1,929 | 2,485 |
| 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド | 1,930 | 492 | 1,282 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 367 | 1,711 | 3,113 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,416 | 633 | 2,226 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 177 | 516 | 936 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 534 | 572 | 644 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 180 | 483 | 935 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 282 | 751 | 942 |
| D I A M マネーマザーファンド | 98 | 98 | 99 |

■投資信託財産の構成

2018年12月3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 | 2,485 | 19.2 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 1,282 | 9.9 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 3,113 | 24.1 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2,226 | 17.2 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 936 | 7.3 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 644 | 5.0 |
| J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 935 | 7.2 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 942 | 7.3 |
| D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド | 99 | 0.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 254 | 2.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 12,921 | 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、2018年12月3日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは198,208,611千円、98.1%、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは333,295,646千円、99.8%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは81,849,259千円、100.0%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは50,037,179千円、99.2%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは39,614,665千円、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12月3日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.64円、1カナダ・ドル=85.72円、1オーストラリア・ドル=83.54円、1香港・ドル=14.53円、1シンガポール・ドル=82.95円、1ニュージーランド・ドル=78.28円、1台湾・ドル=3.69円、1イギリス・ポンド=145.06円、1イスラエル・シェケル=30.55円、1スイス・フラン=113.81円、1トルコ・リラ=21.93円、1デンマーク・クローネ=17.26円、1ノルウェー・クローネ=13.29円、1スウェーデン・クローナ=12.52円、1メキシコ・ペソ=5.63円、1フィリピン・ペソ=2.17円、100チリ・ペソ=16.89円、100コロンビア・ペソ=3.51円、1カタール・リアル=31.26円、1インド・ルピー=1.64円、1パキスタン・ルピー=0.83円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.99円、1ブラジル・レアル=29.38円、1チェコ・コルナ=4.96円、100韓国・ウォン=10.19円、1オフショア・人民元=16.43円、1マレーシア・リンギット=27.15円、1南アフリカ・ランド=8.25円、1タイ・バーツ=3.46円、1ポーランド・ズロチ=30.04円、100ハンガリー・フォリント=39.79円、1ユーロ=128.86円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年12月3日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------------|-------------|
| (A) 資 産 | 12,921,740円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 188,858 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 2,485,547 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額) | 1,282,983 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 3,113,150 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 2,226,672 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 936,874 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額) | 644,073 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額) | 935,851 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 942,065 |
| D I A M マネーマザーファンド(評価額) | 99,667 |
| 未 収 入 金 | 66,000 |
| (B) 負 債 | 117,264 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 117,082 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 182 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 12,804,476 |
| 元 本 | 11,422,337 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 1,382,139 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 11,422,337口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 11,210円 |

(注) 期首における元本額は11,470,889円、当期中における追加設定元本額は43,845円、同解約元本額は92,397円です。

■損益の状況

当期 自2018年6月5日 至2018年12月3日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|-----------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △113円 |
| 支 払 利 息 | △113 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △349,749 |
| 売 買 益 | 169,423 |
| 売 買 損 | △519,172 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △117,264 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △467,126 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,590,115 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 259,150 |
| (配 当 等 相 当 額) | (187,832) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (71,318) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 1,382,139 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 1,382,139 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 259,150 |
| (配 当 等 相 当 額) | (187,852) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (71,298) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 2,066,236 |
| 繰 越 損 益 金 | △943,247 |

(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 | 37,292円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 187,852 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 2,028,944 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 2,254,088 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額 | 1,973.40 |
| (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15期 (決算日 2018年2月14日)

(計算期間 2017年2月15日～2018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15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 | | | | |
| 11期 (2014年2月14日) | 11,945 | 2.6 | ポイント 353.47 | % 2.6 | % 99.4 | % - | % - | 百万円 442,682 |
| 12期 (2015年2月16日) | 12,161 | 1.8 | 359.95 | 1.8 | 98.5 | - | - | 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 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権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、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません(以下同じ)。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

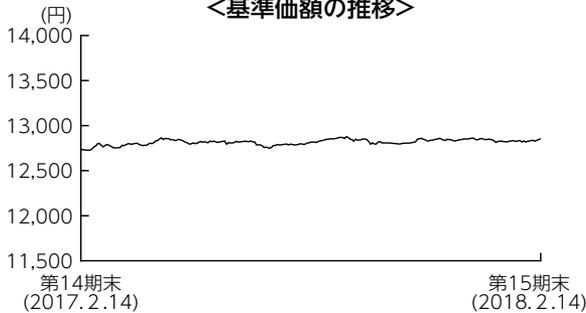
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | NOMURA-BPI総合 | | 債券組入率 比 | 新株予約債 (転換社債) 率 比 | 債券先物率 比 |
|----------------------|-------------|--------|----------------|--------|------------|---------------------------|------------|
| | | 騰 落 率 | (ベンチマーク) | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2017年 2月14日 | 円 12,730 | % - | ポイント 376.81 | % - | % 98.6 | % - | % - |
| 2 月 末 | 12,801 | 0.6 | 378.90 | 0.6 | 99.2 | - | - |
| 3 月 末 | 12,784 | 0.4 | 378.49 | 0.4 | 99.6 | - | - |
| 4 月 末 | 12,847 | 0.9 | 380.33 | 0.9 | 99.6 | - | - |
| 5 月 末 | 12,822 | 0.7 | 379.55 | 0.7 | 99.4 | - | - |
| 6 月 末 | 12,785 | 0.4 | 378.57 | 0.5 | 99.6 | - | - |
| 7 月 末 | 12,787 | 0.4 | 378.55 | 0.5 | 99.5 | - | - |
| 8 月 末 | 12,856 | 1.0 | 380.58 | 1.0 | 99.3 | - | - |
| 9 月 末 | 12,809 | 0.6 | 379.27 | 0.7 | 99.6 | - | - |
| 10 月 末 | 12,810 | 0.6 | 379.27 | 0.7 | 99.6 | - | - |
| 11 月 末 | 12,844 | 0.9 | 380.26 | 0.9 | 99.4 | - | - |
| 12 月 末 | 12,851 | 1.0 | 380.51 | 1.0 | 99.6 | - | - |
| 2018年 1 月 末 | 12,830 | 0.8 | 379.85 | 0.8 | 99.6 | - | - |
| (期 末) 2018年 2月14日 | 12,855 | 1.0 | 380.56 | 1.0 | 99.5 | - | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2017年2月15日から2018年2月14日まで）

<基準価額の推移>



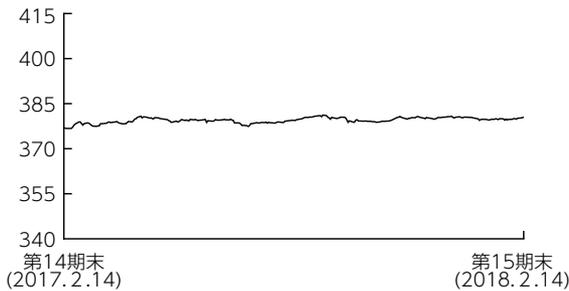
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は12,855円となり、前期末比で1.0%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

日本銀行（以下、日銀）による強力な金融緩和策等を背景に、残存期間の長い債券の利回りが低下（価格は上昇）したことから、基準価額は上昇しました。海外で長期金利が上昇した流れを受けて日本でも債券が売られ、基準価額が一時下落する局面もみられましたが、日銀が国債購入額の増額や日銀が指定する利回りによる国債買い入れ「指値オペ（公開市場操作）」を実施して利回りの上昇を抑えたことから、基準価額は上昇に転じました。

<NOMURA-BPI総合の推移>



投資環境

国内債券市場は、残存期間が長い債券を中心に利回りは低下しました。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、日銀による国債買い入れ方針や海外の長期金利の動向、北朝鮮情勢等をにらみつつ、10年国債利回りは概ね0～0.1%程度の狭い範囲で揉み合いました。良好な需給環境等を背景に残存期間が10年超の超長期債が買われ、国内債券市場は通期では上昇する結果となりました。

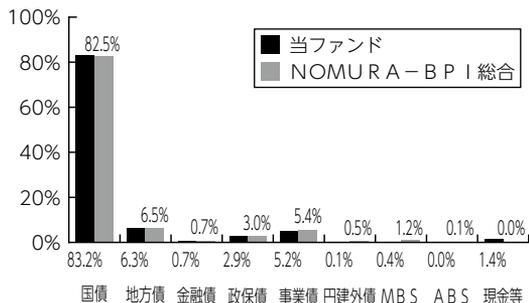
ポートフォリオについて

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。

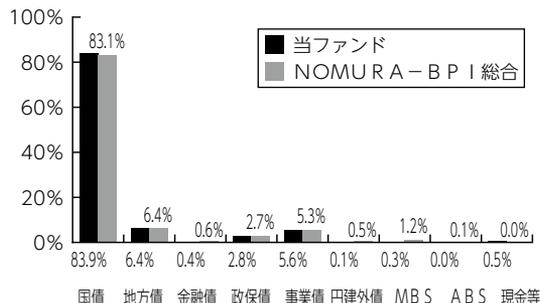
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

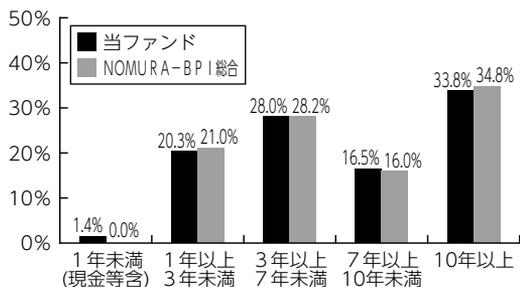


期末

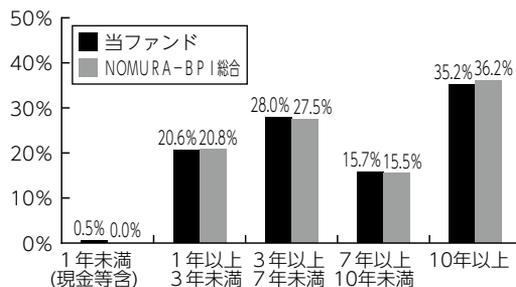


○残存年限別構成比

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1.0%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2017年2月15日から2018年2月14日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|---|------------|-------------------------|
| 国 | 内 | 千円 国債証券 | 千円 82,177,834 (-) |
| | | 地方債証券 | 1,337,675 (-) |
| | | 特殊債証券 | 3,981,378 (184,898) |
| | | 社債証券 | 3,369,132 (-) |

(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 (2017年2月15日から2018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 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 70,486 | 百万円 928 | % 1.3 | 百万円 90,866 | 百万円 1,113 | % 1.2 |

(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 - | 百万円 309 |

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 272,520,000 | 千円 298,367,587 | % 83.9 | % - | % 55.8 | % 19.3 | % 8.8 |
| 地 方 債 証 券 | 22,040,900 | 22,890,191 | 6.4 | - | 3.2 | 2.7 | 0.5 |
| 特 殊 債 証 券 | 13,796,383 | 14,254,630 | 4.0 | - | 1.6 | 1.3 | 1.0 |
| 金 融 債 証 券 | 1,500,000 | 1,501,968 | 0.4 | - | - | 0.2 | 0.3 |
| 普 通 社 債 証 券 | 16,181,000 | 16,870,570 | 4.7 | - | 1.7 | 2.3 | 0.7 |
| 合 計 | 326,038,283 | 353,884,946 | 99.5 | - | 62.4 | 25.8 | 11.4 |

(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 | |
| 117回 利付国庫債券(5年) | 0.2000 | 4,000,000 | 4,015,240 | 2019/03/20 |
| 299回 利付国庫債券(10年) | 1.3000 | 900,000 | 914,211 | 2019/03/20 |
| 375回 利付国庫債券(2年) | 0.1000 | 1,000,000 | 1,002,960 | 2019/04/15 |
| 376回 利付国庫債券(2年) | 0.1000 | 2,000,000 | 2,006,340 | 2019/05/15 |
| 377回 利付国庫債券(2年) | 0.1000 | 1,500,000 | 1,505,070 | 2019/06/15 |
| 118回 利付国庫債券(5年) | 0.2000 | 3,700,000 | 3,716,872 | 2019/06/20 |
| 301回 利付国庫債券(10年) | 1.5000 | 2,300,000 | 2,350,623 | 2019/06/20 |
| 378回 利付国庫債券(2年) | 0.1000 | 1,000,000 | 1,003,590 | 2019/07/15 |
| 379回 利付国庫債券(2年) | 0.1000 | 1,500,000 | 1,505,715 | 2019/08/15 |
| 120回 利付国庫債券(5年) | 0.2000 | 1,500,000 | 1,508,130 | 2019/09/20 |
| 121回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 2,000,000 | 2,007,640 | 2019/09/20 |
| 303回 利付国庫債券(10年) | 1.4000 | 1,300,000 | 1,331,928 | 2019/09/20 |
| 43回 利付国庫債券(20年) | 2.9000 | 860,000 | 901,701 | 2019/09/20 |
| 381回 利付国庫債券(2年) | 0.1000 | 1,000,000 | 1,004,240 | 2019/10/15 |
| 122回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 4,000,000 | 4,016,960 | 2019/12/20 |
| 305回 利付国庫債券(10年) | 1.3000 | 2,500,000 | 2,566,200 | 2019/12/20 |
| 123回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 3,000,000 | 3,014,100 | 2020/03/20 |
| 306回 利付国庫債券(10年) | 1.4000 | 1,500,000 | 1,547,880 | 2020/03/20 |
| 45回 利付国庫債券(20年) | 2.4000 | 900,000 | 947,565 | 2020/03/20 |
| 124回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 4,000,000 | 4,020,160 | 2020/06/20 |
| 308回 利付国庫債券(10年) | 1.3000 | 800,000 | 826,648 | 2020/06/20 |
| 309回 利付国庫債券(10年) | 1.1000 | 1,000,000 | 1,028,620 | 2020/06/20 |

| 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 | |
| 46回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 500,000 | 527,405 | 2020/06/22 |
| 125回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 3,000,000 | 3,016,350 | 2020/09/20 |
| 310回 利付国庫債券(10年) | 1.0000 | 2,300,000 | 2,366,654 | 2020/09/20 |
| 47回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 950,000 | 1,007,361 | 2020/09/21 |
| 126回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 2,500,000 | 2,514,950 | 2020/12/20 |
| 312回 利付国庫債券(10年) | 1.2000 | 2,200,000 | 2,282,456 | 2020/12/20 |
| 48回 利付国庫債券(20年) | 2.5000 | 500,000 | 537,380 | 2020/12/21 |
| 127回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 3,000,000 | 3,019,500 | 2021/03/20 |
| 313回 利付国庫債券(10年) | 1.3000 | 1,790,000 | 1,868,473 | 2021/03/20 |
| 50回 利付国庫債券(20年) | 1.9000 | 780,000 | 828,781 | 2021/03/22 |
| 128回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 3,000,000 | 3,021,090 | 2021/06/20 |
| 315回 利付国庫債券(10年) | 1.2000 | 1,500,000 | 1,566,120 | 2021/06/20 |
| 51回 利付国庫債券(20年) | 2.0000 | 600,000 | 642,468 | 2021/06/21 |
| 129回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 3,500,000 | 3,525,865 | 2021/09/20 |
| 317回 利付国庫債券(10年) | 1.1000 | 1,000,000 | 1,043,630 | 2021/09/20 |
| 318回 利付国庫債券(10年) | 1.0000 | 1,000,000 | 1,040,020 | 2021/09/20 |
| 52回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 550,000 | 593,648 | 2021/09/21 |
| 130回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 3,000,000 | 3,023,130 | 2021/12/20 |
| 319回 利付国庫債券(10年) | 1.1000 | 1,500,000 | 1,570,005 | 2021/12/20 |
| 320回 利付国庫債券(10年) | 1.0000 | 1,500,000 | 1,564,215 | 2021/12/20 |
| 54回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 700,000 | 762,076 | 2021/12/20 |
| 131回 利付国庫債券(5年) | 0.1000 | 3,500,000 | 3,528,700 | 2022/03/20 |

| 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 | |
| 3 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 1.0000 | 2,500,000 | 2,613,400 | 2022/03/20 |
| 5 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 810,000 | 880,040 | 2022/03/21 |
| 1 3 2 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 2,000,000 | 2,017,420 | 2022/06/20 |
| 3 2 4 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 2,000,000 | 2,078,440 | 2022/06/20 |
| 5 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 1,130,000 | 1,228,502 | 2022/06/20 |
| 1 3 3 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 3,500,000 | 3,531,465 | 2022/09/20 |
| 3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,500,000 | 1,561,545 | 2022/09/20 |
| 5 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 600,000 | 655,200 | 2022/09/20 |
| 1 3 4 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,000,000 | 1,009,480 | 2022/12/20 |
| 3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.7000 | 500,000 | 519,330 | 2022/12/20 |
| 3 2 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 620,000 | 646,982 | 2022/12/20 |
| 6 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.4000 | 590,000 | 632,893 | 2022/12/20 |
| 3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 1,500,000 | 1,552,890 | 2023/03/20 |
| 6 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.0000 | 800,000 | 844,568 | 2023/03/20 |
| 3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,800,000 | 1,884,942 | 2023/06/20 |
| 6 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 0.8000 | 800,000 | 837,752 | 2023/06/20 |
| 3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,200,000 | 1,258,956 | 2023/09/20 |
| 6 4 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 600,000 | 666,354 | 2023/09/20 |
| 3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 1,500,000 | 1,558,485 | 2023/12/20 |
| 6 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 1,100,000 | 1,226,368 | 2023/12/20 |
| 3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 2,000,000 | 2,080,000 | 2024/03/20 |
| 6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 1,170,000 | 1,309,311 | 2024/03/20 |
| 3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 2,100,000 | 2,186,793 | 2024/06/20 |
| 7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.4000 | 1,250,000 | 1,444,300 | 2024/06/20 |
| 3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.5000 | 2,000,000 | 2,072,060 | 2024/09/20 |
| 7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,250,000 | 1,426,312 | 2024/09/20 |
| 3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.5000 | 1,500,000 | 1,555,560 | 2024/12/20 |
| 3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.3000 | 1,300,000 | 1,330,316 | 2024/12/20 |
| 7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 790,000 | 900,244 | 2024/12/20 |
| 3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 2,000,000 | 2,061,800 | 2025/03/20 |
| 7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 870,000 | 1,001,970 | 2025/03/20 |
| 3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 1,800,000 | 1,856,250 | 2025/06/20 |
| 7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 890,000 | 1,015,596 | 2025/06/20 |
| 3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 2,500,000 | 2,578,850 | 2025/09/20 |
| 8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 1,030,000 | 1,187,734 | 2025/09/20 |
| 3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.3000 | 3,500,000 | 3,585,120 | 2025/12/20 |
| 8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 780,000 | 908,785 | 2025/12/20 |
| 3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 3,000,000 | 3,024,240 | 2026/03/20 |
| 8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,400,000 | 1,637,104 | 2026/03/20 |
| 3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 3,000,000 | 3,022,470 | 2026/06/20 |
| 8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.3000 | 1,200,000 | 1,428,384 | 2026/06/20 |
| 3 4 4 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 3,500,000 | 3,524,010 | 2026/09/20 |
| 9 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 1,200,000 | 1,423,764 | 2026/09/20 |
| 3 4 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 3,500,000 | 3,521,595 | 2026/12/20 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|------------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 9 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,300,000 | 1,537,276 | 2026/12/20 |
| 3 4 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 3,000,000 | 3,016,290 | 2027/03/20 |
| 9 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 700,000 | 824,600 | 2027/03/20 |
| 9 4 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 800,000 | 949,648 | 2027/03/20 |
| 3 4 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 3,500,000 | 3,517,885 | 2027/06/20 |
| 9 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.3000 | 1,200,000 | 1,452,348 | 2027/06/20 |
| 3 4 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 3,500,000 | 3,516,695 | 2027/09/20 |
| 9 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 1,400,000 | 1,688,134 | 2027/09/20 |
| 3 4 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 380,000 | 381,485 | 2027/12/20 |
| 9 9 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,400,000 | 1,680,224 | 2027/12/20 |
| 1 0 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 1,300,000 | 1,578,148 | 2028/03/20 |
| 1 0 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.4000 | 1,060,000 | 1,312,852 | 2028/06/20 |
| 1 0 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,300,000 | 1,574,144 | 2028/09/20 |
| 1 0 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,500,000 | 1,821,735 | 2028/12/20 |
| 1 0 9 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 1,600,000 | 1,913,712 | 2029/03/20 |
| 1 1 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 1,170,000 | 1,442,247 | 2029/06/20 |
| 1 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 2.8000 | 100,000 | 130,639 | 2029/09/20 |
| 1 1 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,500,000 | 1,837,440 | 2029/09/20 |
| 1 1 4 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,500,000 | 1,842,450 | 2029/12/20 |
| 2 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 2.4000 | 100,000 | 126,621 | 2030/02/20 |
| 1 1 6 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 1,600,000 | 1,989,408 | 2030/03/20 |
| 1 1 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 210,000 | 258,617 | 2030/03/20 |
| 3 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 2.3000 | 200,000 | 251,440 | 2030/05/20 |
| 1 1 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 1,000,000 | 1,221,910 | 2030/06/20 |
| 1 1 9 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 900,000 | 1,077,948 | 2030/06/20 |
| 1 2 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 1,500,000 | 1,818,780 | 2030/09/20 |
| 4 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 2.9000 | 200,000 | 268,016 | 2030/11/20 |
| 1 2 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 1,700,000 | 2,108,340 | 2030/12/20 |
| 1 2 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.2000 | 1,410,000 | 1,770,776 | 2031/03/20 |
| 5 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 2.2000 | 200,000 | 251,648 | 2031/05/20 |
| 1 2 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 700,000 | 854,056 | 2031/06/20 |
| 1 2 9 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 700,000 | 844,970 | 2031/06/20 |
| 1 3 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 1,500,000 | 1,812,765 | 2031/09/20 |
| 6 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 2.4000 | 200,000 | 257,880 | 2031/11/20 |
| 1 3 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 1,600,000 | 1,914,208 | 2031/12/20 |
| 1 3 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 180,000 | 217,760 | 2031/12/20 |
| 1 3 4 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.8000 | 900,000 | 1,090,575 | 2032/03/20 |
| 1 3 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 800,000 | 958,504 | 2032/03/20 |
| 7 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 2.3000 | 300,000 | 384,915 | 2032/05/20 |
| 1 3 7 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 1,130,000 | 1,355,875 | 2032/06/20 |
| 1 3 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.5000 | 100,000 | 117,142 | 2032/06/20 |
| 1 4 0 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 1,600,000 | 1,922,544 | 2032/09/20 |
| 8 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 1.8000 | 200,000 | 243,274 | 2032/11/22 |
| 1 4 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.7000 | 1,650,000 | 1,985,263 | 2032/12/20 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------|-------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| (国債証券) | | % | 千円 | 千円 | |
| 142回 | 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 250,000 | 304,362 | 2032/12/20 |
| 143回 | 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 1,720,000 | 2,045,699 | 2033/03/20 |
| 144回 | 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 260,000 | 305,474 | 2033/03/20 |
| 11回 | 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 400,000 | 482,120 | 2033/06/20 |
| 145回 | 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 1,400,000 | 1,687,420 | 2033/06/20 |
| 12回 | 利付国庫債券(30年) | 2.1000 | 300,000 | 379,866 | 2033/09/20 |
| 146回 | 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 1,400,000 | 1,688,162 | 2033/09/20 |
| 13回 | 利付国庫債券(30年) | 2.0000 | 300,000 | 375,702 | 2033/12/20 |
| 147回 | 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 1,700,000 | 2,025,006 | 2033/12/20 |
| 14回 | 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 500,000 | 658,110 | 2034/03/20 |
| 148回 | 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 1,300,000 | 1,528,852 | 2034/03/20 |
| 15回 | 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 200,000 | 267,078 | 2034/06/20 |
| 149回 | 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 1,900,000 | 2,235,977 | 2034/06/20 |
| 16回 | 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 400,000 | 535,276 | 2034/09/20 |
| 150回 | 利付国庫債券(20年) | 1.4000 | 1,500,000 | 1,741,515 | 2034/09/20 |
| 17回 | 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 200,000 | 264,572 | 2034/12/20 |
| 151回 | 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,800,000 | 2,032,002 | 2034/12/20 |
| 18回 | 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 820,000 | 1,073,478 | 2035/03/20 |
| 152回 | 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,300,000 | 1,466,335 | 2035/03/20 |
| 19回 | 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 200,000 | 262,254 | 2035/06/20 |
| 153回 | 利付国庫債券(20年) | 1.3000 | 1,700,000 | 1,944,936 | 2035/06/20 |
| 20回 | 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 300,000 | 404,205 | 2035/09/20 |
| 154回 | 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,500,000 | 1,690,275 | 2035/09/20 |
| 21回 | 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 300,000 | 394,263 | 2035/12/20 |
| 155回 | 利付国庫債券(20年) | 1.0000 | 1,600,000 | 1,746,768 | 2035/12/20 |
| 22回 | 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 470,000 | 634,871 | 2036/03/20 |
| 156回 | 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 1,500,000 | 1,480,020 | 2036/03/20 |
| 23回 | 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 600,000 | 811,818 | 2036/06/20 |
| 157回 | 利付国庫債券(20年) | 0.2000 | 1,300,000 | 1,234,480 | 2036/06/20 |
| 24回 | 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 300,000 | 406,557 | 2036/09/20 |
| 158回 | 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 1,500,000 | 1,500,000 | 2036/09/20 |
| 25回 | 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 400,000 | 528,524 | 2036/12/20 |
| 159回 | 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,500,000 | 1,523,205 | 2036/12/20 |
| 26回 | 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 700,000 | 938,287 | 2037/03/20 |
| 160回 | 利付国庫債券(20年) | 0.7000 | 1,300,000 | 1,340,625 | 2037/03/20 |
| 161回 | 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,380,000 | 1,394,490 | 2037/06/20 |
| 27回 | 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 700,000 | 953,211 | 2037/09/20 |
| 162回 | 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,200,000 | 1,210,608 | 2037/09/20 |
| 163回 | 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 810,000 | 815,783 | 2037/12/20 |
| 28回 | 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 900,000 | 1,229,697 | 2038/03/20 |
| 29回 | 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 900,000 | 1,216,971 | 2038/09/20 |
| 30回 | 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 900,000 | 1,202,148 | 2039/03/20 |
| 31回 | 利付国庫債券(30年) | 2.2000 | 900,000 | 1,187,748 | 2039/09/20 |
| 32回 | 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 1,100,000 | 1,479,126 | 2040/03/20 |

| 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 | |
| 33回 | 利付国庫債券(30年) | 2.0000 | 1,300,000 | 1,672,060 | 2040/09/20 |
| 34回 | 利付国庫債券(30年) | 2.2000 | 1,200,000 | 1,599,072 | 2041/03/20 |
| 35回 | 利付国庫債券(30年) | 2.0000 | 1,300,000 | 1,679,600 | 2041/09/20 |
| 36回 | 利付国庫債券(30年) | 2.0000 | 1,300,000 | 1,683,032 | 2042/03/20 |
| 37回 | 利付国庫債券(30年) | 1.9000 | 1,400,000 | 1,786,190 | 2042/09/20 |
| 38回 | 利付国庫債券(30年) | 1.8000 | 900,000 | 1,129,338 | 2043/03/20 |
| 39回 | 利付国庫債券(30年) | 1.9000 | 800,000 | 1,023,120 | 2043/06/20 |
| 40回 | 利付国庫債券(30年) | 1.8000 | 610,000 | 766,440 | 2043/09/20 |
| 41回 | 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 800,000 | 986,936 | 2043/12/20 |
| 42回 | 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 800,000 | 987,360 | 2044/03/20 |
| 43回 | 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 800,000 | 987,792 | 2044/06/20 |
| 44回 | 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 800,000 | 988,208 | 2044/09/20 |
| 45回 | 利付国庫債券(30年) | 1.5000 | 750,000 | 890,602 | 2044/12/20 |
| 46回 | 利付国庫債券(30年) | 1.5000 | 900,000 | 1,068,804 | 2045/03/20 |
| 47回 | 利付国庫債券(30年) | 1.6000 | 1,000,000 | 1,212,090 | 2045/06/20 |
| 48回 | 利付国庫債券(30年) | 1.4000 | 1,100,000 | 1,279,542 | 2045/09/20 |
| 49回 | 利付国庫債券(30年) | 1.4000 | 1,100,000 | 1,279,410 | 2045/12/20 |
| 50回 | 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 1,000,000 | 1,011,600 | 2046/03/20 |
| 51回 | 利付国庫債券(30年) | 0.3000 | 1,100,000 | 970,695 | 2046/06/20 |
| 52回 | 利付国庫債券(30年) | 0.5000 | 1,100,000 | 1,025,596 | 2046/09/20 |
| 53回 | 利付国庫債券(30年) | 0.6000 | 820,000 | 784,321 | 2046/12/20 |
| 54回 | 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 900,000 | 906,408 | 2047/03/20 |
| 55回 | 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 800,000 | 804,776 | 2047/06/20 |
| 56回 | 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 900,000 | 904,320 | 2047/09/20 |
| 57回 | 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 630,000 | 632,280 | 2047/12/20 |
| 2回 | 利付国庫債券(40年) | 2.2000 | 600,000 | 830,844 | 2049/03/20 |
| 3回 | 利付国庫債券(40年) | 2.2000 | 600,000 | 834,726 | 2050/03/20 |
| 4回 | 利付国庫債券(40年) | 2.2000 | 800,000 | 1,117,872 | 2051/03/20 |
| 5回 | 利付国庫債券(40年) | 2.0000 | 700,000 | 940,086 | 2052/03/20 |
| 6回 | 利付国庫債券(40年) | 1.9000 | 700,000 | 921,046 | 2053/03/20 |
| 7回 | 利付国庫債券(40年) | 1.7000 | 800,000 | 1,004,432 | 2054/03/20 |
| 8回 | 利付国庫債券(40年) | 1.4000 | 900,000 | 1,045,476 | 2055/03/20 |
| 9回 | 利付国庫債券(40年) | 0.4000 | 1,300,000 | 1,089,361 | 2056/03/20 |
| 10回 | 利付国庫債券(40年) | 0.9000 | 900,000 | 894,825 | 2057/03/20 |
| 小 計 | | - | 272,520,000 | 298,367,587 | - |
| (地方債証券) | | % | 千円 | 千円 | |
| 21年度4回 | 埼玉県公募公債 | 1.4600 | 200,000 | 204,150 | 2019/07/29 |
| 21年度3回 | 福岡県公募公債 | 1.5500 | 200,000 | 204,652 | 2019/08/27 |
| 21年度6回 | 北海道公募公債 | 1.6000 | 200,000 | 204,814 | 2019/08/28 |
| 166回 | 神奈川県公募公債 | 1.3600 | 300,000 | 306,366 | 2019/09/20 |
| 21年度6回 | 千葉県公募公債 | 1.4100 | 200,000 | 204,442 | 2019/09/25 |
| 21年度5回 | 静岡県公募公債 | 1.3500 | 197,000 | 201,347 | 2019/10/18 |
| 80回 | 共同発行市場公募地方債 | 1.5400 | 200,000 | 205,364 | 2019/11/25 |
| 21年度2回 | 北九州市公募公債 | 1.3600 | 200,000 | 204,934 | 2019/12/24 |

| 銘柄 | 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 | |
| 680回 | 東京都公募債 | 1.3900 | 200,000 | 205,682 | 2020/03/19 |
| 336回 | 大阪府公募債 | 1.4600 | 200,000 | 206,064 | 2020/03/30 |
| 22年度1回 | 広島県公募債 | 1.3700 | 200,000 | 206,122 | 2020/05/27 |
| 685回 | 東京都公募債 | 1.1300 | 500,000 | 512,940 | 2020/06/19 |
| 2回 | 川崎市長公募債 15年 | 1.6300 | 100,000 | 103,772 | 2020/06/22 |
| 22年度6回 | 愛知県公募債 | 1.1780 | 200,000 | 205,658 | 2020/07/30 |
| 22年度8回 | 静岡県公募債 | 1.0590 | 200,000 | 205,220 | 2020/08/25 |
| 688回 | 東京都公募債 | 0.9400 | 200,000 | 204,738 | 2020/09/18 |
| 22年度3回 | 横浜市公募債 | 1.1680 | 200,000 | 205,920 | 2020/09/18 |
| 22年度5回 | 横浜市公募債 | 1.2650 | 200,000 | 206,992 | 2020/12/11 |
| 345回 | 大阪府公募債 | 1.2600 | 300,000 | 310,587 | 2020/12/25 |
| 94回 | 共同発行市場公募地方債 | 1.2400 | 100,000 | 103,575 | 2021/01/25 |
| 22年度12回 | 北海道公募債 | 1.2900 | 200,000 | 207,466 | 2021/01/28 |
| 23年度1回 | 千葉県公募債 | 1.3700 | 200,000 | 208,548 | 2021/04/21 |
| 23年度2回 | 埼玉県公募債 | 1.1900 | 200,000 | 207,620 | 2021/05/25 |
| 697回 | 東京都公募債 | 1.1100 | 500,000 | 518,100 | 2021/06/18 |
| 99回 | 共同発行市場公募地方債 | 1.1700 | 700,000 | 726,894 | 2021/06/25 |
| 701回 | 東京都公募債 | 0.9900 | 700,000 | 724,220 | 2021/09/17 |
| 23年度4回 | 横浜市公募債 | 1.0450 | 450,000 | 467,077 | 2021/11/12 |
| 23年度9回 | 静岡県公募債 | 1.0450 | 200,000 | 207,662 | 2021/11/25 |
| 356回 | 大阪府公募債 | 1.0600 | 200,000 | 207,876 | 2021/12/27 |
| 106回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.9700 | 300,000 | 311,052 | 2022/01/25 |
| 23年度20回 | 愛知県公募債 | 1.0820 | 500,000 | 521,520 | 2022/03/29 |
| 109回 | 共同発行市場公募地方債 | 1.0500 | 500,000 | 521,240 | 2022/04/25 |
| 708回 | 東京都公募債 | 0.8900 | 500,000 | 518,655 | 2022/06/20 |
| 111回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.8900 | 700,000 | 725,872 | 2022/06/24 |
| 364回 | 大阪府公募債 | 0.7900 | 300,000 | 310,152 | 2022/09/27 |
| 194回 | 神奈川県公募債 | 0.7910 | 300,000 | 310,821 | 2022/12/20 |
| 24年度7回 | 千葉県公募債 | 0.7400 | 300,000 | 310,092 | 2022/12/22 |
| 119回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.8000 | 500,000 | 518,800 | 2023/02/24 |
| 121回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.5700 | 500,000 | 513,325 | 2023/04/25 |
| 25年度4回 | 愛知県公募債 | 0.8560 | 300,000 | 312,585 | 2023/05/30 |
| 720回 | 東京都公募債 | 0.8700 | 300,000 | 313,110 | 2023/06/20 |
| 25年度4回 | 札幌市公募債 | 0.8000 | 200,000 | 207,884 | 2023/06/20 |
| 25年度2回 | 横浜市公募債 | 0.8880 | 400,000 | 417,860 | 2023/07/14 |
| 374回 | 大阪府公募債 | 0.9380 | 300,000 | 314,409 | 2023/07/28 |
| 25年度5回 | 千葉県公募債 | 0.8400 | 200,000 | 208,532 | 2023/08/25 |
| 126回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.8100 | 793,900 | 826,727 | 2023/09/25 |
| 127回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.6800 | 500,000 | 517,300 | 2023/10/25 |
| 128回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.6600 | 300,000 | 310,101 | 2023/11/24 |
| 726回 | 東京都公募債 | 0.7300 | 400,000 | 415,512 | 2023/12/20 |
| 25年度11回 | 福岡県公募債 | 0.6940 | 200,000 | 207,312 | 2024/02/26 |
| 208回 | 神奈川県公募債 | 0.5510 | 300,000 | 308,724 | 2024/06/20 |
| 1回 | 兵庫県公募債 (12年) | 1.1000 | 300,000 | 318,960 | 2024/06/26 |

| 銘柄 | 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 | |
| 26年度5回 | 埼玉県公募債 | 0.6110 | 400,000 | 413,364 | 2024/07/29 |
| 137回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.5660 | 500,000 | 515,255 | 2024/08/23 |
| 488回 | 名古屋市長公募債 10年 | 0.5980 | 450,000 | 464,836 | 2024/09/20 |
| 139回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.5440 | 500,000 | 514,755 | 2024/10/25 |
| 26年度11回 | 京都府公募債 | 0.4760 | 350,000 | 358,942 | 2024/12/19 |
| 142回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.3450 | 500,000 | 508,265 | 2025/01/24 |
| 26年度17回 | 兵庫県公募債 | 0.4600 | 200,000 | 204,812 | 2025/02/26 |
| 5回 | 東京都公募債 20年 | 2.1100 | 100,000 | 114,229 | 2025/03/19 |
| 144回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.4700 | 400,000 | 410,296 | 2025/03/25 |
| 146回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.5530 | 400,000 | 412,624 | 2025/05/23 |
| 148回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.5530 | 500,000 | 515,395 | 2025/07/25 |
| 1回 | 静岡県公募債 20年 | 2.1800 | 100,000 | 115,370 | 2025/09/19 |
| 9回 | 東京都公募債 20年 | 2.4400 | 200,000 | 238,022 | 2026/06/19 |
| 10回 | 東京都公募債 20年 | 2.3300 | 300,000 | 355,614 | 2026/09/18 |
| 4回 | 京都市公募債 20年 | 2.5100 | 100,000 | 119,862 | 2026/09/18 |
| 166回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.1800 | 500,000 | 499,560 | 2027/01/25 |
| 小計 | | - | 22,040,900 | 22,890,191 | - |
| (特殊債券) | | | | | |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 48回 | 高速道路機構債 | 1.7100 | 700,000 | 713,048 | 2019/03/20 |
| 78回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.4000 | 700,000 | 712,068 | 2019/04/30 |
| 8回 | 政保地方公営企業金融機構債券 | 1.5000 | 651,000 | 663,661 | 2019/05/24 |
| 82回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.5000 | 100,000 | 102,092 | 2019/06/28 |
| 3回 | 政保地方公共団体金融機構債券 | 1.5000 | 101,000 | 103,319 | 2019/08/16 |
| 37回 | 住宅金融支援機構債券 | 1.4000 | 300,000 | 306,687 | 2019/09/20 |
| 89回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.3000 | 300,000 | 306,480 | 2019/09/30 |
| 5回 | 地方公共団体金融機構債券 | 1.3950 | 500,000 | 511,815 | 2019/10/28 |
| 8回 | 政保地方公共団体金融機構債券 | 1.3000 | 300,000 | 307,704 | 2020/01/20 |
| 10回 | 政保地方公共団体金融機構債券 | 1.3000 | 500,000 | 513,795 | 2020/03/13 |
| 15回 | 政保地方公共団体金融機構債券 | 1.0000 | 200,000 | 205,170 | 2020/08/14 |
| 20回 | 政保地方公共団体金融機構債券 | 1.2000 | 300,000 | 310,869 | 2021/01/20 |
| 9回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.9000 | 100,000 | 106,023 | 2021/03/26 |
| 24回 | 地方公共団体金融機構債券 | 1.2080 | 300,000 | 311,637 | 2021/05/28 |
| 18回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 2.2000 | 300,000 | 323,646 | 2021/08/30 |
| 149回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 1.0000 | 400,000 | 415,560 | 2021/11/30 |
| 36回 | 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.9010 | 300,000 | 311,712 | 2022/05/20 |
| 96回 | 高速道路機構債 | 0.7960 | 700,000 | 723,779 | 2022/09/20 |
| 180回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.7340 | 1,000,000 | 1,036,230 | 2022/12/28 |
| 44回 | 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.8340 | 400,000 | 416,548 | 2023/01/20 |
| 55回 | 鉄道建設運輸施設債 | 0.8420 | 500,000 | 519,060 | 2023/03/20 |
| 189回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.5410 | 500,000 | 513,935 | 2023/04/28 |
| 193回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.8820 | 500,000 | 523,410 | 2023/06/30 |
| 50回 | 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.9110 | 500,000 | 524,215 | 2023/07/14 |
| 195回 | 国政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.9110 | 330,000 | 346,120 | 2023/07/31 |
| 116回 | 高速道路機構債 | 0.7220 | 100,000 | 103,404 | 2023/09/20 |

| 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 | |
| 5 6 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.7470 | 542,000 | 565,018 | 2024/01/19 |
| 6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.5440 | 300,000 | 309,816 | 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 | 513,825 | 2025/03/31 |
| 3 0 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.1400 | 800,000 | 800,360 | 2027/04/30 |
| 1 3 回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券 | 1.9600 | 21,292 | 22,053 | 2032/05/10 |
| 1 4 回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券 | 1.7000 | 107,395 | 110,606 | 2032/05/10 |
| 4 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.8200 | 31,908 | 32,203 | 2036/12/10 |
| 6 回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券 | 2.2600 | 48,447 | 51,329 | 2037/05/10 |
| 8 回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券 | 2.1500 | 34,120 | 36,133 | 2037/05/10 |
| 9 回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券 | 2.1900 | 51,051 | 54,067 | 2037/05/10 |
| 2 回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券 | 2.2700 | 53,952 | 57,532 | 2037/11/10 |
| 4 3 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.2800 | 18,246 | 19,418 | 2041/06/10 |
| 4 4 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.3000 | 69,000 | 73,245 | 2041/07/10 |
| 5 1 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.2100 | 51,321 | 54,296 | 2042/02/10 |
| 1 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.1300 | 89,180 | 93,934 | 2042/05/10 |
| 2 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.9500 | 179,215 | 192,252 | 2044/10/10 |
| 3 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.8100 | 317,256 | 336,548 | 2045/05/10 |
| 小計 | - | 13,796,383 | 14,254,630 | - |
| (金融債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 2 9 3 回 利附信金中金債 | 0.2500 | 400,000 | 400,976 | 2019/04/26 |
| い第7 6 9 号 利付商工債 | 0.2500 | 200,000 | 200,408 | 2019/06/27 |
| 3 0 2 回 利附信金中金債 | 0.2000 | 300,000 | 300,900 | 2020/01/27 |
| い第7 7 9 号 利付商工債 | 0.2200 | 200,000 | 200,448 | 2020/04/27 |
| 3 2 5 回 利附信金中金債 | 0.0400 | 400,000 | 399,236 | 2021/12/27 |
| 小計 | - | 1,500,000 | 1,501,968 | - |
| (普通社債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 1 5 回 東海旅客鉄道社債 | 2.1900 | 200,000 | 204,742 | 2019/03/20 |
| 4 9 2 回 関西電力社債 | 0.6090 | 200,000 | 201,264 | 2019/03/20 |
| 4 9 3 回 関西電力社債 | 0.5840 | 200,000 | 201,394 | 2019/05/24 |
| 7 回 みずほコーポレート銀行劣後社債 | 2.5000 | 100,000 | 103,084 | 2019/06/03 |
| 4 回 リソな銀行劣後社債 | 2.7660 | 100,000 | 103,510 | 2019/06/20 |
| 2 0 回 三井住友銀行劣後社債 | 2.2100 | 200,000 | 205,998 | 2019/07/24 |
| 9 6 回 三菱地所社債 | 1.6200 | 200,000 | 204,254 | 2019/07/29 |
| 1 6 4 回 オリックス社債 | 1.1460 | 100,000 | 101,465 | 2019/08/07 |
| 4 2 3 回 九州電力社債 | 0.9590 | 200,000 | 202,908 | 2019/09/25 |
| 8 回 プリズストーン社債 | 0.2490 | 200,000 | 200,636 | 2019/09/26 |
| 1 4 回 みずほ銀行劣後特約付社債 | 2.1400 | 200,000 | 206,512 | 2019/09/27 |
| 4 1 回 住友化学社債 | 1.6400 | 100,000 | 102,510 | 2019/10/18 |
| 7 回 キリンホールディングス社債 | 1.6390 | 100,000 | 102,635 | 2019/11/05 |
| 7 回 東京三菱銀行劣後社債 | 2.1100 | 200,000 | 207,310 | 2019/12/20 |
| 4 6 回 野村ホールディングス社債 | 0.3460 | 200,000 | 200,888 | 2019/12/25 |
| 5 回 東海旅客鉄道社債 | 2.6000 | 100,000 | 105,026 | 2020/01/28 |
| 6 回 リソな銀行劣後社債 | 2.0840 | 100,000 | 103,946 | 2020/03/04 |
| 3 0 回 豊田自動織機社債 | 0.0010 | 200,000 | 199,732 | 2020/03/19 |

| 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 | |
| 1 2 回 パナソニック社債 | 0.3870 | 200,000 | 201,146 | 2020/03/19 |
| 5 6 回 日産自動車社債 | 0.5540 | 100,000 | 100,879 | 2020/03/19 |
| 3 8 回 三井不動産社債 | 1.4970 | 200,000 | 205,690 | 2020/03/19 |
| 8 7 回 住友不動産社債 | 0.8770 | 100,000 | 101,320 | 2020/03/19 |
| 2 7 回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債 | 0.3800 | 200,000 | 200,966 | 2020/05/22 |
| 2 6 0 回 北陸電力社債 | 2.3300 | 100,000 | 105,140 | 2020/05/25 |
| 1 4 回 大和証券グループ本社社債 | 1.2520 | 100,000 | 102,416 | 2020/05/27 |
| 7 回 三菱UFJ信託銀行劣後債 | 1.5900 | 200,000 | 206,672 | 2020/06/08 |
| 4 2 回 野村ホールディングス社債 | 1.2140 | 200,000 | 205,028 | 2020/06/19 |
| 9 回 日本たばこ産業社債 | 0.2170 | 200,000 | 200,636 | 2020/07/15 |
| 4 9 6 回 中部電力社債 | 1.2270 | 500,000 | 514,520 | 2020/07/24 |
| 1 5 回 トヨタファイナンス社債 | 1.8000 | 200,000 | 208,398 | 2020/08/21 |
| 1 5 回 東日本旅客鉄道社債 | 2.6500 | 300,000 | 319,839 | 2020/08/25 |
| 2 2 回 中国高速道路債券 | 1.0360 | 300,000 | 307,935 | 2020/09/18 |
| 2 6 回 野村ホールディングス社債 | 1.5470 | 100,000 | 103,622 | 2020/09/24 |
| 2 2 回 三井住友銀行劣後社債 | 1.4300 | 200,000 | 206,718 | 2020/09/28 |
| 1 2 回 住友信託銀行劣後債 | 1.3730 | 100,000 | 103,329 | 2020/11/11 |
| 2 5 回 三菱東京UFJ銀行劣後社債 | 1.3100 | 200,000 | 206,392 | 2020/11/12 |
| 2 3 回 三井住友銀行劣後社債 | 1.6100 | 400,000 | 416,588 | 2020/12/17 |
| 6 0 回 日本電信電話社債 | 1.3100 | 300,000 | 309,888 | 2020/12/18 |
| 2 8 回 三菱東京UFJ銀行劣後社債 | 1.5600 | 200,000 | 208,290 | 2021/01/20 |
| 3 7 9 回 中国電力社債 | 0.6190 | 300,000 | 304,794 | 2021/01/25 |
| 3 3 7 回 東京交通債 | 2.2300 | 200,000 | 213,352 | 2021/03/19 |
| 4 7 3 回 東北電力社債 | 0.5970 | 300,000 | 304,542 | 2021/04/23 |
| 9 回 三菱UFJ信託銀行劣後債 | 1.6800 | 100,000 | 104,630 | 2021/04/28 |
| 3 2 回 三菱東京UFJ銀行劣後社債 | 1.6200 | 300,000 | 313,821 | 2021/06/09 |
| 3 2 0 回 北海道電力社債 | 0.5850 | 200,000 | 202,950 | 2021/12/24 |
| 6 回 東海旅客鉄道社債 | 2.3900 | 100,000 | 109,216 | 2022/02/15 |
| 1 9 回 東日本旅客鉄道社債 | 2.3600 | 100,000 | 109,159 | 2022/02/25 |
| 1 3 回 パナソニック社債 | 0.5680 | 100,000 | 101,463 | 2022/03/18 |
| 9 回 西日本旅客鉄道社債 | 2.2800 | 200,000 | 218,008 | 2022/03/25 |
| 4 5 回 住友商事社債 | 1.1170 | 100,000 | 103,513 | 2022/04/20 |
| 2 3 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債 | 0.0900 | 100,000 | 99,611 | 2022/05/23 |
| 2 1 回 東日本旅客鉄道社債 | 2.0200 | 100,000 | 108,835 | 2022/09/20 |
| 9 4 回 丸紅社債 | 1.1700 | 100,000 | 103,942 | 2022/10/12 |
| 5 7 回 東京三菱銀行社債 | 2.2200 | 200,000 | 219,774 | 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 | 101,281 | 2022/11/20 |
| 1 1 回 東海旅客鉄道社債 | 1.1500 | 300,000 | 315,114 | 2022/12/20 |
| 1 8 回 大阪ガス社債 | 1.4700 | 100,000 | 106,530 | 2022/12/20 |
| 5 1 8 回 中部電力社債 | 0.1900 | 200,000 | 199,902 | 2023/01/25 |
| 1 4 回 トヨタ自動車社債 | 0.9630 | 200,000 | 208,322 | 2023/03/20 |
| 1 0 回 セブン銀行社債 | 0.8030 | 100,000 | 103,191 | 2023/03/20 |
| 4 7 回 日立キャピタル社債 | 0.8740 | 200,000 | 205,800 | 2023/03/20 |
| 3 0 1 回 北陸電力社債 | 1.1580 | 100,000 | 104,813 | 2023/03/24 |

| 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 | |
| 23回 東京瓦斯社債 | 1.0100 | 300,000 | 314,016 | 2023/06/09 |
| 27回 NTTデータ社債 | 0.9000 | 100,000 | 103,619 | 2023/06/20 |
| 253回 四国電力社債 | 1.0000 | 200,000 | 208,308 | 2023/06/23 |
| 6回 JXホールディングス社債 | 1.1190 | 100,000 | 104,480 | 2023/07/19 |
| 377回 中国電力社債 | 1.1210 | 400,000 | 419,100 | 2023/08/25 |
| 10回 西日本旅客鉄道社債 | 2.0400 | 300,000 | 331,743 | 2023/09/20 |
| 48回 クレディセゾン社債 | 1.0380 | 100,000 | 103,398 | 2023/10/20 |
| 47回 住友商事社債 | 0.8580 | 100,000 | 103,119 | 2023/10/23 |
| 424回 九州電力社債 | 1.2330 | 200,000 | 210,720 | 2023/11/24 |
| 13回 東海旅客鉄道社債 | 2.0150 | 200,000 | 221,756 | 2023/12/20 |
| 38回 電源開発社債 | 0.9780 | 300,000 | 312,222 | 2023/12/20 |
| 471回 東北電力社債 | 1.1680 | 400,000 | 420,500 | 2023/12/25 |
| 426回 九州電力社債 | 1.0640 | 400,000 | 417,840 | 2024/02/23 |

| 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 | |
| 16回 トヨタ自動車社債 | 0.6450 | 200,000 | 205,540 | 2024/03/19 |
| 14回 東海旅客鉄道社債 | 2.2000 | 100,000 | 112,370 | 2024/03/19 |
| 72回 三菱地所社債 | 2.2800 | 100,000 | 113,104 | 2024/09/20 |
| 10回 三井住友信託銀行社債 | 0.5850 | 200,000 | 204,492 | 2024/10/28 |
| 321回 北海道電力社債 | 0.8860 | 161,000 | 166,836 | 2024/12/25 |
| 39回 東日本旅客鉄道社債 | 2.0500 | 300,000 | 340,662 | 2025/06/20 |
| 13回 電源開発社債 | 2.0400 | 200,000 | 224,624 | 2025/06/20 |
| 42回 東日本旅客鉄道社債 | 2.1100 | 200,000 | 228,742 | 2025/09/19 |
| 4回 東京地下鉄社債 | 2.3800 | 120,000 | 141,288 | 2026/06/19 |
| 307回 北陸電力社債 | 1.0550 | 100,000 | 105,639 | 2026/06/25 |
| 340回 北海道電力社債 | 0.4800 | 300,000 | 300,663 | 2027/04/23 |
| 小 計 | - | 16,181,000 | 16,870,570 | - |
| 合 計 | - | 326,038,283 | 353,884,946 | - |

■投資信託財産の構成

2018年2月14日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|-------------------|---|-----------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 公 社 債 | 千円 353,884,946 | | % 99.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,950,867 | | 0.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 355,835,814 | | 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

(2018年2月14日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|--|
| (A) 資 産 | 355,835,814,093円 |
| コ ー ル ・ 公 司 未 前 未 払 収 入 利 費 | 723,783,711 353,884,946,962 199,594,000 1,015,781,908 11,707,512 |
| (B) 負 債 | 237,394,000 |
| 未 払 解 約 債 金 | 237,394,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 355,598,420,093 |
| 元 次 期 繰 越 損 益 金 数 | 276,633,033,886 78,965,386,207 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 276,633,033,886口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 12,855円 |

| | | | |
|--------------------------------|------------------|--------------------------------------|------------------|
| (注1) 期首元本額 | 298,304,698,655円 | D I AMコア資産設計ファンド (堅実型) | 1,123,528円 |
| 追加設定元本額 | 61,223,285,988円 | D I AMコア資産設計ファンド (積極型) | 3,353,398円 |
| 一部解約元本額 | 82,894,950,757円 | 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 434,974,042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 | 380,004円 |
| D I AM国内債券パッシブ・ファンド | 14,116,833,140円 | リスク抑制世界8資産バランスファンド | 6,614,557,421円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 133,630,997円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 565,325円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 112,094,157円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 440,751円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 35,282,821円 | リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C) | 2,068,108円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 665,817,907円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 1,020,092円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 184,767,471円 | D I AM高金利通貨ファンド | 9,608,918円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 24,853,650円 | D I AM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 | 2,968,219,816円 | D I AM国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け) | 22,731,156,124円 |
| たわらノーロード 国内債券<ラップ向け> | 754,493円 | D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 502,624,028円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 25,609,291円 | D I AMグローバル・バランスファンド25VA | 346,262,404円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 2,414,859円 | D I AMグローバル・バランスファンド50VA | 253,519,385円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 5,744,028円 | D I AM国際分散バランスファンド30VA | 81,923,429円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 1,631,224円 | D I AM国際分散バランスファンド50VA | 228,604,695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) | 425,258円 | D I AM国内重視バランスファンド30VA | 9,608,918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) | 2,589,498円 | D I AM国内重視バランスファンド50VA | 71,342,812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) | 2,580,489円 | D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 102,762,022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) | 1,033,708円 | D I AM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定) | 187,679,096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) | 377,393円 | D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 6,207,940,745円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 1,015,094円 | D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 3,299,932,044円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 362,556円 | D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 6,033,889,655円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安成型) | 1,451,139円 | D I AMグローバル・アセット・バランスVA | 656,691,706円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 435,024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) | 526,941,764円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 60,048円 | D I AM アクサ グローバル バランスファンド30VA | 3,870,676,474円 |
| D I AM国内債券インデックスファンド<DC年金> | 12,448,553,792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) | 3,673,885,281円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 5,551,782,165円 | D I AMグローバル私募ファンド (適格機関投資家向け) | 194,752,933円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 8,107,081,815円 | D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 255,064,334円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 3,297,729,018円 | D I AM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定) | 1,991,218,383円 |
| D I AM DC バランス30インデックスファンド | 1,833,417,110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) | 86,966,102,044円 |
| D I AM DC バランス50インデックスファンド | 2,030,565,460円 | D I AM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 1,171,879,785円 |
| D I AM DC バランス70インデックスファンド | 317,189,866円 | D I AM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 7,472,417,416円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 88,286,247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) | 28,388,504,435円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 2,216,731,348円 | D I AMバランス30VA (適格機関投資家限定) | 8,994,522円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション | 2,224,336円 | D I AMバランス50VA (適格機関投資家限定) | 49,160,062円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 479,856,497円 | D I AMバランス70VA (適格機関投資家限定) | 8,006,452円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 434,763,343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) | 31,576,808,335円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 101,361,917円 | D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) | 505,478,572円 |
| 投資のソムリエ | 3,477,837,094円 | D I AM国内バランス30VA (適格機関投資家限定) | 138,815,886円 |
| クルーズコントロール | 444,343,713円 | D I AMバランス20VA (適格機関投資家限定) | 395,041,757円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 239,353,124円 | D I AMバランス40VA (適格機関投資家限定) | 118,842,206円 |
| D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 1,836,639,342円 | D I AMバランス60VA (適格機関投資家限定) | 393,617円 |
| D I AM DC バランス・F (成長型) | 235,119,855円 | 期末元本合計 | 276,633,033,886円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 165,091円 | | |

■損益の状況

当期 自2017年2月15日 至2018年2月14日

| 項 | 目 | 当 期 |
|---------------------|---|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | | 3,691,998,263円 |
| 受 取 利 息 | | 3,694,176,970 |
| 支 払 利 息 | | △2,178,707 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | | △113,367,217 |
| 売 買 益 | | 1,823,743,849 |
| 売 買 損 | | △1,937,111,066 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | | 3,578,631,046 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | | 81,430,250,480 |
| (E) 解 約 差 損 益 金 | | △23,285,594,331 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | | 17,242,099,012 |
| (G) 合 計(C+D+E+F) | | 78,965,386,207 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | | 78,965,386,207 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《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)

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16期（決算日 2018年2月7日）

（計算期間 2017年2月8日～2018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 | | | |
| 12期 (2014年2月7日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 12期 (2014年2月7日) | 16,556 | 25.0 | 1,594.55 | 25.1 | 96.5 | 3.6 | 312,225 |
| 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 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、㈱東京証券取引所は、ファンドの発行又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）。

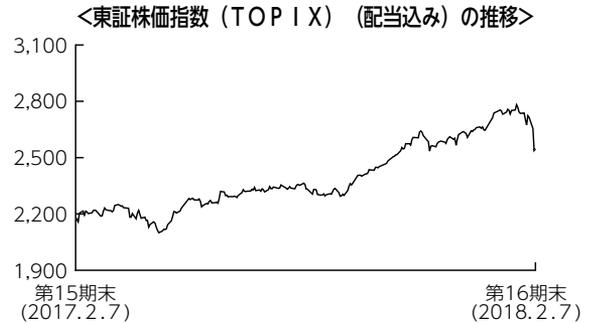
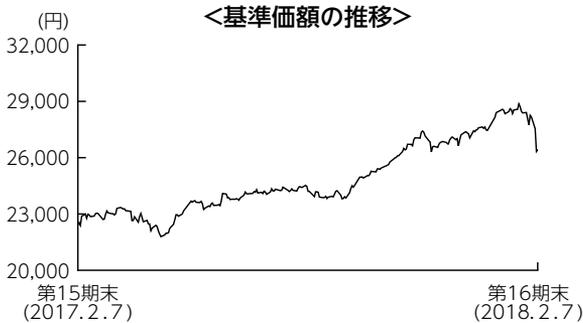
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東証株価指数(TOPIX) | | 株式組入 比 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) 2017年 2 月 7 日 | 22,429 | % - | 2,161.36 | % - | 97.6 | 2.3 |
| 2 月 末 | 22,724 | 1.3 | 2,189.71 | 1.3 | 98.3 | 1.6 |
| 3 月 末 | 22,587 | 0.7 | 2,176.87 | 0.7 | 97.8 | 2.1 |
| 4 月 末 | 22,878 | 2.0 | 2,204.51 | 2.0 | 96.1 | 3.8 |
| 5 月 末 | 23,439 | 4.5 | 2,257.27 | 4.4 | 97.7 | 2.2 |
| 6 月 末 | 24,116 | 7.5 | 2,324.06 | 7.5 | 97.1 | 2.8 |
| 7 月 末 | 24,218 | 8.0 | 2,333.91 | 8.0 | 97.5 | 2.4 |
| 8 月 末 | 24,207 | 7.9 | 2,332.80 | 7.9 | 98.4 | 1.6 |
| 9 月 末 | 25,258 | 12.6 | 2,434.16 | 12.6 | 97.2 | 2.8 |
| 10 月 末 | 26,636 | 18.8 | 2,566.81 | 18.8 | 96.9 | 2.9 |
| 11 月 末 | 27,036 | 20.5 | 2,604.86 | 20.5 | 97.8 | 2.2 |
| 12 月 末 | 27,452 | 22.4 | 2,645.77 | 22.4 | 97.8 | 2.2 |
| 2018年 1 月 末 | 27,744 | 23.7 | 2,673.82 | 23.7 | 99.1 | 0.9 |
| (期 末) 2018年 2 月 7 日 | 26,432 | 17.8 | 2,547.46 | 17.9 | 98.1 | 0.8 |

(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2月8日から2018年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は26,432円となり、前期末に比べ17.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

好調な国内の企業業績や、堅調な世界景気、米国株高などを背景に国内株式市場全体が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2017年9月半ばまでは、企業業績は好調なもの北朝鮮を巡る地政学リスクの上昇や米国政治情勢の不透明感の高まりなどが嫌気され、ほぼボックス圏での値動きとなりました。その後、9月半ばから11月上旬までは、世界景気が堅調であること、好調な国内企業業績や安倍政権安定による安心感などを要因として上昇しました。期末にかけては、米国株の急落に伴いリスク回避の動きが強まったことで国内株式市場も急落しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数（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】

○組入上位10業種

期首（前期末）

| No. | 業種 | 比率 |
|-----|--------|-------|
| 1 | 電気機器 | 12.3% |
| 2 | 輸送用機器 | 9.1 |
| 3 | 銀行業 | 8.4 |
| 4 | 情報・通信業 | 7.8 |
| 5 | 化学 | 6.6 |
| 6 | 機械 | 5.0 |
| 7 | 医薬品 | 4.6 |
| 8 | 小売業 | 4.5 |
| 9 | 卸売業 | 4.4 |
| 10 | 食料品 | 4.3 |



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 |

○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 | 3.4% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本・円 | 2.5 |
| 3 | 日本電信電話 | 日本・円 | 1.7 |
| 4 | ソフトバンクグループ | 日本・円 | 1.7 |
| 5 | 三井住友フィナンシャルグループ | 日本・円 | 1.6 |
| 6 | 本田技研工業 | 日本・円 | 1.4 |
| 7 | KDDI | 日本・円 | 1.3 |
| 8 | みずほフィナンシャルグループ | 日本・円 | 1.2 |
| 9 | ソニー | 日本・円 | 1.1 |
| 10 | 日本たばこ産業 | 日本・円 | 1.0 |
| 組入銘柄数 | | 1,968銘柄 | |



期末

| No. | 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------|-------------------|---------|------|
| 1 | トヨタ自動車 | 日本・円 | 3.5% |
| 2 | 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 | |

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは17.9%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比△0.0%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) | 0円 (0) (0) | 0.001% (0.000) (0.001) |
| (b) その他費用 (そ の 他) | 0 (0) | 0.001 (0.001) |
| 合 計 | 0 | 0.002 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(24,829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8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2月8日から2018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 |
| | | 4,509.2 (△31,741.633) | 8,822,924 (-) | 25,205.212 | 45,248,827 |

(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 74,538 | 百万円 80,180 | 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 | 54,071,752千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 291,923,007千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 0.18 |

(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2月8日から2018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 8,822 | 百万円 - | % - | 百万円 45,248 | 百万円 4 | % 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 64 | 百万円 401 | 百万円 3,091 |

(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 443 |

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 | | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 |
| 極洋 | 5.7 | 5 | 19,400 | | | | 矢作建設工業 | 19.2 | 17.3 | 14,947 | | 昭和産業 | 58 | 10.4 | 28,246 | | | | | |
| 日本水産 | 182.8 | 143 | 77,649 | | | | ピーエス三菱 | 14.9 | 15.1 | 13,091 | | 鳥越製粉 | 11.6 | 10.1 | 9,211 | | | | | |
| マルハニチロ | 26.7 | 24.1 | 80,132 | | | | 日本ハウスホールディングス | 28.7 | 24.3 | 15,454 | | 中部飼料 | 15.5 | 13.9 | 28,064 | | | | | |
| カネコ種苗 | 4.9 | 4.4 | 6,960 | | | | 大東建託 | 51.7 | 46 | 822,710 | | フィード・ワン | 85.7 | 76.6 | 17,541 | | | | | |
| サカタのタネ | 20.8 | 18.8 | 67,868 | | | | 新日本建設 | 16.8 | 15.1 | 14,133 | | 東洋精糖 | 23 | 2 | 2,430 | | | | | |
| ホクト | 14.4 | 12.9 | 25,735 | | | | NIPPO | 33 | 29.4 | 69,854 | | 日本甜菜製糖 | 7.3 | 6.5 | 16,666 | | | | | |
| ホクリヨウ | 1.6 | 1.6 | 2,272 | | | | 東亜道路工業 | 27 | 2.6 | 10,517 | | 三井製糖 | 10 | 9 | 36,810 | | | | | |
| 鉱業 (0.3%) | | | | | | | 前田道路 | 44 | 40 | 92,040 | | 塩水港精糖 | 16.3 | 13.7 | 3,616 | | | | | |
| 住石ホールディングス | 39.8 | 33.7 | 5,122 | | | | 日本道路 | 42 | 3.4 | 19,788 | | 日新製糖 | 6 | 5.4 | 11,340 | | | | | |
| 日鉄鉱業 | 3.9 | 3.5 | 25,830 | | | | 東亜建設工業 | 11.4 | 10.3 | 28,891 | | 森永製菓 | 27.5 | 26.7 | 142,845 | | | | | |
| 三井鉱山産業 | 8.7 | 6.5 | 9,366 | | | | 若築建設 | 82 | 6.9 | 11,454 | | 中村屋 | 3.4 | 2.9 | 13,630 | | | | | |
| 国際石油開発帝石 | 740.9 | 617.8 | 834,030 | | | | 東洋建設 | 40.5 | 39.9 | 23,261 | | 山崎グリコ | 35.2 | 31.8 | 159,954 | | | | | |
| 日本海洋掘削 | 4.9 | 4.4 | 12,311 | | | | 五洋建設 | 156.2 | 151.1 | 117,102 | | 名糖産業 | 6.3 | 5.5 | 8,508 | | | | | |
| 石油資源開発 | 22.2 | 20.1 | 55,918 | | | | 大林道路 | 14.6 | - | - | | 井村屋グループ | - | 4.5 | 18,450 | | | | | |
| K&Oエナジーグループ | 9.5 | 7.5 | 12,780 | | | | 世紀東急工業 | 20.4 | 17.2 | 10,474 | | 不二家 | 81 | 7.3 | 17,541 | | | | | |
| 建設業 (3.1%) | | | | | | | 福田組 | 23 | 4.1 | 25,338 | | 山崎製パン | 103.1 | 93.1 | 194,020 | | | | | |
| ショーボンドホールディングス | 13.6 | 12 | 97,920 | | | | 住友林業 | 96.7 | 81.2 | 148,352 | | 第一屋製パン | 23 | 2 | 2,306 | | | | | |
| ミライト・ホールディングス | 43.3 | 39.1 | 62,520 | | | | 日本基礎技術 | 15.8 | 14.2 | 5,310 | | モロゾフ | 22 | 1.9 | 12,502 | | | | | |
| タマホーム | 10.8 | 9.6 | 10,608 | | | | 日成ビルド工業 | 42 | 18.8 | 24,364 | | 亀田製菓 | 7.9 | 7.1 | 35,571 | | | | | |
| サンヨーホームズ | 3.2 | 2.3 | 1,828 | | | | ヤマダ・エスバイエルホーム | 74 | 58 | 4,698 | | 寿スピリッツ | 10.1 | 11 | 62,040 | | | | | |
| ファーストコーポレーション | - | 4.3 | 6,308 | | | | BCコーポレーション | 17.6 | 15.9 | 8,824 | | カルビー | 57.4 | 51.8 | 181,559 | | | | | |
| ベステラ | - | 1.8 | 3,438 | | | | パナホーム | 53 | - | - | | 森永乳業 | 126 | 22.8 | 106,590 | | | | | |
| インバスターズクラウド | 1.3 | 11.2 | 17,651 | | | | 大和ハウス工業 | 415.4 | 375.3 | 1,504,202 | | 六甲バター | 6.3 | 5.7 | 15,070 | | | | | |
| ダイセイソリューション | 3.3 | 3 | 3,591 | | | | ライト工業 | 27.1 | 24.5 | 27,636 | | ヤクルト本社 | 75.5 | 68.1 | 563,187 | | | | | |
| 第一カッター興業 | - | 1.3 | 2,246 | | | | 積水ハウス | 442.4 | 413.3 | 779,897 | | 明治ホールディングス | 83.3 | 75.3 | 646,074 | | | | | |
| 安藤・間 | 101.1 | 97.8 | 81,858 | | | | 日特建設 | 12.2 | 10.9 | 6,997 | | 雪印メグミルク | 30.4 | 27.4 | 78,994 | | | | | |
| 東急建設 | 49.9 | 48.9 | 53,349 | | | | 北陸電気工事 | 6.9 | 7.1 | 7,802 | | プリマハム | 89 | 80 | 51,680 | | | | | |
| コムシスホールディングス | 55 | 44.7 | 124,310 | | | | ユアテック | 22 | 20 | 17,180 | | 日本ハム | 95 | 98 | 240,394 | | | | | |
| ミサワホーム | 16.6 | 10.6 | 9,169 | | | | 西部電気工業 | 2.4 | 2.1 | 5,882 | | 林業産業 | 4.7 | 4.1 | 3,390 | | | | | |
| ピーアールホールディングス | 13.2 | 12.6 | 5,657 | | | | 四電工 | 6 | 1.9 | 5,234 | | 丸大食品 | 68 | 61 | 29,280 | | | | | |
| 髙松コンストラクショングループ | 10.6 | 8.2 | 24,928 | | | | 中電工 | 17.7 | 16.4 | 49,134 | | S Foods | 7.6 | 8 | 35,560 | | | | | |
| 東建コーポレーション | 5.2 | 4.7 | 54,426 | | | | 関電工 | 56 | 50.6 | 59,050 | | 伊藤ハム株式会社ホールディングス | 81.3 | 73.3 | 66,922 | | | | | |
| ソネック | - | 1.6 | 1,227 | | | | きんでん | 93.6 | 84.5 | 145,762 | | サッポロホールディングス | 46.1 | 41.6 | 129,376 | | | | | |
| ヤマウラ | 6.9 | 6 | 5,412 | | | | 東京エネシス | 15 | 14.4 | 16,012 | | アサヒグループホールディングス | 263.9 | 238.4 | 1,263,520 | | | | | |
| 大成建設 | 715 | 126.5 | 642,620 | | | | トーエネック | 20 | 3.6 | 11,052 | | キリンホールディングス | 605.7 | 547 | 1,402,234 | | | | | |
| 大林組 | 421.8 | 381 | 465,201 | | | | 住友電設 | 9.7 | 10.1 | 22,533 | | 宝ホールディングス | 102 | 85.2 | 106,670 | | | | | |
| 清水建設 | 430 | 388.6 | 399,092 | | | | 日本電設工業 | 22.9 | 19.5 | 42,822 | | オエノンホールディングス | 37 | 32.5 | 13,162 | | | | | |
| 飛鳥建設 | 135.5 | 115.9 | 19,934 | | | | 協和エクシオ | 55.1 | 45.6 | 121,478 | | 養命酒製造 | 4.5 | 3.5 | 8,295 | | | | | |
| 長谷工コーポレーション | 164.1 | 148.3 | 239,356 | | | | 新日本空調 | 10.9 | 9.8 | 14,298 | | ココロ コーポレーションホールディングス | 47.7 | 79.9 | 294,431 | | | | | |
| 松井建設 | 15.5 | 14 | 11,816 | | | | ND S | 2.2 | 2 | 8,470 | | ココロ コーライストジャパン | 54.8 | - | - | | | | | |
| 銭高組 | 20 | 1.8 | 10,422 | | | | 九電工 | 27.3 | 25.1 | 120,480 | | サントリー食品インターナショナル | 96.4 | 87 | 435,000 | | | | | |
| 鹿島建設 | 618 | 558 | 550,188 | | | | 三機工業 | 31.2 | 26.9 | 30,908 | | ダイドールグループホールディングス | 6.5 | 5.8 | 37,352 | | | | | |
| 不動テトラ | 113.8 | 96.5 | 16,694 | | | | 日揮 | 131.2 | 109.4 | 236,741 | | 伊藤園 | 41.8 | 37.7 | 167,765 | | | | | |
| 大木建設 | 5.1 | 4.1 | 4,227 | | | | 中外炉工業 | 43 | 3.9 | 8,763 | | キーコーヒー | 12.5 | 11.2 | 23,587 | | | | | |
| 鉄建建設 | 85 | 7.7 | 23,485 | | | | ヤマト | 12.9 | 10.5 | 9,019 | | ユニカフェ | 4.2 | 3.5 | 3,944 | | | | | |
| 西松建設 | 162 | 29.3 | 82,655 | | | | 太平電業 | 19 | 8.6 | 23,330 | | ジャパンフーズ | 2.1 | 1.6 | 2,368 | | | | | |
| 三井住友建設 | 538.3 | 91.6 | 54,135 | | | | 高砂熟学工業 | 38.7 | 35 | 67,795 | | 日清オイリオグループ | 81 | 13.4 | 41,540 | | | | | |
| 大豊建設 | 51 | 46 | 24,702 | | | | 三晃金属工業 | 1.3 | 1.4 | 5,691 | | 不二製油グループ本社 | 37.6 | 30.8 | 93,478 | | | | | |
| 前田建設工業 | 87 | 90.6 | 126,296 | | | | 朝日工業社 | 3.2 | 2.6 | 7,930 | | かどや製油 | - | 1.2 | 8,496 | | | | | |
| 佐田建設 | 9.8 | 8.4 | 3,805 | | | | 明星工業 | 25.6 | 23 | 17,411 | | J-オイルミルズ | 6.6 | 5.9 | 22,036 | | | | | |
| ナカノフード建設 | 10.8 | 9.7 | 5,839 | | | | 大氣社 | 18.6 | 16.8 | 60,564 | | キッコーマン | 98 | 88.9 | 373,824 | | | | | |
| 奥村組 | 115 | 20.9 | 93,841 | | | | ダイダイン | 19 | 8.5 | 20,629 | | 味の素 | 289.8 | 261.7 | 514,633 | | | | | |
| 東鉄工業 | 16.9 | 15.3 | 48,654 | | | | 日比谷総合設備 | 15.7 | 14.2 | 28,073 | | キユーピー | 71.6 | 63.4 | 188,044 | | | | | |
| イチケン | 13 | 2.3 | 5,177 | | | | 東芝プラントシステム | 22.8 | 27.5 | 58,602 | | ハウス食品グループ本社 | 52.1 | 43.4 | 152,117 | | | | | |
| 浅沼組 | 45 | 45 | 16,740 | | | | OS JBホールディングス | 43.3 | 56.3 | 16,946 | | カゴメ | 50.6 | 45.6 | 165,300 | | | | | |
| 戸田建設 | 163 | 148 | 116,624 | | | | 東洋エンジニアリング | 83 | 15 | 18,345 | | 焼津水産化学工業 | 7 | 5.5 | 6,561 | | | | | |
| 熊谷組 | 221 | 19.9 | 57,371 | | | | 千代田化工建設 | 101 | 82.5 | 78,705 | | アリアケジャパン | 11.5 | 10.4 | 90,168 | | | | | |
| 青木あすなろ建設 | 9.2 | 8.3 | 8,125 | | | | 新興プランテック | 28.8 | 24.5 | 24,328 | | ビエトロ | 1.7 | 1.5 | 2,496 | | | | | |
| 北野建設 | 29 | 27 | 11,637 | | | | 食料品 (4.3%) | | | | | エバラ食品工業 | 3.6 | 2.5 | 5,270 | | | | | |
| 植木組 | 18 | 1.6 | 4,283 | | | | 日本製粉 | 41.9 | 37.7 | 59,113 | | ニチレイ | 69.3 | 54.2 | 139,673 | | | | | |
| 三井ホーム | 18 | 16 | 10,432 | | | | 日清製粉グループ本社 | 154.3 | 139.3 | 289,465 | | 東洋水産 | 69.2 | 62.4 | 262,392 | | | | | |
| | | | | | | | 日東富士製粉 | 0.8 | 0.8 | 3,756 | | イトアンド | 1.7 | 3.2 | 6,768 | | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|-------------------|---------|-------|-----------|----------------|---------|-------|-----------|-----------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| 大冷 | 千株 | 千株 | 千円 | 大川製紙所 | 千株 | 千株 | 千円 | 大倉工業 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | — | 1.3 | 2,804 | 大王製紙 | 21 | 18 | 5,292 | 積水化成成品工業 | 32 | 28 | 16,436 |
| 日清食品ホールディングス | — | 1.7 | 2,935 | 阿波製紙 | 52.5 | 47.3 | 68,159 | 群衆化学工業 | 18.2 | 14.9 | 16,702 |
| 永谷園ホールディングス | 55 | 49.6 | 375,472 | レンゴー | — | 2.9 | 1,908 | タイガースポリマー | 3.1 | 2.8 | 9,940 |
| 一正簿籍 | 7 | 12 | 17,136 | トーモク | 127 | 114.5 | 103,393 | ミライアル | 6.5 | 5.9 | 4,696 |
| フジッコ | 5 | 4.4 | 5,174 | ザ・パック | 42 | 6.8 | 14,552 | ダイキョーニシカフ | 5 | 3.9 | 7,441 |
| ロック・フィールド | 13.7 | 12.3 | 28,253 | 化学 (7.1%) | 9.3 | 8.4 | 29,274 | 竹本容器 | 2.2 | 4 | 5,628 |
| 日本たばこ産業 | 14.7 | 12.3 | 25,264 | クラレ | 221.2 | 199.9 | 376,611 | 森六ホールディングス | 23.1 | 23.4 | 38,469 |
| ケンコーマヨネーズ | 779.5 | 704.1 | 2,324,234 | 旭化成 | 820 | 740.7 | 985,871 | 日本化薬 | — | 1.3 | 3,013 |
| からや日洋ホールディングス | 5 | 7.5 | 28,800 | 共和レザー | 820 | 740.7 | 985,871 | カーリットホールディングス | — | 4.5 | 13,212 |
| なとり | 8.3 | 7.5 | 19,762 | 昭和電工 | 7.7 | 6.9 | 6,610 | 日本精化 | 85 | 77.1 | 108,402 |
| イフジ産業 | 7.2 | 6.4 | 12,550 | 住友化学 | 87.5 | 79.1 | 367,024 | 扶桑化学工業 | 12.3 | 11 | 12,122 |
| ビックスコーポレーション | — | 2 | 1,524 | 住友精化 | 968 | 874 | 609,178 | A D E K A | 11 | 9.9 | 11,394 |
| 北の達人コーポレーション | — | 1.7 | 2,966 | 日産化学工業 | 5.5 | 4.9 | 26,313 | 日油 | 9.4 | 8.4 | 24,166 |
| ユーグレナ | 3.1 | 10.9 | 28,034 | ラサ工業 | 72 | 69.1 | 279,509 | 新日本理化 | 56.5 | 51.1 | 95,454 |
| ミヨシ油脂 | 45.3 | 43.9 | 45,260 | フレハ | 51 | 4.2 | 9,727 | ハリマ化成グループ | 106 | 45.9 | 130,815 |
| 理研ビタミン | 50 | 4.4 | 6,142 | 多木化学 | 9.9 | 10.3 | 72,615 | 花王 | 21.6 | 18.9 | 4,725 |
| 繊維製品 (0.7%) | 4.2 | 4.3 | 17,565 | テイカ | 8 | 1.6 | 8,512 | 第一工業製薬 | 11.3 | 9.2 | 8,031 |
| 片倉工業 | 16.5 | 13.7 | 18,440 | 石原産業 | 20 | 9.1 | 26,299 | 日華化学 | 333.9 | 278.8 | 2,142,020 |
| グンゼ | 98 | 8.9 | 53,400 | 片倉コープアグリ | 23.6 | 21.3 | 39,724 | ニイタカ | 29 | 23 | 19,136 |
| 東洋紡 | 521 | 43.9 | 87,009 | 日東エフシー | 17 | 2.9 | 3,833 | ニイタカ | 4.1 | 3.8 | 4,202 |
| ユニチカ | 361 | 34.6 | 25,154 | 日本書達 | 7.7 | 6.9 | 5,409 | 三洋化成工業 | — | 1.7 | 2,874 |
| 富士紡ホールディングス | 6.4 | 6.6 | 27,522 | 東ソー | 79 | 82 | 51,988 | 有機化成薬品工業 | 8.2 | 7.5 | 40,425 |
| 倉敷紡績 | 132 | 120 | 40,200 | トクヤマ | 380 | 171.7 | 389,930 | 大日本塗料 | 9.4 | 8 | 2,328 |
| シギボウ | 72 | 6 | 7,710 | セントラル硝子 | 205 | 34.5 | 103,845 | 日本ペイントホールディングス | 75 | 13.6 | 21,828 |
| 日本毛織 | 37 | 33.4 | 37,374 | 東亜合成 | 134 | 24.2 | 56,991 | 関西ペイント | 101.5 | 91.7 | 331,954 |
| ダイトウボウ | 20 | 18.8 | 1,992 | 大阪ソーダ | 82.2 | 69.7 | 90,958 | 神東塗料 | 138.1 | 124.8 | 315,993 |
| トーア紡コーポレーション | 5.5 | 5.1 | 2,942 | 関東電化工業 | 57 | 10.7 | 28,911 | 中国塗料 | 10 | 9 | 2,295 |
| ガイドーリミテッド | 15 | 13.5 | 6,115 | デンカ | 27 | 28.4 | 33,568 | 日本特殊塗料 | 37.7 | 34.1 | 31,167 |
| 帝国繊維 | 13.8 | 12.4 | 26,015 | 信越化学工業 | 272 | 43.6 | 174,182 | 藤倉化成 | 9.2 | 7.5 | 15,315 |
| 帝人 | 107.4 | 97 | 214,758 | 日本カーバイド工業 | 235.8 | 197.8 | 2,282,612 | 太陽ホールディングス | 17.9 | 15 | 9,990 |
| 東レ | 95.4 | 861.5 | 869,253 | 堺化学工業 | 45 | 3.8 | 7,125 | D I C | 10.7 | 9.1 | 45,090 |
| サカイオーベックス | 3.3 | 3.1 | 7,393 | エア・ウオーター | 49 | 8.1 | 22,177 | サカダイククス | 51.9 | 46.9 | 185,958 |
| 住江織物 | 33 | 3 | 8,805 | 大陽日酸 | 108.4 | 97.9 | 209,310 | ライオン | 26.8 | 24.2 | 43,342 |
| 日本フェルト | 7.9 | 6.4 | 3,315 | 日本化学工業 | 101.3 | 91.5 | 143,014 | ライオン | 130 | 117 | 73,125 |
| イチカフ | 9 | 8 | 2,960 | 東邦アセチレン | 49 | 4.4 | 10,480 | T & K T O K A | 9.5 | 7.9 | 11,060 |
| 日東製網 | 1.5 | 1.3 | 2,281 | 日本パーカライズン | — | 1.7 | 2,555 | 富士フイルムホールディングス | 260.7 | 235.5 | 1,070,818 |
| アツギ | 108 | 7.9 | 9,511 | 高圧ガス工業 | 67.1 | 60.7 | 117,818 | 資生堂 | 249.5 | 211.2 | 1,159,065 |
| ダイニツク | 26 | 4.6 | 4,857 | チタン工業 | 19.5 | 17.6 | 15,171 | 高砂香料工業 | 163 | 158 | 314,894 |
| サーレン | 32.8 | 27.3 | 55,992 | 四国化成工業 | 16 | 1.3 | 3,650 | マンダム | 8.6 | 7.1 | 22,684 |
| ソトー | 5 | 4.4 | 4,875 | 戸田工業 | 19 | 17.1 | 27,342 | ミルボン | 13.2 | 22.1 | 82,101 |
| 東海染工 | 19 | 1.7 | 2,609 | ステラ ケミファ | 26 | 2.4 | 9,744 | ファンケル | 7.1 | 15.2 | 52,592 |
| 小松精練 | 18.6 | 18.2 | 15,979 | 保土谷化学工業 | 6.2 | 6.1 | 20,496 | コーセー | 28 | 27.5 | 90,750 |
| ワコールホールディングス | 78 | 32.8 | 103,156 | 日本触媒 | 4.6 | 3.9 | 19,402 | コタ | 21.3 | 19.2 | 36,416 |
| ホギメディカル | 8.3 | 7.5 | 59,775 | 大日精化工業 | 20.7 | 18.7 | 136,323 | シーズ・ホールディングス | 5 | 4.9 | 9,187 |
| レナウン | 35.7 | 32.3 | 5,555 | カネカ | 54 | 9.2 | 43,194 | シーボン | 17.1 | 15.4 | 85,008 |
| クラウディアホールディングス | 3.4 | 2.9 | 1,618 | 三菱瓦斯化学 | 177 | 160 | 149,440 | ボーラ・オルビホールディングス | 1.6 | 1.4 | 4,655 |
| T S Iホールディングス | 54.1 | 44.8 | 33,600 | 三井化学 | 122.5 | 97.9 | 270,693 | ノビアホールディングス | 13.4 | 48.4 | 200,134 |
| マツオカコーポレーション | — | 2.1 | 9,198 | J S R | 597 | 108 | 338,040 | アジュバンコスメジャパン | 8.3 | 7.2 | 56,592 |
| 三陽商会 | 69 | 6.2 | 12,623 | 東京応化工業 | 132.1 | 119.4 | 286,321 | エステー | 2.8 | 2.6 | 2,698 |
| ナイガイ | 49 | 4.4 | 2,371 | 大阪有機化学工業 | 24.6 | 20.6 | 94,451 | アグロ カネショウ | 9.1 | 8.1 | 17,998 |
| オンワードホールディングス | 85 | 70.9 | 66,433 | 三菱ケミカルホールディングス | 8.7 | 7.7 | 11,958 | コニシ | 5.2 | 4.6 | 9,853 |
| ルックホールディングス | 24 | 20 | 7,060 | K Hネオケム | 885.6 | 795.4 | 865,395 | 長谷川香料 | 20.6 | 18.6 | 34,447 |
| キムラタン | 566 | 55.5 | 2,497 | ダイセル | 16.1 | 18.2 | 54,418 | 星光PMC | 16.6 | 15 | 33,000 |
| ゴールドウイン | 5.6 | 3.4 | 42,636 | 住友ベークライト | 177.3 | 160.2 | 195,764 | 小林製薬 | 7.2 | 6.5 | 7,163 |
| デサント | 30 | 27.1 | 43,739 | 積水化学工業 | 116 | 96 | 82,752 | 荒川化学工業 | 36.5 | 31.8 | 218,784 |
| キング | 6.6 | 5.8 | 3,851 | 日本ゼオン | 298.4 | 246.7 | 478,104 | メック | 11.3 | 10.2 | 19,859 |
| ヤマトインターナショナル | 8.3 | 8.1 | 3,750 | アイカ工業 | 111 | 100.2 | 155,811 | 日本高純度化学 | 10.2 | 7.8 | 15,927 |
| パルプ・紙 (0.3%) | | | | 宇部興産 | 42.1 | 33.3 | 131,368 | タカラバイオ | 3.8 | 3.1 | 7,870 |
| 特種東海製紙 | 7.7 | 6.5 | 26,747 | 積水樹脂 | 662 | 59.8 | 201,526 | J C U | 28.2 | 29.7 | 51,381 |
| 王子ホールディングス | 514 | 500 | 351,000 | タキロンシーアイ | 20.3 | 18.3 | 43,901 | 新田ゼラチン | 4.1 | 7 | 32,830 |
| 日本製紙 | 58.9 | 53.2 | 111,773 | 旭有機材 | 28 | 24 | 17,472 | O A T アグリオ | 8.2 | 7.8 | 6,123 |
| 三菱製紙 | 18.9 | 16.9 | 11,508 | 日立化成 | 42 | 7 | 14,189 | デクセラリアルズ | 1.6 | 1.6 | 4,116 |
| 北越紀州製紙 | 73.5 | 66.3 | 44,023 | ニチパン | 73.1 | 58.7 | 144,871 | アース製薬 | 34.4 | 29 | 39,614 |
| 中越パルプ工業 | 52 | 4.7 | 8,751 | リケンテクノス | 13 | 5.8 | 16,785 | イハラケミカル工業 | 9.5 | 8.5 | 46,325 |

| 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 |
| | | 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 |
| 北興化学工業 | | 13 | 8,026 | | 11.7 | 5.4 | ビーピー・カストロール | | 5.4 | 4.9 | 8,918 | | 丸一鋼管 | | 43.9 | 39.7 | 129,025 | | 39.7 | 129,025 | |
| 大成ラミック | | 3.8 | 10,902 | | 3.5 | 30.6 | 富士石油 | | 30.6 | 27.6 | 13,744 | | モリ工業 | | 4.2 | 3.7 | 13,986 | | 4.2 | 13,986 | |
| クマイイ化学工業 | | 27.2 | 33,694 | | 51.6 | 4.5 | MORE S CO | | 4.5 | 4.1 | 8,040 | | 大岡特殊鋼 | | 220 | 19.9 | 117,410 | | 220 | 19.9 | |
| 日本農薬 | | 30 | 17,760 | | 29.6 | 62.4 | 出光興産 | | 62.4 | 95.2 | 371,756 | | 日本高周波鋼業 | | 46 | 4.2 | 3,427 | | 46 | 4.2 | |
| アキレス | | 10.7 | 19,135 | | 8.6 | 1,458.2 | JXTGホールディングス | | 1,458.2 | 1,809.7 | 1,243,082 | | 日本冶金工業 | | 108.8 | 92.8 | 30,438 | | 108.8 | 92.8 | |
| 有次製作所 | | 22 | 19,627 | | 19 | 39.7 | コスモエネルギーホールディングス | | 39.7 | 32.8 | 134,152 | | 山陽特殊製鋼 | | 78 | 12.9 | 32,379 | | 78 | 12.9 | |
| 日東電工 | | 94.8 | 740,012 | | 85.6 | | ゴム製品 (1.0%) | | | | | | 愛知製鋼 | | 7.7 | 6.3 | 29,799 | | 7.7 | 6.3 | |
| レック | | 4.1 | 20,368 | | 6.7 | 79.3 | 横浜ゴム | | 79.3 | 65.6 | 170,691 | | 日立金属 | | 133.7 | 120.8 | 172,985 | | 133.7 | 120.8 | |
| きもと | | 23.4 | 7,740 | | 19.4 | 69.4 | 東洋ゴム工業 | | 69.4 | 67.2 | 145,622 | | 日本金属 | | 3.2 | 2.8 | 8,150 | | 3.2 | 2.8 | |
| 藤森工業 | | 9.8 | 35,910 | | 9.5 | 443.6 | ブリヂストン | | 443.6 | 400.8 | 1,978,348 | | 大平洋金属 | | 84 | 6.9 | 23,770 | | 84 | 6.9 | |
| 前澤化成工業 | | 8.7 | 9,126 | | 7.8 | 123 | 住友ゴム工業 | | 123 | 116.7 | 237,484 | | 新日本電工 | | 74.4 | 67.2 | 31,785 | | 74.4 | 67.2 | |
| J S P | | 6.1 | 20,757 | | 6.6 | 11.1 | 藤倉ゴム工業 | | 11.1 | 9.9 | 8,009 | | 栗本鐵工所 | | 6.3 | 5.7 | 12,659 | | 6.3 | 5.7 | |
| エフピコ | | 11.7 | 55,521 | | 9.3 | 40 | オカモト | | 40 | 39 | 44,304 | | 虹 技 | | 19 | 1.7 | 3,486 | | 19 | 1.7 | |
| 天馬 | | 8.7 | 19,395 | | 8.8 | 5.3 | フコク | | 5.3 | 5 | 5,230 | | 日本鉄鋼管 | | 14 | 12 | 2,016 | | 14 | 12 | |
| 信越ポリマー | | 25.8 | 29,078 | | 23.3 | 11.8 | ニッタ | | 11.8 | 11.7 | 48,379 | | 三菱製鋼 | | 91 | 8.3 | 22,011 | | 91 | 8.3 | |
| 東リ | | 31.5 | 10,659 | | 28.2 | 24.3 | 住友理工 | | 24.3 | 22 | 23,562 | | 日田鋼業 | | 18.4 | 16.5 | 5,758 | | 18.4 | 16.5 | |
| ニフコ | | 23 | 156,000 | | 20.8 | 32 | 三ツ星ベルト | | 32 | 28 | 37,268 | | 日本精線 | | 9 | 1.8 | 8,514 | | 9 | 1.8 | |
| 日本バルカー工業 | | 10.1 | 28,382 | | 9.2 | 23.8 | バンドー化学 | | 23.8 | 21.6 | 25,682 | | シンニッター | | 10.8 | 8.7 | 7,099 | | 10.8 | 8.7 | |
| ユニ・チャーム | | 266.2 | 690,789 | | 240.4 | | ガス・土石製品 (1.0%) | | | | | | 新家工業 | | 29 | 2.6 | 6,505 | | 29 | 2.6 | |
| 医薬品 (4.5%) | | | | | | | 日本紡績 | | 106 | 16.9 | 43,940 | | 非鉄金属 (1.0%) | | | | | | | | |
| 協和発酵キリン | | 157.3 | 286,757 | | 142.1 | 647 | 旭硝子 | | 647 | 115.9 | 507,062 | | 大紀アルミニウム工業所 | | 22 | 18.5 | 14,744 | | 22 | 18.5 | |
| 武田薬品工業 | | 492.9 | 2,517,895 | | 417.7 | 59.9 | 日本板硝子 | | 59.9 | 57.3 | 48,017 | | 日本軽金属ホールディングス | | 320.3 | 327.4 | 96,255 | | 320.3 | 327.4 | |
| アステラス製薬 | | 1,343.1 | 1,707,311 | | 1,165.4 | 19 | 石塚硝子 | | 19 | 1.5 | 3,888 | | 三井金属鉱業 | | 357 | 30.3 | 171,801 | | 357 | 30.3 | |
| 大日本住友製薬 | | 93.1 | 126,402 | | 84.1 | 52 | 日本山村硝子 | | 52 | 47 | 8,460 | | 東邦亜鉛 | | 74 | 6.2 | 38,006 | | 74 | 6.2 | |
| 塩野義製薬 | | 177.9 | 110,590 | | 162.2 | 27.1 | 日本電気硝子 | | 27.1 | 49 | 175,420 | | 三菱マテリアル | | 82 | 74.1 | 278,245 | | 82 | 74.1 | |
| 田辺三菱製薬 | | 153.2 | 306,832 | | 138.4 | 5.2 | オハラ | | 5.2 | 4.5 | 14,062 | | 住友金属鉱山 | | 340 | 143.3 | 687,410 | | 340 | 143.3 | |
| わかもと製薬 | | 7 | 3,794 | | 14 | 244 | 住友大阪セメント | | 244 | 220 | 110,000 | | DOWAホールディングス | | 145 | 28.4 | 120,700 | | 145 | 28.4 | |
| あすか製薬 | | 14.3 | 26,393 | | 12.9 | 793 | 太平洋セメント | | 793 | 71.6 | 303,226 | | 古河機械金属 | | 205 | 18.5 | 41,995 | | 205 | 18.5 | |
| 日本新薬 | | 30.1 | 198,693 | | 29.7 | 12.7 | 日本ヒューム | | 12.7 | 11.4 | 9,165 | | エス・サイエンス | | 65.1 | 53.4 | 4,165 | | 65.1 | 53.4 | |
| ピオフェルミン製薬 | | 2.2 | 5,359 | | 1.9 | 29.5 | 日本コンクリート工業 | | 29.5 | 24.5 | 11,196 | | 大塚チタニウムテクノロジーズ | | 14.4 | 11.7 | 32,701 | | 14.4 | 11.7 | |
| 中外製薬 | | 130.9 | 621,732 | | 118.2 | 6.6 | 三谷セキサン | | 6.6 | 5.9 | 13,280 | | 東邦チタニウム | | 22.2 | 20.1 | 31,717 | | 22.2 | 20.1 | |
| 科研製薬 | | 24.5 | 114,595 | | 20.5 | 16.3 | アジアビルホールディングス | | 16.3 | 14.7 | 9,422 | | U A C J | | 16.7 | 17 | 43,877 | | 16.7 | 17 | |
| イーザイ | | 161.8 | 827,091 | | 135.7 | 122.8 | 東海カーボン | | 122.8 | 103 | 150,689 | | 古河電気工業 | | 44.1 | 37.3 | 208,134 | | 44.1 | 37.3 | |
| ロート製薬 | | 64.4 | 172,820 | | 62.3 | 65 | 日本カーボン | | 65 | 5.8 | 27,202 | | 住友電気工業 | | 495 | 419.2 | 712,011 | | 495 | 419.2 | |
| 小野薬品工業 | | 298.6 | 755,731 | | 267.8 | 7.3 | 東洋炭素 | | 7.3 | 7.4 | 25,049 | | フジクラ | | 172.9 | 135.4 | 113,736 | | 172.9 | 135.4 | |
| 久光製薬 | | 37.1 | 246,560 | | 33.5 | 7.4 | ノリタケカンパニーリミテド | | 7.4 | 6.7 | 36,716 | | 昭和電線ホールディングス | | 157 | 14.1 | 13,536 | | 157 | 14.1 | |
| 持田製薬 | | 9 | 62,568 | | 7.9 | 96.6 | TOTO | | 96.6 | 87.2 | 467,392 | | 東京特殊電線 | | 1.9 | 1.4 | 4,228 | | 1.9 | 1.4 | |
| 参天製薬 | | 237.3 | 361,984 | | 214.7 | 165.9 | 日本硝子 | | 165.9 | 138.4 | 278,460 | | タツタ電線 | | 24.7 | 22.3 | 16,412 | | 24.7 | 22.3 | |
| 扶桑薬品工業 | | 4.5 | 10,876 | | 4 | 113.3 | 日本特殊陶業 | | 113.3 | 97.3 | 260,958 | | 沖電線 | | 14 | - | - | | 14 | - | |
| 日本ケミファ | | 1.8 | 6,840 | | 1.5 | 11 | ダントホールディングス | | 11 | 9 | 1,251 | | カナレ電気 | | 1.9 | 1.9 | 4,398 | | 1.9 | 1.9 | |
| ツムラ | | 44.1 | 144,585 | | 40.5 | 4.8 | MA R U W A | | 4.8 | 3.9 | 36,153 | | 平河ヒューテック | | 6.2 | 5.6 | 6,378 | | 6.2 | 5.6 | |
| 日医工 | | 30.7 | 50,321 | | 29.9 | 33 | 品川リフラクトリーズ | | 33 | 3 | 9,555 | | リョービ | | 80 | 13.8 | 40,254 | | 80 | 13.8 | |
| キッセイ薬品工業 | | 23.3 | 60,270 | | 21 | 28 | 黒崎播磨 | | 28 | 2.2 | 11,836 | | アーレスティ | | 15.2 | 13.8 | 11,605 | | 15.2 | 13.8 | |
| 生化学工業 | | 24.4 | 36,652 | | 22 | 7 | ヨータイ | | 7 | 6.8 | 3,916 | | Aサヒホールディングス | | 19.8 | 18.8 | 37,600 | | 19.8 | 18.8 | |
| 栄研化学 | | 11 | 44,528 | | 9.2 | 6.8 | イソライト工業 | | 6.8 | 5.8 | 6,554 | | 金属製品 (0.7%) | | | | | | | | |
| 日本製薬 | | 5.3 | 6,648 | | 4.8 | 16 | 東京薬業 | | 16 | 14.5 | 5,829 | | 稲葉製作所 | | 7.1 | 6.3 | 8,492 | | 7.1 | 6.3 | |
| 鳥居薬品 | | 9 | 19,035 | | 7.1 | 4.8 | ニッカトー | | 4.8 | 3.9 | 3,591 | | 宮城エンジニアリンググループ | | 38 | 3.2 | 7,744 | | 38 | 3.2 | |
| J C R ファーマ | | 10.1 | 41,200 | | 8 | 11.2 | ファミコンポレテッド | | 11.2 | 10.1 | 26,169 | | トーカコ | | 8.6 | 7.8 | 43,446 | | 8.6 | 7.8 | |
| 東和薬品 | | 6 | 34,236 | | 5.4 | 28 | エーアンドエーマテリアル | | 28 | 2.5 | 3,180 | | アルファ | | 4.5 | 4 | 7,808 | | 4.5 | 4 | |
| 富士製薬工業 | | 4.3 | 14,878 | | 3.9 | 69 | ニチアス | | 69 | 62 | 80,166 | | SUMCO | | 137.2 | 103.3 | 293,165 | | 137.2 | 103.3 | |
| 沢井製薬 | | 22.3 | 108,300 | | 22.8 | 17.5 | ニチハ | | 17.5 | 17.1 | 68,913 | | 川田テクノロジーズ | | 2.5 | 2.3 | 12,995 | | 2.5 | 2.3 | |
| ゼリア新薬工業 | | 26.9 | 52,026 | | 24.3 | | 鉄鋼 (1.2%) | | | | | | RS Technologies | | - | 1.6 | 10,304 | | - | 1.6 | |
| 第一三共 | | 386.9 | 1,308,384 | | 324.5 | 592.6 | 新日鐵住金 | | 592.6 | 501.8 | 1,329,017 | | 群興グループホールディングス | | 93 | 76.6 | 124,398 | | 93 | 76.6 | |
| キョーリン製薬ホールディングス | | 32.1 | 66,379 | | 31.7 | 227.1 | 神戸製鋼所 | | 227.1 | 205.3 | 227,472 | | ホクサンホールディングス | | 34 | 28 | 11,844 | | 34 | 28 | |
| 大幸薬品 | | 6.6 | 13,926 | | 6 | 14.7 | 中山製鋼所 | | 14.7 | 15.5 | 11,268 | | コロナ | | 6.9 | 6.2 | 8,289 | | 6.9 | 6.2 | |
| ダイト | | 7.4 | 23,892 | | 6.6 | 7.3 | 合同製鐵 | | 7.3 | 6.1 | 12,285 | | 横河ブリッジホールディングス | | 23.1 | 20.9 | 51,894 | | 23.1 | 20.9 | |
| 大塚ホールディングス | | 282.7 | 1,083,041 | | 235.7 | 359.2 | ジェイ・エーイーホールディングス | | 359.2 | 302.8 | 763,056 | | 駒井ハルテック | | 2.5 | 2.5 | 6,277 | | 2.5 | 2.5 | |
| 大正製薬ホールディングス | | 28.1 | 237,744 | | 25.4 | 59.9 | 日新製鐵 | | 59.9 | 30.9 | 48,080 | | 高田機工 | | 12 | 1 | 3,980 | | 12 | 1 | |
| ペパチドリーム | | 24.6 | 215,392 | | 50.8 | 66.5 | 東京製鐵 | | 66.5 | 60.1 | 54,090 | | 三和ホールディングス | | 130.4 | 107.5 | 154,155 | | 130.4 | 107.5 | |
| 石油・石化製品 (0.7%) | | | | | | | 共英製鐵 | | 14 | 12.6 | 25,464 | | 文化シヤッター | | 36.6 | 33 | 33,990 | | 36.6 | 33 | |
| 日本コークス工業 | | 107 | 10,667 | | 96.1 | 26.4 | 大和工業 | | 26.4 | 23.8 | 73,185 | | 三協立山 | | 17.2 | 15.5 | 23,234 | | 17.2 | 15.5 | |
| 昭和シェル石油 | | 117.5 | 159,680 | | 106.1 | 27 | 東京製鐵 | | 27 | 4.6 | 7,925 | | アルインコ | | 9.1 | 8.2 | 9,692 | | 9.1 | 8.2 | |
| ニチレキ | | 16.1 | 19,517 | | 14.5 | 8.2 | 大阪製鐵 | | 8.2 | 7.4 | 14,814 | | 東洋シヤッター | | 3.4 | 2.9 | 1,754 | | 3.4 | 2.9 | |
| 東燃ゼネラル石油 | | 21.4 | - | | - | 18.1 | 淀川製鋼所 | | 18.1 | 16.4 | 51,168 | | L I X I L グループ | | | | | | | | |

| 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 | | | | | | | | | | | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | | | | | | | | | | | | |
| ノーリツ | 25.7 | 25 | 51,300 | ユニオンツール | 5.7 | 5.1 | 19,941 | 蛇の目マシン工業 | 12.2 | 10.3 | 7,889 | マックス | 19 | 17.4 | 25,438 | 長府製作所 | 14 | 12.6 | 30,996 | オイレス工業 | 16.9 | 14.5 | 31,146 | グロリー | 40.1 | 33.8 | 138,918 | | | | |
| リンナイ | 22.4 | 20 | 196,600 | 日精工 | 4.2 | 3.8 | 24,624 | セガミーホールディングス | 124.5 | 112.5 | 166,387 | サトーホールディングス | 16.3 | 14.8 | 50,320 | 新晃工業 | 8.8 | 11.5 | 22,310 | サトウホールディングス | 16.9 | 14.5 | 31,146 | 新晃工業 | 8.8 | 11.5 | 22,310 | 大和冷機工業 | 20.1 | 18.2 | 24,169 |
| ダイニチ工業 | 7 | 6 | 5,094 | 技研製作所 | — | 5.7 | 15,897 | 日本エアージェット | 4.4 | 3.9 | 3,646 | 日精工業 | — | 5.7 | 15,897 | 日本精工 | 257.8 | 232.9 | 382,654 | 日精工業 | 4.2 | 3.8 | 24,624 | 日本精工 | 257.8 | 232.9 | 382,654 | 日本ビストンリング | 4.9 | 4.1 | 8,938 |
| 日東精工 | 19 | 15.5 | 9,145 | 住友重機械工業 | 383 | 64.9 | 293,348 | 日精工 | 4 | 3.1 | 7,402 | 東洋工業 | 10.2 | 9.2 | 14,241 | 日本精工 | 257.8 | 232.9 | 382,654 | 日精工 | 4 | 3.1 | 7,402 | 日本精工 | 257.8 | 232.9 | 382,654 | 日本精工 | 257.8 | 232.9 | 382,654 |
| 三洋工業 | 17 | 1.4 | 2,881 | 日立建機 | 58.7 | 53 | 235,850 | 日立建機 | 4 | 3.1 | 7,402 | NTN | 290 | 262.4 | 129,100 | NTN | 290 | 262.4 | 129,100 | 日立建機 | 58.7 | 53 | 235,850 | 日立建機 | 4 | 3.1 | 7,402 | 日立建機 | 58.7 | 53 | 235,850 |
| 岡部 | 27.3 | 22.7 | 24,220 | 日工 | 4 | 3.1 | 7,402 | 日工 | 4 | 3.1 | 7,402 | ジェイテクト | 133.7 | 120.8 | 210,192 | ジェイテクト | 133.7 | 120.8 | 210,192 | 日工 | 4 | 3.1 | 7,402 | 日工 | 4 | 3.1 | 7,402 | 日工 | 4 | 3.1 | 7,402 |
| ジーテクト | 13.7 | 12.4 | 25,866 | 巴工業 | 5.4 | 4.8 | 9,321 | TOWA | 10.8 | 8.8 | 17,670 | ホンザキ | 126 | 105 | 72,450 | ホンザキ | 126 | 105 | 72,450 | 日工 | 4 | 3.1 | 7,402 | 日工 | 4 | 3.1 | 7,402 | 日工 | 4 | 3.1 | 7,402 |
| 中国工業 | 2.3 | 1.7 | 1,361 | 井関農機 | 134 | 11.3 | 28,589 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 大豊工業 | 10.2 | 9.2 | 14,241 | 大豊工業 | 10.2 | 9.2 | 14,241 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 東プレ | 25.3 | 20.9 | 65,521 | TOWA | 10.8 | 8.8 | 17,670 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 日本トムソン | 40.1 | 36.3 | 27,914 | 日本トムソン | 40.1 | 36.3 | 27,914 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 高周波熱錬 | 24.4 | 21.6 | 23,133 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | THK | 88.7 | 70.7 | 295,879 | THK | 88.7 | 70.7 | 295,879 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 東京製鋼 | 8.9 | 8.1 | 14,369 | 北川鉄工所 | 6 | 5.4 | 15,379 | 北川鉄工所 | 6 | 5.4 | 15,379 | ユージン精機 | 5.6 | 5 | 18,075 | ユージン精機 | 5.6 | 5 | 18,075 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| サンコール | 7.1 | 6.3 | 4,762 | ローツェ | 4.7 | 5.6 | 13,440 | ローツェ | 4.7 | 5.6 | 13,440 | 前澤給装工業 | 4.8 | 4.4 | 7,946 | 前澤給装工業 | 4.8 | 4.4 | 7,946 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| モリテックスチール | 7.2 | 6.6 | 6,256 | タカキタ | 3.6 | 3.6 | 3,024 | タカキタ | 3.6 | 3.6 | 3,024 | イーグル工業 | 13.6 | 14 | 27,734 | イーグル工業 | 13.6 | 14 | 27,734 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| パイオラックス | 6.6 | 16.6 | 50,381 | フコタ | 628.7 | 608.2 | 1,248,026 | フコタ | 628.7 | 608.2 | 1,248,026 | 前澤工業 | 9.3 | 7.8 | 3,151 | 前澤工業 | 9.3 | 7.8 | 3,151 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| エイチワン | — | 8.3 | 11,578 | 荏原実業 | 3.7 | 3.3 | 6,217 | 荏原実業 | 3.7 | 3.3 | 6,217 | 日本ピラー工業 | 12.7 | 11.5 | 21,562 | 日本ピラー工業 | 12.7 | 11.5 | 21,562 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 日本発条 | 123.5 | 111.7 | 120,300 | 三菱化工機 | 43 | 3.9 | 8,712 | 三菱化工機 | 43 | 3.9 | 8,712 | キッツ | 60.1 | 50.5 | 43,480 | キッツ | 60.1 | 50.5 | 43,480 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 中央発条 | 15 | 1.3 | 4,699 | 月島機械 | 24.9 | 22.5 | 28,620 | 月島機械 | 24.9 | 22.5 | 28,620 | 日立工機 | 33.6 | — | — | 日立工機 | 33.6 | — | — | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| アドバネクス | 2.3 | 1.8 | 7,110 | 帝国電機製作所 | 9.6 | 7.9 | 10,751 | 帝国電機製作所 | 9.6 | 7.9 | 10,751 | マキタ | 81.8 | 147.9 | 740,979 | マキタ | 81.8 | 147.9 | 740,979 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 立川ブラインド工業 | 5.5 | 5 | 6,640 | 東京機械製作所 | 50 | 4.5 | 2,484 | 東京機械製作所 | 50 | 4.5 | 2,484 | 日立造船 | 99.3 | 89.9 | 49,714 | 日立造船 | 99.3 | 89.9 | 49,714 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 三益半導体工業 | 9.7 | 8.7 | 17,478 | 新東工業 | 29.7 | 26.9 | 34,324 | 新東工業 | 29.7 | 26.9 | 34,324 | 三菱重工 | 2,103 | 190 | 790,210 | 三菱重工 | 2,103 | 190 | 790,210 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 機械 (5.7%) | | | | アイチコーポレーション | 18.6 | 19.6 | 13,739 | アイチコーポレーション | 18.6 | 19.6 | 13,739 | HI | 965 | 87.1 | 310,511 | HI | 965 | 87.1 | 310,511 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 日本ドライケミカル | 1.7 | 1.5 | 3,750 | 小森コーポレーション | 31.5 | 28.5 | 39,900 | 小森コーポレーション | 31.5 | 28.5 | 39,900 | スター精密 | 22 | 18.2 | 38,311 | スター精密 | 22 | 18.2 | 38,311 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 日本製鋼所 | 43.4 | 36.6 | 115,290 | 鶴見製作所 | 9.8 | 9.5 | 17,774 | 鶴見製作所 | 9.8 | 9.5 | 17,774 | 電気機器 (13.9%) | | | | 電気機器 (13.9%) | | | | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 三浦工業 | 53.7 | 48.5 | 142,541 | 住友精密工業 | 21 | 19 | 7,448 | 住友精密工業 | 21 | 19 | 7,448 | 日清紡ホールディングス | 69.6 | 69.3 | 99,722 | 日清紡ホールディングス | 69.6 | 69.3 | 99,722 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| タクマ | 42.1 | 38 | 51,832 | 酒井重工業 | 25 | 2.1 | 9,334 | 酒井重工業 | 25 | 2.1 | 9,334 | イビデン | 87.8 | 69.4 | 115,620 | イビデン | 87.8 | 69.4 | 115,620 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| ツガミ | 35 | 30 | 46,620 | 荏原製作所 | 59.5 | 46.6 | 187,798 | 荏原製作所 | 59.5 | 46.6 | 187,798 | コニカミノルタ | 293.8 | 265.4 | 259,561 | コニカミノルタ | 293.8 | 265.4 | 259,561 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| オーコム | 85 | 13.1 | 88,818 | 石井鐵工所 | 2 | 1.8 | 3,443 | 石井鐵工所 | 2 | 1.8 | 3,443 | ブラザー工業 | 162.3 | 138.5 | 356,083 | ブラザー工業 | 162.3 | 138.5 | 356,083 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 東芝機械 | 78 | 63 | 50,652 | 西島製作所 | 12.9 | 11.6 | 12,029 | 西島製作所 | 12.9 | 11.6 | 12,029 | ミネベアミツミ | 228.345 | 210.5 | 482,045 | ミネベアミツミ | 228.345 | 210.5 | 482,045 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| アマダホールディングス | 176.7 | 173 | 257,943 | 北越工業 | 14.1 | 12.8 | 15,232 | 北越工業 | 14.1 | 12.8 | 15,232 | 日立製作所 | 3,014 | 2,723 | 2,212,437 | 日立製作所 | 3,014 | 2,723 | 2,212,437 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| アイデンジエナリング | 37.3 | 28.5 | 41,154 | ダイキン工業 | 171.4 | 154.8 | 1,891,656 | ダイキン工業 | 171.4 | 154.8 | 1,891,656 | 東芝 | 2,808 | — | — | 東芝 | 2,808 | — | — | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 滝澤鉄工所 | 39 | 3.5 | 7,567 | オルガノ | 25 | 4.1 | 13,817 | オルガノ | 25 | 4.1 | 13,817 | 三菱電機 | 1,338.9 | 1,133.9 | 2,114,723 | 三菱電機 | 1,338.9 | 1,133.9 | 2,114,723 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 富士機械製造 | 40 | 33.6 | 70,660 | トーヨーカネツ | 60 | 4.8 | 19,032 | トーヨーカネツ | 60 | 4.8 | 19,032 | 富士電機 | 378 | 342 | 275,310 | 富士電機 | 378 | 342 | 275,310 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 牧野フライス製作所 | 65 | 56 | 62,608 | 栗田工業 | 74.3 | 61.4 | 199,243 | 栗田工業 | 74.3 | 61.4 | 199,243 | 東洋電機製造 | 5 | 4.5 | 7,515 | 東洋電機製造 | 5 | 4.5 | 7,515 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| オーエスジー | 59.8 | 51.7 | 127,647 | 樫本チエイン | 75 | 67 | 57,553 | 樫本チエイン | 75 | 67 | 57,553 | 安川電機 | 145.5 | 131.4 | 662,256 | 安川電機 | 145.5 | 131.4 | 662,256 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| ダイジェット工業 | 17 | 1.4 | 2,940 | 大同工業 | 26 | 4.3 | 6,561 | 大同工業 | 26 | 4.3 | 6,561 | シフオニアテクノロジー | 81 | 73 | 26,791 | シフオニアテクノロジー | 81 | 73 | 26,791 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 37.6 | 33.3 | 39,393 | 木村化工機 | 11.5 | 9.6 | 4,780 | 木村化工機 | 11.5 | 9.6 | 4,780 | 明電舎 | 115 | 96 | 38,496 | 明電舎 | 115 | 96 | 38,496 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| DMG森精機 | 77.7 | 62.1 | 137,489 | アネスト岩田 | 22.8 | 19.1 | 22,385 | アネスト岩田 | 22.8 | 19.1 | 22,385 | オリジーン電気 | 18 | 3.3 | 5,326 | オリジーン電気 | 18 | 3.3 | 5,326 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 | 丸山製作所 | 28 | 2.5 | 4,820 |
| ソディック | 33.3 | 2 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 銘柄 | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 銘柄 | 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 | 千円 | | 千株 | 千株 | 千円 | |
| I D E C | 16.4 | 14 | 39,326 | 日本光電工業 | 52.5 | 47.4 | 137,744 | ユニプレス | 24.2 | 21.9 | 58,254 | 豊田自動織機 | 114.3 | 91.8 | 636,174 |
| 不二電機工業 | 1.4 | 1.3 | 1,716 | チノー | 4.6 | 3.9 | 5,951 | モリタホールディングス | 22 | 18.2 | 36,072 | 三機工業 | 16.1 | 14.4 | 11,419 |
| ジェイ・エフ・コーポレーション | 242 | 204 | 116,484 | 共和電業 | 14.4 | 13 | 5,395 | デンソー | 309.5 | 251.6 | 1,625,587 | 東海理化電機製作所 | 33 | 29.8 | 67,258 |
| サクサホールディングス | 32 | 2.9 | 5,576 | 日本電子材料 | 5.1 | 4.5 | 2,556 | 三井造船 | 453 | 41 | 74,538 | 川崎重工業 | 977 | 88.2 | 366,030 |
| メルコホールディングス | 7 | 5.5 | 19,525 | 堀場製作所 | 24.9 | 22.5 | 152,325 | 名村造船所 | 37.6 | 34 | 21,284 | サノヤホールディングス | 15.3 | 13.8 | 3,436 |
| テクノメディアカ | 2.9 | 2.7 | 5,130 | アドバンテスト | 85.6 | 63.2 | 134,173 | 日本車輛製造 | 46 | 41 | 12,054 | 三菱ロジスネクスト | 14.5 | 13.5 | 12,339 |
| 日本電気 | 1,725 | 146.7 | 465,772 | 小野測器 | 6.3 | 4.8 | 3,792 | 近畿車輛 | 1.9 | 1.7 | 4,839 | 日産自動車 | 1,480.3 | 1,337.3 | 1,540,569 |
| 富士通 | 1,210 | 1,166 | 751,603 | エスベック | 11.1 | 10.1 | 25,977 | いすゞ自動車 | 363.7 | 328.6 | 579,650 | トヨタ自動車 | 1,526 | 1,378.5 | 10,162,302 |
| 沖電気工業 | 54.3 | 46 | 67,206 | パソニック デバイスSUNX | 11.1 | - | - | 日野自動車 | 179.1 | 161.8 | 237,684 | 三菱自動車工業 | 460.1 | 419.7 | 351,708 |
| 岩崎通信機 | 56 | 5 | 4,035 | キーエンス | 56.9 | 55.7 | 3,569,256 | エフテック | 6.7 | 7.3 | 10,782 | レシップホールディングス | 4.3 | 4.1 | 3,636 |
| 電気興業 | 36 | 6.4 | 17,664 | 日置電機 | 6.6 | 5.9 | 19,912 | GMB | 2.1 | 1.9 | 3,387 | GMB | 2.1 | 1.9 | 3,387 |
| サンケン電気 | 73 | 66 | 55,968 | シスメックス | 97.5 | 88.2 | 741,762 | ファルテック | 2.3 | 2 | 2,860 | 武蔵精密工業 | 14.6 | 12.1 | 41,200 |
| ナカヨ | 13 | 2.2 | 4,617 | 日本マイクロニクス | 23.4 | 19.7 | 22,753 | 日産車体 | 55.1 | 44.3 | 49,305 | 新明和工業 | 51 | 49.3 | 44,222 |
| アイホン | 7.2 | 6.4 | 11,078 | メガチップス | 11.7 | 8.9 | 31,417 | 極東開発工業 | 25 | 21.1 | 36,207 | 日信工業 | 28 | 23 | 45,287 |
| ルネサスエレクトロニクス | 65.1 | 58.7 | 70,322 | OBARA GROUP | 7.3 | 6.6 | 45,144 | トピー工業 | 10.3 | 9.3 | 31,899 | ティラド | 49 | 4.1 | 16,564 |
| セイコーエプソン | 186.9 | 168.8 | 368,996 | 澤藤電機 | 8 | 1.2 | 2,505 | 曙ブレーキ工業 | 58.5 | 52.7 | 16,389 | タチエス | 21.3 | 19.2 | 35,712 |
| ワコム | 97.5 | 88 | 47,080 | コーセル | 17.4 | 15.7 | 25,732 | NOK | 60.7 | 60.9 | 141,470 | フタバ産業 | 38.3 | 34.7 | 34,908 |
| アルバック | 21.2 | 26.1 | 168,345 | イリソ電子工業 | 4 | 9.5 | 63,935 | KYB | 140 | 11.8 | 69,384 | 大同メタル工業 | 15.8 | 14.3 | 15,529 |
| アクセル | 5.3 | 4.7 | 3,774 | 新日本無線 | 9.9 | 6.9 | 5,789 | プレス工業 | 66.6 | 60.2 | 39,972 | ミックニ | 16 | 14.4 | 10,080 |
| E I Z O | 12.4 | 10.4 | 51,896 | オプテックスグループ | 9.5 | 9.2 | 59,524 | カルソニックカンセイ | 85 | - | - | 太平洋工業 | 25.8 | 23.7 | 35,336 |
| ジャパンディスプレイ | 234.5 | 233 | 50,561 | 千代田インテグレ | 6.6 | 5.5 | 12,809 | ケーヒン | 28.8 | 26 | 60,918 | 河西工業 | 16.7 | 13.9 | 20,502 |
| 日本信号 | 34.6 | 31.3 | 33,647 | アイ・オー・データ機器 | 4 | 4.7 | 4,822 | アイシン精機 | 114.8 | 93.4 | 589,354 | 富士機工 | 12.5 | - | - |
| 京三製作所 | 29 | 27 | 18,144 | レーザーテック | 13.8 | 23.2 | 87,928 | マツダ | 397.4 | 355.9 | 539,010 | 今仙電機製作所 | 11.5 | 10.5 | 12,831 |
| 能美防災 | 14.2 | 15 | 33,105 | スタンレー電気 | 89.5 | 86.7 | 356,770 | 今仙電機製作所 | 11.5 | 10.5 | 12,831 | 本田技研工業 | 1,129.5 | 1,020.4 | 3,918,336 |
| ホーチキ | 9.1 | 8.2 | 17,179 | 岩崎電気 | 46 | 4.4 | 7,084 | スズキ | 248.8 | 224.7 | 1,353,592 | S U B A R U | 389.7 | 352 | 1,272,480 |
| エレコム | 10.9 | 9.8 | 22,559 | ウシオ電機 | 76.2 | 68.8 | 102,305 | 安永 | 4.3 | 5.5 | 13,502 | ヤマハ発動機 | 177.3 | 160.1 | 553,145 |
| 日本無線 | 7.7 | - | - | 岡谷電機産業 | 7 | 6.1 | 3,916 | ショーワ | 32.7 | 29.4 | 43,365 | ショーワ | 32.7 | 29.4 | 43,365 |
| パナソニック | 1,434 | 1,295.4 | 2,071,992 | アリオス テクノ ホールディング | 11.8 | 9.7 | 9,379 | T B K | 16.3 | 13.5 | 7,087 | T B K | 16.3 | 13.5 | 7,087 |
| シャープ | - | 79 | 286,770 | 日本セラミック | 10.3 | 11.5 | 32,740 | エクセディ | 17 | 13.7 | 47,402 | エクセディ | 17 | 13.7 | 47,402 |
| アンリツ | 91.4 | 82.7 | 102,878 | 遠藤照明 | 6.4 | 5.8 | 6,345 | 豊田合成 | 40.5 | 41.2 | 104,030 | 豊田合成 | 40.5 | 41.2 | 104,030 |
| 富士通ゼネラル | 43 | 34.6 | 71,933 | 古河電池 | 9 | 8.1 | 8,448 | 三菱工業 | 22 | 19.9 | 26,964 | 三菱工業 | 22 | 19.9 | 26,964 |
| 日立国際電気 | 32.9 | - | - | 双信電機 | 6.5 | 5 | 3,285 | 盟和産業 | 1.8 | 1.7 | 2,295 | 盟和産業 | 1.8 | 1.7 | 2,295 |
| ソニー | 886.2 | 757.5 | 4,103,377 | 山一電機 | 11.8 | 8.2 | 15,243 | 日本ブラスト | - | 4.6 | 4,291 | 日本ブラスト | - | 4.6 | 4,291 |
| T D K | 70.7 | 59.3 | 549,118 | 図研 | 8.2 | 7.4 | 13,127 | ヨロズ | 11.7 | 11.5 | 25,472 | ヨロズ | 11.7 | 11.5 | 25,472 |
| 帝国通信工業 | 27 | 5 | 6,590 | 日本電子 | 46 | 41 | 25,625 | エフ・シー・シー | 20.5 | 18.5 | 55,777 | エフ・シー・シー | 20.5 | 18.5 | 55,777 |
| タムラ製作所 | 48 | 43.7 | 34,566 | カシオ計算機 | 101 | 91.2 | 135,705 | シマノ | 50.6 | 45.7 | 712,006 | シマノ | 50.6 | 45.7 | 712,006 |
| アルプス電気 | 115.9 | 97.7 | 277,858 | ファナック | 127.3 | 107.8 | 2,926,770 | タカタ | 22.7 | - | - | タカタ | 22.7 | - | - |
| 池上通信機 | 40 | 36 | 5,796 | 日本シイエムケイ | 27.1 | 20 | 19,440 | テイ・エス テック | 29.1 | 26.3 | 110,723 | テイ・エス テック | 29.1 | 26.3 | 110,723 |
| パイオニア | 188.7 | 189 | 41,580 | エンプラス | 5.7 | 5.1 | 19,099 | ジャムコ | 7.4 | 5.7 | 13,189 | ジャムコ | 7.4 | 5.7 | 13,189 |
| 日本電波工業 | 12.2 | 10.3 | 7,179 | 大真空 | 4.6 | 4.2 | 6,413 | 精密機器 (1.6%) | 192.4 | 173.8 | 870,738 | 精密機器 (1.6%) | 192.4 | 173.8 | 870,738 |
| 鈴木 | 4.9 | 4.5 | 4,783 | ローム | 60.7 | 50.9 | 557,355 | テルモ | 192.4 | 173.8 | 870,738 | テルモ | 192.4 | 173.8 | 870,738 |
| 日本トリム | 3.1 | 2.4 | 13,632 | 浜松ホトニクス | 97.9 | 82.6 | 341,551 | | | | | | | | |
| ローランド ディー・ジー | 6.4 | 5.8 | 16,698 | 三井ハイテック | 16.6 | 15 | 28,275 | | | | | | | | |
| フォスター電機 | 14.7 | 13.3 | 38,716 | 新光電気工業 | 47.4 | 42.8 | 36,765 | | | | | | | | |
| クラリオン | 66 | 60 | 21,360 | 京セラ | 206 | 186.1 | 1,171,127 | | | | | | | | |
| S M K | 32 | 29 | 13,166 | 太陽誘電 | 61 | 50.9 | 88,667 | | | | | | | | |
| ヨコオ | 9 | 7.4 | 14,163 | 村田製作所 | 131.7 | 119 | 1,811,775 | | | | | | | | |
| ティアック | 92 | 84 | 3,780 | ユーシン | 16.8 | 17.1 | 11,935 | | | | | | | | |
| ホシデン | 38.1 | 28.6 | 43,043 | 双葉電子工業 | 20.5 | 18.5 | 41,791 | | | | | | | | |
| ヒロセ電機 | 20.3 | 18.3 | 280,905 | 北陸電気工業 | 51 | 4.6 | 7,820 | | | | | | | | |
| 日本航空電子工業 | 36 | 29 | 47,212 | ニチコン | 39.5 | 35.7 | 47,481 | | | | | | | | |
| T O A | 14.8 | 12.2 | 18,605 | 日本ケミコン | 108 | 9.2 | 26,689 | | | | | | | | |
| マクセルホールディングス | 18.7 | 22.5 | 48,307 | K O A | 17.4 | 15.7 | 37,224 | | | | | | | | |
| 古野電気 | 16.2 | 13.5 | 10,044 | 市光工業 | 26 | 17 | 16,133 | | | | | | | | |
| ユニデンホールディングス | 37 | 31 | 9,393 | 小糸製作所 | 75.2 | 67.9 | 507,892 | | | | | | | | |
| アルパイン | 29.9 | 27 | 60,939 | ミツバ | 23.1 | 20.9 | 28,800 | | | | | | | | |
| スマダコーポレーション | 10.3 | 11.6 | 20,914 | S C R E E Nホールディングス | 25.7 | 21.5 | 180,600 | | | | | | | | |
| アイコム | 6.9 | 6.3 | 16,140 | キャノン電子 | 11.4 | 10.4 | 27,736 | | | | | | | | |
| リオン | 4.9 | 4.8 | 13,060 | キャノン | 675.7 | 610.4 | 2,477,003 | | | | | | | | |
| 本多通信工業 | 3.6 | 8.8 | 10,313 | リコー | 377.3 | 340.9 | 373,626 | | | | | | | | |
| 船井電機 | 13.8 | 11.5 | 9,154 | M U T O Hホールディングス | 16 | 1.6 | 3,793 | | | | | | | | |
| 横河電機 | 136.1 | 113.5 | 246,635 | 東京エレクトロロン | 83.7 | 75.6 | 1,418,256 | | | | | | | | |
| 新電元工業 | 48 | 4 | 35,800 | 輸送用機器 (9.2%) | | | | | | | | | | | |
| アズビル | 38 | 34 | 158,270 | トヨタ紡織 | 43.9 | 33 | 79,035 | | | | | | | | |
| 東亜ディーケーケー | 6.4 | 5.6 | 6,014 | 芦森工業 | 29 | 2.4 | 6,261 | | | | | | | | |

| 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 |
| クリエートメディック | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | アシックス | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | 神戸電鉄 | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 |
| 日機装 | 4.4 | 3.8 | 4,571 | | 3.8 | 4,571 | 124.7 | 112.6 | 194,572 | | 31 | 2.6 | 10,166 | | 31 | 2.6 | 10,166 | | 31 | 2.6 |
| 島津製作所 | 161.5 | 135.5 | 364,224 | | 39.2 | 46,412 | 4.7 | 3.5 | 7,115 | | 457 | 83.3 | 228,825 | | 457 | 83.3 | 228,825 | | 457 | 83.3 |
| JMS | 23 | 10.5 | 6,237 | | 23 | 6,237 | 84.6 | 76.4 | 326,992 | | 46 | 8.3 | 22,526 | | 46 | 8.3 | 22,526 | | 46 | 8.3 |
| クボテック | 2.8 | 2.5 | 1,390 | | 2.8 | 1,390 | 5 | 3.8 | 11,856 | | 485 | 42.2 | 307,628 | | 485 | 42.2 | 307,628 | | 485 | 42.2 |
| 長野計器 | 8.5 | 8.9 | 10,181 | | 8.5 | 10,181 | 14.8 | 10.5 | 8,914 | | 224.4 | 188.3 | 524,227 | | 224.4 | 188.3 | 524,227 | | 224.4 | 188.3 |
| パイ・テクノロジ | 2.5 | 2.7 | 53,352 | | 2.5 | 53,352 | 75.9 | 68.5 | 287,015 | | 165 | 27.6 | 141,864 | | 165 | 27.6 | 141,864 | | 165 | 27.6 |
| 東京計器 | 4.3 | 7.2 | 9,086 | | 4.3 | 9,086 | 14 | 0.9 | 1,827 | | 7.1 | 6 | 1,932 | | 7.1 | 6 | 1,932 | | 7.1 | 6 |
| 愛知時計電機 | 1.7 | 1.5 | 6,570 | | 1.7 | 6,570 | 10.6 | 9.4 | 9,165 | | 42 | 38 | 18,810 | | 42 | 38 | 18,810 | | 42 | 38 |
| インターアクション | — | 4.4 | 3,942 | | — | 3,942 | 29.8 | 26.9 | 79,731 | | 56.4 | 64.6 | 49,871 | | 56.4 | 64.6 | 49,871 | | 56.4 | 64.6 |
| オーバル | 12.5 | 11.2 | 3,192 | | 12.5 | 3,192 | 2.7 | — | — | | 26 | 2.6 | 13,338 | | 26 | 2.6 | 13,338 | | 26 | 2.6 |
| 東京精密 | 24.2 | 20.5 | 88,355 | | 24.2 | 88,355 | 26.5 | 23.9 | 17,064 | | 42.5 | 40.8 | 114,484 | | 42.5 | 40.8 | 114,484 | | 42.5 | 40.8 |
| マニー | 16.7 | 13.8 | 51,543 | | 16.7 | 51,543 | 77.3 | 69.8 | 3,134,718 | | 1.4 | 1.3 | 4,108 | | 1.4 | 1.3 | 4,108 | | 1.4 | 1.3 |
| ニコン | 218.7 | 197.6 | 396,978 | | 218.7 | 396,978 | 10.3 | 18.7 | 42,505 | | 76 | 15.7 | 62,721 | | 76 | 15.7 | 62,721 | | 76 | 15.7 |
| トプコン | 63.2 | 60.9 | 145,733 | | 63.2 | 145,733 | 25.9 | 23.4 | 41,441 | | 88.9 | 80.4 | 141,343 | | 88.9 | 80.4 | 141,343 | | 88.9 | 80.4 |
| オリンパス | 200.3 | 168.9 | 689,956 | | 200.3 | 689,956 | 65.2 | 54.4 | 103,033 | | 15 | 2.7 | 9,828 | | 15 | 2.7 | 9,828 | | 15 | 2.7 |
| 理研計器 | 11 | 10.8 | 23,403 | | 11 | 23,403 | 23 | 11.1 | 7,437 | | 26.1 | 23.6 | 9,838 | | 26.1 | 23.6 | 9,838 | | 26.1 | 23.6 |
| タムロン | 11.1 | 9.1 | 20,393 | | 11.1 | 20,393 | 6.2 | 5.1 | 11,526 | | 3.2 | 5.7 | 22,800 | | 3.2 | 5.7 | 22,800 | | 3.2 | 5.7 |
| HOYA | 258.2 | 230.9 | 1,251,478 | | 258.2 | 1,251,478 | 43.9 | 39.6 | 54,489 | | 13.1 | 11.8 | 16,697 | | 13.1 | 11.8 | 16,697 | | 13.1 | 11.8 |
| シード | — | 1.2 | 6,768 | | — | 6,768 | 68 | 11.2 | 34,496 | | 93.5 | 90.1 | 297,330 | | 93.5 | 90.1 | 297,330 | | 93.5 | 90.1 |
| ノーリツ鋼機 | 12.3 | 11.5 | 27,933 | | 12.3 | 27,933 | — | — | — | | — | 76.1 | 172,899 | | — | 76.1 | 172,899 | | — | 76.1 |
| エー・アンド・デイ | 11.6 | 10.4 | 7,477 | | 11.6 | 7,477 | 1,064.8 | 905.1 | 376,521 | | 1,060 | 89.8 | 223,512 | | 1,060 | 89.8 | 223,512 | | 1,060 | 89.8 |
| シチズン時計 | 137.2 | 135.3 | 103,639 | | 137.2 | 103,639 | 413.5 | 346.9 | 475,426 | | 658 | 67.9 | 242,742 | | 658 | 67.9 | 242,742 | | 658 | 67.9 |
| リズム時計工業 | 51 | 4.3 | 9,331 | | 51 | 9,331 | 512.3 | 462.7 | 610,764 | | 476 | 49.6 | 134,019 | | 476 | 49.6 | 134,019 | | 476 | 49.6 |
| 大研医器 | 10.8 | 10.1 | 7,514 | | 10.8 | 7,514 | 173.4 | 156.7 | 189,607 | | 56 | 5.1 | 11,775 | | 56 | 5.1 | 11,775 | | 56 | 5.1 |
| メニコン | 8.6 | 15.6 | 47,502 | | 8.6 | 47,502 | 122.8 | 111.1 | 93,768 | | 11.4 | 11.4 | 4,856 | | 11.4 | 11.4 | 4,856 | | 11.4 | 11.4 |
| 松風 | 6.6 | 5.6 | 7,716 | | 6.6 | 7,716 | 313.5 | 265.5 | 365,859 | | 64.9 | 54.7 | 30,413 | | 64.9 | 54.7 | 30,413 | | 64.9 | 54.7 |
| セイコーホールディングス | 89 | 17.5 | 51,555 | | 89 | 51,555 | 113 | 102.1 | 121,805 | | 11 | 0.8 | 1,588 | | 11 | 0.8 | 1,588 | | 11 | 0.8 |
| ニプロ | 86.8 | 78.5 | 122,931 | | 86.8 | 122,931 | 277.3 | 250.4 | 292,968 | | 9.2 | 8.3 | 6,772 | | 9.2 | 8.3 | 6,772 | | 9.2 | 8.3 |
| その他製品 (2.1%) | — | 1.1 | 4,889 | | — | 4,889 | 117.5 | 113.7 | 75,610 | | — | — | — | | — | — | — | | — | — |
| 中本パックス | — | 1.1 | 4,889 | | — | 4,889 | 18.5 | 18.3 | 51,020 | | 226.1 | 199.2 | 791,820 | | 226.1 | 199.2 | 791,820 | | 226.1 | 199.2 |
| スノーピーク | 1.6 | 3.5 | 4,942 | | 1.6 | 4,942 | 99.8 | 90.2 | 256,438 | | 2,330 | 210.5 | 887,257 | | 2,330 | 210.5 | 887,257 | | 2,330 | 210.5 |
| パナソニックホールディングス | 12 | 12 | 62,160 | | 12 | 62,160 | 5.3 | 5.7 | 6,469 | | 12 | 10 | 3,180 | | 12 | 10 | 3,180 | | 12 | 10 |
| トランザクション | 2.8 | 5.1 | 5,089 | | 2.8 | 5,089 | 5.3 | 17.8 | 14,186 | | — | — | — | | — | — | — | | — | — |
| SHO-BI | 5 | 3.9 | 1,583 | | 5 | 1,583 | 1,346 | 241.9 | 639,946 | | 3.6 | 3 | 22,050 | | 3.6 | 3 | 22,050 | | 3.6 | 3 |
| ニホンフラッシュ | 5.3 | 5.3 | 12,243 | | 5.3 | 12,243 | 1,218 | 220 | 473,110 | | 51 | 9.3 | 23,631 | | 51 | 9.3 | 23,631 | | 51 | 9.3 |
| 前田工織 | 12.6 | 11.4 | 22,366 | | 12.6 | 22,366 | 316 | 56.2 | 179,840 | | 82 | 37.1 | 96,274 | | 82 | 37.1 | 96,274 | | 82 | 37.1 |
| 永大産業 | 16 | 15 | 8,085 | | 16 | 8,085 | 31 | 31 | 9,114 | | 73 | 61 | 20,984 | | 73 | 61 | 20,984 | | 73 | 61 |
| アートネイチャー | 13.4 | 12.1 | 8,857 | | 13.4 | 8,857 | 26 | 23.4 | 8,564 | | 91 | 74 | 54,538 | | 91 | 74 | 54,538 | | 91 | 74 |
| ダンロップスポーツ | 8 | — | — | | 8 | — | 142 | 13.8 | 38,239 | | 33 | 5.9 | 10,755 | | 33 | 5.9 | 10,755 | | 33 | 5.9 |
| パナソニックホールディングス | 138.4 | 117.2 | 390,862 | | 138.4 | 390,862 | 38.6 | 32.2 | 29,913 | | 22.2 | 19.5 | 6,951 | | 22.2 | 19.5 | 6,951 | | 22.2 | 19.5 |
| アイフイスジャパン | 2.4 | 2.4 | 1,540 | | 2.4 | 1,540 | 7.1 | 6.4 | 18,707 | | 29 | 26 | 11,128 | | 29 | 26 | 11,128 | | 29 | 26 |
| 共立印刷 | 21.6 | 18.9 | 6,804 | | 21.6 | 6,804 | — | — | — | | 23 | 2.1 | 3,675 | | 23 | 2.1 | 3,675 | | 23 | 2.1 |
| SHOEI | 5.7 | 5.1 | 22,618 | | 5.7 | 22,618 | 12.4 | 11.2 | 11,984 | | 7.4 | 6.6 | 7,048 | | 7.4 | 6.6 | 7,048 | | 7.4 | 6.6 |
| フランスベッドホールディングス | 15.8 | 13.4 | 13,480 | | 15.8 | 13,480 | 670 | 121.2 | 419,352 | | — | — | — | | — | — | — | | — | — |
| パイロットコーポレーション | 21.9 | 19.8 | 100,188 | | 21.9 | 100,188 | 201 | 36.3 | 106,467 | | 9.7 | 9.7 | 8,228 | | 9.7 | 9.7 | 8,228 | | 9.7 | 9.7 |
| 萩原工業 | 3.5 | 6.3 | 11,497 | | 3.5 | 11,497 | 682 | 308 | 546,084 | | 37 | 3.2 | 5,612 | | 37 | 3.2 | 5,612 | | 37 | 3.2 |
| トッパン・フォームズ | 22.4 | 24.3 | 29,475 | | 22.4 | 29,475 | 344 | 155.3 | 309,512 | | 10.4 | 9.4 | 4,521 | | 10.4 | 9.4 | 4,521 | | 10.4 | 9.4 |
| フジテレビインターナショナル | 28.2 | 25.4 | 92,456 | | 28.2 | 92,456 | 201.1 | 168.6 | 385,082 | | 150 | 67.6 | 157,710 | | 150 | 67.6 | 157,710 | | 150 | 67.6 |
| タカラトミー | 48.9 | 47.5 | 71,535 | | 48.9 | 71,535 | 351 | 63.4 | 304,637 | | 1.7 | 2.8 | 2,293 | | 1.7 | 2.8 | 2,293 | | 1.7 | 2.8 |
| 廣済堂 | 12.7 | 10.6 | 4,727 | | 12.7 | 4,727 | 94.1 | 78.9 | 272,205 | | 3.3 | 2.9 | 3,311 | | 3.3 | 2.9 | 3,311 | | 3.3 | 2.9 |
| As-me エステール | — | 3.4 | 2,927 | | — | 2,927 | 34 | 15.5 | 47,430 | | 3.9 | 3.1 | 8,007 | | 3.9 | 3.1 | 8,007 | | 3.9 | 3.1 |
| アーク | 53.5 | 47.9 | 5,795 | | 53.5 | 5,795 | 16 | 2.9 | 6,353 | | 11.5 | — | — | | 11.5 | — | — | | 11.5 | — |
| タカノ | 5.7 | 5 | 4,810 | | 5.7 | 4,810 | 242.8 | 203.7 | 2,130,702 | | 22.5 | 20.3 | 45,309 | | 22.5 | 20.3 | 45,309 | | 22.5 | 20.3 |
| プロネクサス | 11.8 | 10.6 | 14,235 | | 11.8 | 14,235 | 120.8 | 102.3 | 818,400 | | 7.2 | 6.1 | 2,562 | | 7.2 | 6.1 | 2,562 | | 7.2 | 6.1 |
| ホクシン | 9.7 | 8.2 | 1,566 | | 9.7 | 1,566 | 104.4 | 101.5 | 2,053,345 | | 7.7 | 7.7 | 9,278 | | 7.7 | 7.7 | 9,278 | | 7.7 | 7.7 |
| ウッドワン | 22 | 3.8 | 5,863 | | 22 | 5,863 | 173.3 | 144.5 | 300,704 | | 3.8 | 3.8 | 6,619 | | 3.8 | 3.8 | 6,619 | | 3.8 | 3.8 |
| 大建工業 | 8.9 | 8.8 | 23,443 | | 8.9 | 23,443 | 17.7 | 16 | 30,224 | | — | 2.1 | 3,021 | | — | 2.1 | 3,021 | | — | 2.1 |
| 凸版印刷 | 354 | 320 | 304,960 | | 354 | 304,960 | 151 | 31.4 | 90,589 | | — | — | — | | — | — | — | | — | — |
| 大日本印刷 | 362 | 148.4 | 338,945 | | 362 | 338,945 | 8.2 | 8 | 29,560 | | 13.6 | 12.3 | 33,357 | | 13.6 | 12.3 | 33,357 | | 13.6 | 12.3 |
| 図書印刷 | 17 | 7.6 | 6,984 | | 17 | 6,984 | 4.3 | 6 | 29,490 | | 9.9 | 8.9 | 38,982 | | 9.9 | 8.9 | 38,982 | | 9.9 | 8.9 |
| 共同印刷 | 39 | 3.5 | 11,305 | | 39 | 11,305 | 1,263 | 107.4 | 449,469 | | 5.5 | 5.5 | 20,432 | | | | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|-------|-------|--------------------|---------|--------|-------|-------|------------------------|---------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| コア | | 千株 | | 千円 | PC Iホールディングス | | 千株 | | 千円 | テレビ朝日ホールディングス | | 千株 | | 千円 |
| ソリトンシステムズ | | 5.3 | | 6,016 | パイバートHD | | 1.5 | | 5,766 | スカパーJ SATホールディングス | | 33.8 | | 74,359 |
| ソフトクリエイトホールディングス | | — | | 5,217 | アイビーシー | | 1.8 | | 2,296 | テレビ東京ホールディングス | | 80.4 | | 42,619 |
| T I S | | 6.1 | | 4,483 | オーブントア | | — | | 1,686 | 日本BS放送 | | 10.1 | | 24,806 |
| ネオス | | 41.1 | | 37.1 | マイネット | | 1.2 | | 4.4 | ビジョン | | 2.8 | | 5,209 |
| 電算システム | | 3.9 | | 3.4 | アカツキ | | — | | 2.2 | USEN-NEXT HOLDINGS | | 1.4 | | 8,262 |
| グリー | | 4.3 | | 3.9 | LINE | | — | | 2.2 | ワイヤレスゲート | | 3.4 | | 3,146 |
| コーエーテクモホールディングス | | 75.5 | | 59.6 | シンクロ・フード | | 20.7 | | 33.6 | コネクシオ | | 4.1 | | 6,583 |
| 三菱総合研究所 | | 29.4 | | 18.9 | オークネット | | — | | 0.9 | 日本通信 | | 104.2 | | 11,188 |
| ボルテージ | | 4.8 | | 4.8 | AOI TYO HOLDINGS | | — | | 3.5 | グロップス | | 1.4 | | 2,210 |
| 電算 | | 2.5 | | 2.1 | MAOミル | | 10.2 | | 9.1 | 日本電信電話 | | 1.4 | | 2,210 |
| AGS | | 1.5 | | 1.3 | ソルクシーズ | | — | | 10.4 | KDDI | | 994.5 | | 3,985,313 |
| ファインデックス | | 2.6 | | 6.3 | フェイス | | — | | 4.3 | 光通信 | | 1,225.6 | | 2,675,573 |
| ヒト・コミュニケーションズ | | 9.2 | | 9.3 | ハイマックス | | 3.4 | | 3.9 | NTTドコモ | | 14.9 | | 201,134 |
| ブレインパッド | | 2.8 | | 2.5 | 野村総合研究所 | | — | | 1.5 | エムティーアイ | | 925.7 | | 2,194,748 |
| K L a b | | 1.9 | | 2.4 | サイバネットシステム | | 92.6 | | 74.4 | GMOインターネット | | 19 | | 9,960 |
| ホムテックホールディングス | | 23.7 | | 21.6 | CEホールディングス | | 10.2 | | 9.2 | アドマーテックコミュニケーション | | 45.3 | | 67,959 |
| イーブイエンジニアリング | | 8.9 | | 8.1 | 日本システム技術 | | 1.8 | | 3.2 | カドカワ | | — | | 1,242 |
| ネクソン | | 2.1 | | 1.8 | インテジホールディングス | | — | | 1.4 | 学研ホールディングス | | 39 | | 32.4 |
| アイスタイル | | 135.6 | | 124 | 東邦システムサイエンス | | 7.1 | | 12.8 | ゼンリン | | 41 | | 21,016 |
| エムアップ | | 26.1 | | 27.9 | ソースネクスト | | 4.3 | | 3.8 | 昭文社 | | 16.4 | | 13.5 |
| エイチーム | | 3.7 | | 3.7 | フォーカスシステムズ | | 6.8 | | 15.7 | インプレスホールディングス | | 6.9 | | 5.1 |
| テクノスジャパン | | 6.9 | | 7.6 | グレスコ | | 5.1 | | 6.3 | アイネット | | 11.1 | | 9.5 |
| enish | | 9.6 | | 10.1 | ブジ・メディア・ホールディングス | | 2.9 | | 2.5 | 松竹 | | 7.1 | | 6.3 |
| コロプラ | | 3.8 | | 3.3 | オービック | | 128.9 | | 116.5 | 東宝 | | 82 | | 113,960 |
| モバイルクリエイト | | 34.5 | | 36.1 | ジャストシステム | | 42.7 | | 35.1 | 東映 | | 81 | | 73.2 |
| オルトプラス | | 8.6 | | 8.6 | TDCソフト | | 20.1 | | 18.1 | エヌ・ティ・ティ・データ | | 46 | | 4.2 |
| ブロードリーフ | | 5.3 | | 5.4 | ヤフー | | 5.5 | | 4.9 | ビー・シー・エー | | 76.5 | | 345.6 |
| ハーツナइटテッドグループ | | 30.6 | | 27.6 | トレンドマイクロ | | 888.5 | | 802.3 | ビジネスプレイング太田昭和 | | 1.8 | | 1.7 |
| メディアアドホールディングス | | 6.6 | | 5.9 | インフォメーション・テクノロジー | | 65.6 | | 54.3 | D T S | | 1.7 | | 1.9 |
| アイキューブ | | 2.7 | | 3.6 | 日本オラル | | 3.7 | | 3.5 | スウェーデン・エンフォース・ホールディングス | | 12.8 | | 11.6 |
| サイバーリンクス | | 6.9 | | 6.9 | アルファシステムズ | | 19.9 | | 18 | シーイーシー | | 47.7 | | 51.7 |
| ディー・エル・イー | | 2 | | 1.8 | フューチャー | | 4.1 | | 3.7 | カブコン | | 7.4 | | 6.6 |
| フィックスターズ | | 3.8 | | 5.1 | CAC Holdings | | 16.8 | | 15.1 | アイ・エス・ビー | | 29 | | 23.8 |
| VOYAGE GROUP | | 1.8 | | 1.9 | ソフトバンク・テクノロジー | | 9.3 | | 8.4 | S C S K | | 2.3 | | 2.2 |
| オプティム | | 4.3 | | 5.7 | オービックビジネスコンサルティング | | 3 | | 4.7 | 日本システムウェア | | 7.9 | | 6.5 |
| セレス | | 1.1 | | 1.9 | 伊藤テクノソリューションズ | | 3.6 | | 3 | アイネス | | 33.7 | | 25.7 |
| ベリサーブ | | 2.2 | | 3.4 | アイティフォー | | 6.3 | | 5.7 | T K C | | 4.1 | | 3.7 |
| ティーガイア | | 1.5 | | 1.4 | 東計電算 | | 28.1 | | 25.3 | 富士ソフト | | 15.6 | | 14.1 |
| セック | | 12.4 | | 11.1 | エクسسネット | | 16.4 | | 13.6 | N S D | | 11.5 | | 10.4 |
| 日本アジアグループ | | — | | 1.1 | 大塚商会 | | 2.3 | | 2 | コナミホールディングス | | 18.4 | | 15.4 |
| 豆蔵ホールディングス | | 14.1 | | 11.7 | サイボウズ | | 1.3 | | 1.8 | ソフトバンクグループ | | 26.3 | | 18.3 |
| テクノマトリックス | | 9.2 | | 8.3 | ソフトブレイン | | 33.3 | | 33.4 | 卸売業 (4.7%) | | 55.9 | | 45.5 |
| プロシップ | | 3.9 | | 6.1 | 電通国際情報サービス | | 16.8 | | 14.9 | ハウスイ | | 3.6 | | 3.2 |
| カネー・オンライン・エンターテイメント | | — | | 1.6 | デジタルガレージ | | 3,289 | | 8.9 | 高千穂交易 | | 10.5 | | 8.8 |
| GMOペイメントゲートウェイ | | 259.9 | | 301.7 | イーエムシステムズ | | 91,415 | | 7.7 | 伊藤忠食品 | | 10.5 | | 8.8 |
| ザンパラス | | 10.2 | | 7.8 | ウエザーニューズ | | 66,846 | | 6.9 | エレマテック | | 9.2 | | 9.8 |
| システムリサーチ | | — | | 7.5 | C I J | | 5,213 | | 4.3 | J A L U X | | 557.7 | | 503.7 |
| インターネットイニシアティブ | | — | | 1.1 | 東洋ビジネスエン지니어リング | | 2,392 | | 4.2 | あらた | | 12 | | 0.9 |
| ざくらインターネット | | 18.3 | | 18.1 | ネットワンシステムズ | | 40,435 | | 8.8 | トーマンデバイス | | 1.2 | | 0.9 |
| GMOクラウド | | 8.8 | | 13.3 | スクアラ | | 10,014 | | 1.4 | 東京エレフロン デバイス | | 4.9 | | 4.3 |
| S R Aホールディングス | | 2.8 | | 2.5 | 日本コロムビア | | 5,005 | | 11.7 | フィールズ | | 3.1 | | 2.7 |
| MINOR Iソリューションズ | | 6.6 | | 5.9 | マジカ・ロボティクスホールディングス | | 21,741 | | 5.9 | 双日 | | 4.9 | | 5.2 |
| システムインテグレータ | | 2.7 | | 2.2 | ネットワンシステムズ | | 3,423 | | 5.3 | 丸日 | | 4 | | 3.2 |
| 朝日ネット | | — | | 1.6 | アルゴグラフィックス | | 1,539 | | 7.8 | 丸日 | | 5.6 | | 5.5 |
| e B A S E | | 11.7 | | 10.2 | マーベラス | | 5,283 | | 3.9 | トーマンデバイス | | 1.9 | | 1.7 |
| アドソル日進 | | — | | 2.2 | エイベックス | | 2,387 | | 10.5 | 東京エレフロン デバイス | | 4.6 | | 4 |
| フリービット | | 2.5 | | 4.3 | 日本ユニシス | | 5,525 | | 45.4 | フィールズ | | 9.4 | | 8.5 |
| コムチュア | | 6.9 | | 7.4 | 兼松エレクトロニクス | | 6,852 | | 26.5 | 丸日 | | 731.2 | | 660.7 |
| サイバーコム | | 2.1 | | 5.7 | 東京放送ホールディングス | | 19,722 | | 5.1 | アルフレックスホールディングス | | 146.6 | | 124.1 |
| メディカル・データ・ビジョン | | 1.6 | | 2 | 日本ユニシス | | 2,664 | | 20.9 | 横浜冷凍 | | 30.9 | | 27 |
| gumi | | 2.1 | | 4.2 | 兼松エレクトロニクス | | 2,664 | | 20.6 | 神栄 | | 18 | | 1.5 |
| ショーカーズ・ティービー | | 12.8 | | 12.8 | 日本ユニシス | | 12,864 | | 30.9 | 山下医科器械 | | 1.1 | | — |
| モバイルファクトリー | | — | | 2.2 | 朝日放送 | | 2,796 | | 67 | ラサ商事 | | 5.8 | | 5.455 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | | — | | 2.1 | 朝日放送 | | 2,541 | | 113 | ラクーン | | 5.6 | | 6.6 |
| | | — | | 1.7 | 朝日放送 | | 5,032 | | 11 | アルコニクス | | 7.1 | | 11.8 |
| | | — | | 5,032 | | | | | 9,801 | 神戸物産 | | 6.7 | | 7.2 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|-------------------------|---------|-------|-----------|------------------|---------|-------|---------|--------------------|---------|---------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| スタートトゥデイ | 113.1 | 109.7 | 341,715 | ワタミ | 14.7 | 13.2 | 21,040 | ケーズホールディングス | 57.1 | 47.3 | 141,474 |
| トレジャー・ファクトリー | 3.7 | 3.3 | 2,834 | マルシェ | 3.1 | 3 | 2,412 | Olympicグループ | 7.4 | 6.6 | 3,953 |
| 物産コーポレーション | 3.3 | 3.2 | 30,400 | ドンキホーテホールディングス | 80.1 | 72.4 | 410,508 | 日東東硝子ホールディングス | 18.3 | 16.4 | 6,445 |
| ココカラファイン | 12.9 | 11.7 | 81,081 | 西松屋チェーン | 21.7 | 24.5 | 30,698 | Genky DrugStores | - | 4.4 | 15,730 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 246.4 | 208.8 | 263,923 | ゼンショーホールディングス | 64.2 | 57.9 | 112,615 | アインホールディングス | 16.2 | 15 | 100,950 |
| Home | 1.9 | 2.8 | 5,028 | 幸楽苑ホールディングス | 8 | 7.1 | 12,815 | 元氣寿司 | 3.2 | 2.8 | 7,949 |
| ウエルシアホールディングス | 12.3 | 29.5 | 131,422 | ハークスレイ | 3 | 2.7 | 3,007 | ヤマダ電機 | 414.3 | 374.3 | 240,300 |
| クワイエットSDホールディングス | 18.2 | 16.5 | 42,504 | サイゼリヤ | 20.4 | 16.6 | 52,041 | アークランドサカモト | 21 | 18.9 | 34,813 |
| 丸善CHホールディングス | 14.8 | 13 | 4,394 | VTホールディングス | 42 | 37.8 | 20,903 | ニトリホールディングス | 53.5 | 44.3 | 753,543 |
| ミサワ | 1.8 | 1.8 | 790 | 魚力 | 3.9 | 3.1 | 3,605 | グルメ材屋 | 9 | 8 | 9,144 |
| ティールライフ | - | 1.5 | 1,828 | ポプラ | 3.5 | 3 | 2,565 | 愛眼 | 9.7 | 9.1 | 4,495 |
| イー・ピーカーンバーニ | 2.3 | 2.2 | 1,733 | フジ・コーポレーション | 1.9 | 1.9 | 4,670 | ケーユーホールディングス | 6.5 | 5.8 | 6,327 |
| チムニー | 3.4 | 3.4 | 9,683 | ユナイテッドアローズ | 16.5 | 13.8 | 58,098 | 吉野家ホールディングス | 43.1 | 36.7 | 71,895 |
| シュッピン | 4.7 | 6.8 | 7,792 | ハイデイド日高 | 11.3 | 12.2 | 40,565 | 松屋フーズ | 6 | 5.4 | 20,763 |
| ネクステージ | 2.2 | 11.4 | 11,468 | 京都きもの友禅 | 8.1 | 7.3 | 5,548 | サガミチェーン | 15.6 | 14.9 | 20,681 |
| ジョイフル本田 | 20.1 | 16.4 | 57,728 | コロワイド | 41.1 | 37.1 | 78,726 | 麗屋スーパーマーケット | 10.2 | 8.4 | 9,735 |
| 鳥貴族 | 3.1 | 4.1 | 12,628 | ピーシーデブコーポレーション | 16.5 | 16.7 | 12,157 | 王将フードサービス | 9.1 | 8.2 | 40,754 |
| キリン堂ホールディングス | 4.1 | 3.9 | 6,949 | 番番屋 | 8.7 | 7.9 | 34,997 | ブレナス | 13.9 | 12.5 | 26,375 |
| ホットランド | 4.9 | 6.5 | 8,846 | トップカルチャー | 5 | 4.1 | 1,972 | ミニストップ | 9.1 | 8.3 | 18,044 |
| すかいらーく | 53.2 | 69.3 | 108,246 | P L A N T | 2.8 | 2.6 | 3,372 | アークス | 23.2 | 20.9 | 53,859 |
| 綿半ホールディングス | 5 | 4.2 | 17,577 | スギホールディングス | 27.1 | 24.5 | 138,915 | パロールホールディングス | 26.7 | 26 | 72,358 |
| ヨシックス | - | 1.8 | 5,940 | ヴァイ・ホールディングス | 9.4 | 9.8 | 6,948 | 藤久 | - | 0.9 | 1,525 |
| ココイチ・スーパーマーケット・ホールディングス | 40.9 | 37.1 | 40,661 | スクロール | 18.8 | 17.4 | 7,221 | ベルク | 5.5 | 5 | 30,250 |
| ブックオフコーポレーション | 7.3 | 6.4 | 5,331 | ヨンドシーホールディングス | 9.4 | 11.4 | 31,942 | 大庄 | 6.7 | 6 | 10,290 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 3.9 | 4.5 | 4,914 | エヌ・ファミリアホールディングス | 54.3 | 35.7 | 256,326 | ファーストリテイリング | 20.7 | 18.7 | 811,206 |
| B E E N O S | 1.5 | 1.5 | 2,227 | 木曽路 | 15.2 | 13.7 | 36,935 | サンドラッグ | 23.6 | 47.3 | 214,505 |
| あさひ | 9.2 | 8.3 | 11,105 | S R Sホールディングス | 14.8 | 13.2 | 12,474 | サックパルホールディングス | 11.7 | 10.5 | 12,022 |
| 日本調剤 | 4.4 | 3.9 | 14,371 | 千趣会 | 22.3 | 20.2 | 12,019 | ヤマザック | 2.6 | 2.3 | 3,983 |
| コスモス薬品 | 6.2 | 5.6 | 106,120 | タカキュー | 10.7 | 9 | 1,989 | やまや | 2.6 | 2.3 | 6,762 |
| トーエル | 6.2 | 5.5 | 5,357 | ケーユー | 21 | 20.7 | 13,103 | ペルーナ | 31 | 27.4 | 33,729 |
| 一六堂 | 3.3 | 2.5 | 1,102 | 上新電機 | 29 | 13.2 | 41,448 | 銀行業 (7.5%) | | | |
| オンリー | - | 1.7 | 1,521 | 日本瓦斯 | 22.7 | 20.5 | 90,302 | 島根銀行 | 2.8 | 2.4 | 3,331 |
| セブ&アイ・ホールディングス | 518.5 | 468.1 | 2,085,385 | ベスト電器 | 40.3 | - | - | じもとホールディングス | 89.2 | 75.7 | 13,701 |
| 薬王堂 | 6.2 | 4.9 | 17,076 | ロイヤルホールディングス | 20.5 | 19.8 | 57,756 | めぐみフィナンシャルグループ | 597.3 | 581.1 | 273,117 |
| クワイエットレストランホールディングス | 33.3 | 30 | 35,220 | 東天虹 | 10 | 0.8 | 1,559 | 東京Tフィナンシャルグループ | 17.9 | 15.1 | 42,536 |
| ツルハホールディングス | 24.8 | 24.2 | 358,160 | いなげや | 13.8 | 12.4 | 22,034 | 九州フィナンシャルグループ | 203.1 | 183.4 | 114,441 |
| サンマルクホールディングス | 8 | 8 | 24,120 | 島忠 | 32 | 27 | 92,475 | ゆうちょ銀行 | 350.8 | 316.8 | 459,360 |
| フェリシモ | 3.6 | 2.9 | 3,659 | チヨダ | 14.6 | 13.2 | 35,508 | 富山第一銀行 | 31.6 | 28.5 | 14,421 |
| トリールホールディングス | 15.2 | 13.8 | 49,680 | ライフコーポレーション | 9.4 | 8.5 | 23,536 | ココロディア・フィナンシャルグループ | 811.1 | 680 | 428,400 |
| TOKYO BASE | - | 2.2 | 8,305 | リンガーハット | 13.1 | 13.8 | 32,678 | 西日本フィナンシャルホールディングス | 84 | 75.8 | 103,315 |
| サツドラホールディングス | 1.7 | 1.5 | 2,881 | さが実グループホールディングス | 11 | 10 | 1,160 | 新生銀行 | 1,179 | 96.8 | 163,979 |
| ダイユールリックホールディングス | 4.2 | 5.2 | 7,066 | MrMaxHD | 15.6 | 14 | 9,940 | おおぞら銀行 | 784 | 66.6 | 293,040 |
| パロクジャパンリミテッド | 7.3 | 8.9 | 8,107 | テンアライド | 12.5 | 10.6 | 4,876 | 三越FJフィナンシャルグループ | 9,387.8 | 7,901.7 | 6,258,146 |
| クスリのアオキホールディングス | 9.8 | 8.9 | 51,086 | AOKIホールディングス | 24.7 | 22.3 | 37,419 | りそなホールディングス | 1,449.4 | 1,227.4 | 774,366 |
| スシローホールディングス | - | 10.7 | 45,635 | オークワ | 18 | 16 | 17,264 | 三井住友トラストホールディングス | 258.6 | 219.9 | 979,214 |
| L I X I L ビバ | - | 10.6 | 21,549 | コメリ | 19.1 | 17.2 | 52,116 | 三井住友フィナンシャルグループ | 992 | 846.5 | 4,064,893 |
| メディカルシステムネットワーク | 14.1 | 12.7 | 7,581 | 青山商事 | 25.9 | 21.4 | 89,987 | 第四銀行 | 152 | 13.7 | 69,185 |
| 総合メディカル | 6 | 4.9 | 29,743 | しまむら | 14.4 | 13 | 160,160 | 北越銀行 | 13.4 | 11.2 | 27,540 |
| はるやまホールディングス | 5.7 | 5.2 | 5,543 | はせがわ | 4.8 | 5.9 | 2,938 | 千葉銀行 | 478 | 401 | 362,504 |
| ノジマ | 14.4 | 19.6 | 50,274 | 高島屋 | 208 | 175 | 193,550 | 群馬銀行 | 275.2 | 227.1 | 150,113 |
| カッパ・クワイエット | 17.5 | 13.9 | 17,208 | 松屋 | 27 | 22.5 | 33,705 | 武蔵野銀行 | 19.7 | 17.8 | 64,703 |
| ライトオン | 9.3 | 9.4 | 8,507 | エイチ・ツー・オー リテイリング | 63.4 | 52.9 | 110,455 | 千葉興業銀行 | 34.1 | 30.8 | 15,615 |
| ジーンズメイト | 4.6 | 3.4 | 3,022 | 近鉄百貨店 | 47 | 4.3 | 16,555 | 筑波銀行 | 51.6 | 46.6 | 17,941 |
| 良品計画 | 16.4 | 14.8 | 505,420 | 丸栄 | 26 | - | - | 七十七銀行 | 194 | 35.1 | 97,999 |
| 三城ホールディングス | 15.5 | 13.8 | 7,424 | パルコ | 11.8 | 10.7 | 16,017 | 青森銀行 | 96 | 8.7 | 30,493 |
| アドヴァン | 12.6 | 11.4 | 11,799 | 丸井グループ | 130.3 | 107 | 204,584 | 秋田銀行 | 81 | 7.2 | 21,420 |
| アルビス | 3.3 | 2.5 | 8,650 | アグリアル リテイリング | 9.6 | 9.3 | 38,083 | 山形銀行 | 70 | 12.6 | 30,025 |
| コナカ | 15.7 | 14.3 | 8,537 | 井筒屋 | 7 | 6.3 | 2,526 | 岩手銀行 | 8.1 | 7.8 | 33,774 |
| ハウス オブ ローゼ | 1.7 | 1.4 | 2,465 | イオン | 509.6 | 429.7 | 783,128 | 東邦銀行 | 111 | 99.9 | 38,861 |
| G-7ホールディングス | 3.7 | 3.3 | 7,982 | イズミ | 24.6 | 20.2 | 140,188 | 東北銀行 | 65 | 5.8 | 8,473 |
| イオン北海道 | 12.4 | 11.2 | 9,195 | 東武ストア | 1.5 | 1.3 | 3,399 | みちのく銀行 | 63 | 7.2 | 13,046 |
| コジマ | 18.4 | 19.3 | 6,407 | 平和堂 | 25.1 | 22.7 | 52,595 | ふくおかフィナンシャルグループ | 503 | 454 | 272,400 |
| ヒマラヤ | 3.9 | 3.1 | 3,676 | フジ | 13.8 | 13.1 | 28,846 | 静岡銀行 | 337 | 295 | 331,580 |
| コーナン商事 | 17.6 | 15.9 | 41,514 | ヤオコー | 14 | 12.7 | 64,770 | 十六銀行 | 166 | 15 | 45,150 |
| エコス | 4.8 | 4.5 | 5,629 | ゼビオホールディングス | 16.8 | 15.2 | 34,215 | スルガ銀行 | 126.7 | 114.4 | 246,646 |

| 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 八十二銀行 | 238.9 | | 129,738 | | | | 水戸証券 | 38.5 | 34.7 | 13,706 | | | エストラスト | 2.4 | 1.6 | 1,609 | | | | |
| 山梨中央銀行 | 77 | | 30,774 | | | | いちよし証券 | 27.7 | 23.5 | 30,949 | | | フージャースホールディングス | 16.1 | 27.2 | 19,121 | | | | |
| 大垣共立銀行 | 165 | 17.7 | 47,754 | | | | 松井証券 | 70.6 | 54.7 | 55,411 | | | オープンハウス | 17.9 | 18.2 | 106,834 | | | | |
| 福井銀行 | 106 | 9.6 | 24,681 | | | | だいてい証券ビジネス | 6.2 | 5.5 | 3,586 | | | 東急不動産ホールディングス | 299.5 | 270.8 | 213,932 | | | | |
| 北國銀行 | 131 | 12.7 | 55,816 | | | | マネックスグループ | 132.9 | 118.7 | 41,782 | | | 飯田グループホールディングス | 103.3 | 93.3 | 193,037 | | | | |
| 清水銀行 | 4.2 | 3.8 | 11,571 | | | | カブドットコム証券 | 92.3 | 71.6 | 26,850 | | | ムゲンエステート | 4 | 6.9 | 7,314 | | | | |
| 富山銀行 | 2.4 | 2.2 | 8,602 | | | | 樟東証券 | 16.6 | 15 | 23,655 | | | ファーストブラザーズ | 1.3 | 3.1 | 4,436 | | | | |
| 滋賀銀行 | 116 | 105 | 59,640 | | | | 岩井コスモホールディングス | 11.7 | 11.4 | 15,583 | | | ハウスドゥ | - | 1.8 | 4,305 | | | | |
| 南都銀行 | 12 | 13.1 | 39,431 | | | | 監簿証券 | 23.2 | 20.9 | 15,466 | | | シーアールイー | 1.8 | 1.8 | 2,874 | | | | |
| 百五銀行 | 111 | 107.3 | 58,156 | | | | マネーパートナーズグループ | 15.9 | 14.3 | 5,248 | | | ケイアイスター不動産 | - | 4 | 11,300 | | | | |
| 京都銀行 | 222 | 42.7 | 259,189 | | | | 小林洋行 | 4.3 | 3.3 | 924 | | | パーク 2 4 | 62.8 | 62 | 160,518 | | | | |
| 紀陽銀行 | 46.5 | 42 | 73,710 | | | | 保険業 (2.3%) | | | | | | バラカ | 3.6 | 3.6 | 8,722 | | | | |
| 三重銀行 | 5.6 | 5 | 11,970 | | | | かんぽ生命保険 | 46.8 | 42.2 | 118,117 | | | 三井不動産 | 657 | 558.5 | 1,453,496 | | | | |
| はくくフィナンシャルグループ | 82.4 | 74.4 | 118,668 | | | | SOMPOホールディングス | 259 | 219.3 | 910,533 | | | 三菱地所 | 921 | 832.5 | 1,606,725 | | | | |
| 広島銀行 | 365 | 165.1 | 144,297 | | | | ANICOM ホールディングス | 8.4 | 7.6 | 24,472 | | | 平和不動産 | 23.4 | 19.8 | 38,966 | | | | |
| 山陰合同銀行 | 74.4 | 66.3 | 69,084 | | | | M&Aアドバンストテクノホールディングス | 370.2 | 292.4 | 1,035,096 | | | 東京建物 | 143.7 | 122.2 | 206,273 | | | | |
| 中国銀行 | 87.8 | 77.3 | 105,746 | | | | ソニーフィナンシャルホールディングス | 118.7 | 91.9 | 185,546 | | | ダイビル | 31.9 | 28.8 | 38,764 | | | | |
| 鳥取銀行 | 4 | 3.6 | 6,372 | | | | 第一生命ホールディングス | 747.1 | 632.7 | 1,407,441 | | | 京阪神ビルディング | 20.6 | 18.6 | 16,089 | | | | |
| 伊予銀行 | 132.4 | 159.6 | 140,288 | | | | 東京海上ホールディングス | 501.9 | 421.3 | 2,092,175 | | | 住友不動産 | 297 | 268 | 1,036,892 | | | | |
| 百十四銀行 | 136 | 119 | 43,435 | | | | アドバンテックシステムズ | - | 2.7 | 3,099 | | | 大京 | 230 | 17.8 | 37,771 | | | | |
| 四国銀行 | 96 | 17.1 | 26,983 | | | | T&Dホールディングス | 451.5 | 345.9 | 656,518 | | | テオーシー | 48.1 | 38.6 | 33,350 | | | | |
| 阿波銀行 | 61.0 | 90 | 61,020 | | | | アドバンスクリエイト | 3 | 2.6 | 4,992 | | | 東京楽天地 | 21 | 1.8 | 9,504 | | | | |
| 大分銀行 | 71 | 6.4 | 26,848 | | | | その他金融業 (1.2%) | | | | | | レオパレス 2 1 | 156.3 | 133.5 | 112,407 | | | | |
| 宮崎銀行 | 83 | 7.4 | 25,345 | | | | 全国保証 | 34.9 | 31.5 | 147,735 | | | スターツコーポレーション | 12.6 | 15.2 | 42,955 | | | | |
| 佐賀銀行 | 75 | 6.8 | 17,061 | | | | アルビ | - | 9.6 | 12,796 | | | フジ住宅 | 15.8 | 14.3 | 11,654 | | | | |
| 十八銀行 | 76 | 69 | 20,010 | | | | フレディセゾン | 93.9 | 84.9 | 156,810 | | | 空港施設 | 15.1 | 11.7 | 7,230 | | | | |
| 沖縄銀行 | 12 | 10.9 | 48,559 | | | | アクリティア | 10.6 | 6.3 | 2,160 | | | 明和地所 | 7 | 6.2 | 5,133 | | | | |
| 琉球銀行 | 25.5 | 21.7 | 36,173 | | | | 芙蓉総合リース | 14.2 | 12.8 | 93,056 | | | 住友不動産販売 | 11.1 | - | - | | | | |
| セブン銀行 | 464.4 | 419.5 | 158,151 | | | | 興銀リース | 23.3 | 21 | 59,094 | | | ゴールドクレスト | 11.2 | 8.8 | 18,832 | | | | |
| みずほフィナンシャルグループ | 16,819.1 | 15,195.2 | 3,034,481 | | | | 東京センチュリー | 24.9 | 22.5 | 132,300 | | | 日本エスリード | 4.9 | 4.4 | 9,372 | | | | |
| 高知銀行 | 47 | 4.1 | 5,559 | | | | 日本証券金融 | 54.3 | 45.8 | 29,586 | | | 日神不動産 | 14.7 | 14.9 | 11,934 | | | | |
| 山口フィナンシャルグループ | 116 | 105 | 134,295 | | | | アイフル | 207.7 | 187.8 | 71,364 | | | 日本エスコン | 16.7 | 20.1 | 13,286 | | | | |
| 長野銀行 | 4.1 | 3.7 | 7,007 | | | | ポケットカード | 9.4 | - | - | | | タカラレベコ | 54.1 | 52.4 | 24,208 | | | | |
| 名古屋銀行 | 10.4 | 9 | 36,540 | | | | リコーリース | 9.7 | 8.8 | 32,340 | | | サンヨーハウジング名古屋 | 6.4 | 5.8 | 6,977 | | | | |
| 北洋銀行 | 202 | 168.6 | 63,899 | | | | イオンフィナンシャルサービス | 79.1 | 79.4 | 206,678 | | | イオンモール | 79.7 | 72.1 | 161,648 | | | | |
| 愛知銀行 | 4.2 | 3.8 | 20,406 | | | | アコム | 249 | 224.9 | 102,329 | | | ファースト住建 | 4.7 | 4.2 | 6,997 | | | | |
| 第三銀行 | 7.1 | 6.3 | 10,747 | | | | ジャックス | 68 | 13.6 | 34,272 | | | ランド | 64.4 | 241.4 | 3,862 | | | | |
| 中京銀行 | 5.1 | 4.6 | 10,626 | | | | ジョイントコーポレーション | 267.6 | 242.1 | 41,641 | | | カチタス | - | 11.4 | 34,884 | | | | |
| 大光銀行 | 44 | 3.8 | 9,047 | | | | 日立キャピタル | 29.2 | 30.8 | 89,135 | | | トーセイ | 17 | 13.6 | 17,571 | | | | |
| 愛媛銀行 | 14.7 | 15.6 | 21,013 | | | | アプラスフィナンシャル | 60.1 | 54.4 | 5,657 | | | 穴吹興産 | 1.4 | 1.2 | 3,756 | | | | |
| トヨタ銀行 | 4.9 | 4.3 | 6,574 | | | | オリックス | 877.3 | 746 | 1,423,368 | | | エヌ・ティ・ティ都市開発 | 76.9 | 69.5 | 87,917 | | | | |
| みなと銀行 | 11.2 | 10.1 | 20,886 | | | | 三菱UFJ F リース | 314.2 | 283.9 | 193,903 | | | サンフロントリア不動産 | 13.3 | 12.6 | 14,779 | | | | |
| 京葉銀行 | 101 | 99 | 50,589 | | | | 九州リースサービス | - | 4.8 | 4,180 | | | エフ・ジェー・ネクスト | 10.9 | 8.6 | 7,509 | | | | |
| 関西アーバン銀行 | 17.3 | 15.6 | 22,011 | | | | 日本取引所グループ | 385.2 | 328.6 | 609,553 | | | インテリックス | - | 3.2 | 3,536 | | | | |
| 栃木銀行 | 68.3 | 57.9 | 25,070 | | | | イー・ギヤランティ | 3.7 | 3 | 11,130 | | | ランドビジネス | 8 | 6.9 | 2,277 | | | | |
| 北日本銀行 | 3.9 | 3.5 | 10,640 | | | | アサックス | 2.3 | 1.6 | 3,003 | | | グランディハウス | 11.1 | 9.9 | 4,435 | | | | |
| 東和銀行 | 233 | 19.6 | 27,165 | | | | NECキャピタルソリューション | 5 | 4.6 | 9,798 | | | 日本空港ビルディング | 39.5 | 32.7 | 131,944 | | | | |
| 福島銀行 | 136 | 10.6 | 8,734 | | | | 不動産業 (2.4%) | | | | | | サービス業 (4.1%) | | | | | | | |
| 大東銀行 | 65 | 5.4 | 8,213 | | | | いちご | 117.8 | 159.8 | 69,832 | | | 日本工営 | 8.8 | 7.3 | 24,382 | | | | |
| トモニホールディングス | 102.2 | 92.2 | 48,036 | | | | 日本駐車場開発 | 149.6 | 135.1 | 24,182 | | | L I F U L L | 32.5 | 37.7 | 31,969 | | | | |
| フィデアホールディングス | 120.4 | 108.6 | 20,634 | | | | ヒューリック | 258.4 | 233.5 | 294,910 | | | ジェイエシールグループメント | 8.1 | 8.7 | 17,982 | | | | |
| 油断州ホールディングス | 131.4 | 118.6 | 49,100 | | | | 三栄建築設計 | 5 | 4.5 | 9,387 | | | 日本M&Aセンター | 37.9 | 37.5 | 240,750 | | | | |
| 証券・商品先物取引業 (1.0%) | | | | | | | スター・マイカ | - | 4.1 | 7,244 | | | メンパーズ | - | 2.7 | 2,076 | | | | |
| F P G | 44.2 | 39.1 | 53,097 | | | | 野村不動産ホールディングス | 82.2 | 74.4 | 181,684 | | | 中広 | 1.4 | 1.2 | 872 | | | | |
| マーキュリアインベストメント | - | 2.3 | 2,849 | | | | 三重交通グループホールディングス | 22.1 | 22.7 | 10,850 | | | タケエイ | 11.6 | 11.3 | 13,752 | | | | |
| S B Iホールディングス | 140 | 126.5 | 275,770 | | | | サムティ | 10 | 9.5 | 17,166 | | | トラスト・テック | 5.4 | 4.9 | 14,082 | | | | |
| 日本アジア投資 | 12.2 | 10.1 | 3,737 | | | | ディア・ライフ | 8.8 | 11.3 | 6,802 | | | コダカホールディングス | 4.5 | 5.7 | 34,428 | | | | |
| ジャフコ | 20.7 | 16.1 | 88,711 | | | | コーセーアールイー | - | 1.9 | 2,021 | | | パソナグループ | 11.4 | 10.3 | 23,051 | | | | |
| 大和証券グループ本社 | 1,159 | 957 | 709,806 | | | | イー・ディー・ワークス | 116.1 | 150 | 6,150 | | | CDS | 3.2 | 3 | 3,807 | | | | |
| 野村ホールディングス | 2,532.8 | 1,924 | 1,264,068 | | | | 日本商業開発 | 6.9 | 6.3 | 10,993 | | | リンクアンドモチベーション | 29.8 | 19.9 | 16,755 | | | | |
| 岡三証券グループ | 105 | 95 | 64,980 | | | | フルサンスコーポレーション | 19.3 | 15.3 | 23,011 | | | GCA | 11.7 | 12.4 | 11,928 | | | | |
| 丸三証券 | 39.4 | 35.6 | 35,813 | | | | ユニソホールディングス | 10.2 | 13.1 | 37,086 | | | エス・エム・エス | 18.5 | 21.4 | 83,246 | | | | |
| 東洋証券 | 44 | 40 | 12,520 | | | | T H E グローバル社 | 4.9 | 5.3 | 4,897 | | | パーソルホールディングス | 101.4 | 100 | 247,600 | | | | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 142 | 123.8 | 97,059 | | | | 日本管理センター | 8.9 | 7.4 | 11,225 | | | リニカル | 7.8 | 7 | 10,444 | | | | |
| 光世証券 | 30 | 2.7 | 3,815 | | | | サンセイランディック | 2.7 | 3.3 | 4,118 | | | クックパッド | 29.3 | 34.1 | 21,278 | | | | |

| 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 |
| エスクリ | | 千株 | | 千株 | | 千円 | ビー・エム・エル | | 千株 | | 千株 | | 千円 | 長 大 | | 千株 | | 千株 | | 千円 |
| アイ・ケイ・ケイ | 4.7 | | 3.8 | | 3,792 | | ワタベウエディング | 17.2 | 13.9 | | 40,059 | | 燐ホールドイングス | | 2.6 | | 2.6 | | 2,610 | |
| 学情 | 6 | | 6.4 | | 4,800 | | りらいあコミュニケーションズ | 2.1 | 1.8 | | 1,144 | | スバル興業 | | 10 | | 0.8 | | 5,176 | |
| スタジオアリス | 5.5 | | 5 | | 7,530 | | リソー教育 | 21.7 | 17.1 | | 23,563 | | 東京テアトル | | 52 | | 4.5 | | 6,457 | |
| シミックホールディングス | 5.4 | | 5.4 | | 14,612 | | 早稲田アカデミー | 22.4 | 18.4 | | 14,572 | | タナベ経営 | | 2.7 | | 2.1 | | 3,866 | |
| N J S | 6.7 | | 6 | | 15,144 | | ユー・エス・エス | 1.9 | 1.6 | | 2,702 | | ナガワ | | 2.4 | | 2.2 | | 9,856 | |
| 総合警備保障 | 3 | | 2.7 | | 4,155 | | 東京個別指導学院 | 158.7 | 132.3 | | 297,542 | | よみうりランド | | 26 | | 2.4 | | 11,340 | |
| カクコム | 47.7 | | 43.1 | | 218,086 | | サイバーエージェント | 4.4 | 3.8 | | 4,590 | | 常磐興産 | | 90 | | 8.1 | | 32,562 | |
| アイロムグループ | 93.6 | | 83.3 | | 141,526 | | 楽天 | 69 | 71.2 | | 298,328 | | カナモト | | 5 | | 4.4 | | 8,052 | |
| セントゲア・ホールディング | 3.9 | | 3.7 | | 6,571 | | クリーク・アンド・リバー社 | 670 | 555.6 | | 521,986 | | 東京ドーム | | 18.3 | | 16.5 | | 54,202 | |
| サイネックス | — | | 4.6 | | 3,307 | | デー・オー・ダブリュ | 4.7 | 5.6 | | 5,611 | | 西尾レントオール | | 52.3 | | 43.9 | | 43,504 | |
| ルネサンス | — | | 1.6 | | 1,428 | | セントラルスポーツ | 10.6 | 9.7 | | 8,836 | | アゴラ・ホスピタリティ・グループ | | 10.6 | | 9.5 | | 36,812 | |
| ディップ | 6.8 | | 5.3 | | 9,290 | | フルキャストホールディングス | 4.5 | 4 | | 15,700 | | トランス・コスモス | | 72 | | 62 | | 2,294 | |
| オプトホールディング | 17 | | 15.3 | | 48,960 | | リソルホールディングス | 13.5 | 9.5 | | 21,422 | | 乃村工務社 | | 15.2 | | 12 | | 32,820 | |
| 新日本科学 | 9.3 | | 7.6 | | 10,047 | | テクノロ・ホールディングス | 13 | 1.2 | | 4,812 | | 藤田観光 | | 28.1 | | 25.3 | | 57,102 | |
| ツワイ | 13.9 | | 13.2 | | 6,877 | | インターワークス | 21.3 | 19.3 | | 115,607 | | 日本管財 | | 43 | | 4.3 | | 14,018 | |
| キャリアデザインセンター | 31.2 | | 25.5 | | 21,726 | | イー・ガーデン | — | 1.9 | | 1,577 | | トーカイ | | 72 | | 6.7 | | 11,048 | |
| エムスリー | 2.8 | | 2.5 | | 5,485 | | ファーストロジック | 2.6 | 2.4 | | 2,599 | | 白洋舎 | | 11.3 | | 11.6 | | 23,977 | |
| ツカガ・グローバルホールディング | 113.6 | | 114 | | 440,610 | | 三機サービス | 1.5 | 3.5 | | 4,389 | | セコム | | 5.8 | | 10.5 | | 26,050 | |
| プラス | 9.6 | | 8.7 | | 5,367 | | Gunosy | 0.7 | 1.7 | | 1,492 | | セントラル警備保障 | | 0.5 | | 1.2 | | 4,578 | |
| アウトソーシング | — | | 0.6 | | 594 | | デザインワン・ジャパン | — | 4.9 | | 12,588 | | 丹青社 | | 136.4 | | 115 | | 923,450 | |
| ウエルネット | 7.5 | | 31.3 | | 61,014 | | リブセンス | — | 2.1 | | 2,612 | | メイテック | | 5.8 | | 5.2 | | 12,682 | |
| ワールドホールディングス | 9.9 | | 1.1 | | 12,243 | | ジャパンマテリアル | 4.3 | 5.5 | | 16,802 | | アサツブ ディ・ケイ | | 22.7 | | 22.2 | | 24,375 | |
| ディー・エヌ・エー | 58.8 | | 58.4 | | 128,947 | | ベクトル | 9.3 | 7.1 | | 3,592 | | いであ | | 15.9 | | 12.7 | | 76,454 | |
| 博報堂DYホールディングス | 181.8 | | 150.6 | | 241,411 | | ウチヤマホールディングス | 9.6 | 9.9 | | 40,590 | | 学究社 | | 21.4 | | — | | — | |
| ぐるなび | 19 | | 17.2 | | 23,994 | | ライクキッズネクスト | 10.7 | 13 | | 29,809 | | 応用地質 | | 12.4 | | 12.2 | | 16,421 | |
| エスアールジータカミヤ | 14.3 | | 12.8 | | 8,294 | | キャリアリンク | 6.3 | 5.4 | | 2,959 | | 鉛井総研ホールディングス | | 16.9 | | 22.5 | | 50,557 | |
| ジャパネットホリクス | 17.3 | | 13.5 | | 9,976 | | I B J | 1.1 | 2.092 | | 2,092 | | 進学会ホールディングス | | 5.5 | | 5 | | 3,135 | |
| ファンコミュニケーションズ | 33.4 | | 30.2 | | 23,978 | | アサンテ | 3.1 | 3.1 | | 1,736 | | オオバ | | 9.7 | | 8.6 | | 4,497 | |
| ライク | 2.8 | | 4.3 | | 8,281 | | N・フィールド | 10.3 | 8.6 | | 8,264 | | ニチエキ館 | | — | | 2.2 | | 2,455 | |
| ビジネス・ブレークスルー | — | | 5.2 | | 2,392 | | バリユーHR | 4.9 | 3.9 | | 6,977 | | ダイセキ | | 3.5 | | 3 | | 4,893 | |
| WDBホールディングス | 4.8 | | 5 | | 16,750 | | M&Aキャピタルパートナーズ | 6.2 | 6.1 | | 9,339 | | パネッセルホールディングス | | 43.9 | | 39.7 | | 152,249 | |
| ティア | 6.5 | | 5.7 | | 6,195 | | ライドオプティクスホールディングス | — | 2.5 | | 5,330 | | イオンディスプレイ | | 14.8 | | 13.4 | | 50,049 | |
| CDG | — | | 1 | | 1,797 | | RIホールディングス | 1.7 | 2.2 | | 17,402 | | ナック | | 8.1 | | 7.3 | | 7,438 | |
| パリュエコマース | 12.9 | | 9.7 | | 10,796 | | アドビシステムズホールディングス | 3.1 | 4.4 | | 4,554 | | ニチエキ館 | | 22.8 | | 20.6 | | 27,439 | |
| インフォーマット | 55.7 | | 54.8 | | 42,963 | | アビスト | 3.7 | 3.1 | | 2,867 | | ステップ | | 22.9 | | 18.2 | | 57,148 | |
| J Pホールディングス | 37.8 | | 34.1 | | 9,991 | | シグマクシス | 2.1 | 1.5 | | 7,192 | | 合計 | | 4.5 | | 4 | | 7,148 | |
| ECHONAKホールディングス | 44 | | 21.7 | | 2,604 | | ウィルグループ | — | 4.3 | | 6,978 | | 株数・金額 | | 189,859,445 | | 137,421.8 | | 283,752,429 | |
| E P Sホールディングス | 16.3 | | 16.3 | | 36,609 | | エスクロー・エージェント・ジャパン | 5.4 | 4.7 | | 8,756 | | 銘柄数<比率> | | 1,968銘柄 | | 2,049銘柄 | | <98.1%> | |
| レックス | 3 | | 2.7 | | 2,130 | | 日本ビユーホテル | — | 14.9 | | 6,585 | | (注1) | | 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。 | | | | | |
| プラスステージ・インターナショナル | 18.7 | | 22.5 | | 30,060 | | リクルートホールディングス | 1.9 | 2.4 | | 3,518 | | (注2) | | 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。 | | | | | |
| アミューズ | 7.3 | | 7.2 | | 23,256 | | エラン | 286.5 | 835.9 | | 2,067,180 | | (注3) | | 評価額の単位未満は切捨ててあります。 | | | | | |
| ドリームインキュベータ | 4 | | 3.6 | | 8,910 | | 土木管理総合試験所 | 1.7 | 2.7 | | 3,855 | | | | | | | | | |
| クイック | 6.8 | | 6.7 | | 12,066 | | 日本郵政 | — | 3.3 | | 1,966 | | | | | | | | | |
| T A C | 7.7 | | 6.7 | | 2,056 | | ベルシテム24ホールディングス | 341.9 | 614.8 | | 786,944 | | | | | | | | | |
| ケネディクス | 166.2 | | 143.5 | | 95,140 | | 鎌倉新書 | 20 | 18.2 | | 27,573 | | | | | | | | | |
| 電通 | 146.1 | | 132 | | 603,900 | | 一蔵 | — | 1.5 | | 3,391 | | | | | | | | | |
| ティクアンドギガ・ニース | 6.3 | | 5.1 | | 5,242 | | L I T A L I C O | — | 1.4 | | 1,488 | | | | | | | | | |
| ぴあ | 4 | | 3.6 | | 23,868 | | グローバルグループ | — | 1.9 | | 3,991 | | | | | | | | | |
| イオンファンタジー | 3.9 | | 3.5 | | 17,605 | | エポラブルアジア | — | 1.2 | | 1,783 | | | | | | | | | |
| シーティーエス | 3.6 | | 11.1 | | 8,180 | | ストライク | — | 2.2 | | 4,752 | | | | | | | | | |
| ネクシィーズグループ | 4.7 | | 4.3 | | 7,297 | | ソラスト | — | 1 | | 5,800 | | | | | | | | | |
| みらかホールディングス | 33.5 | | 32.3 | | 139,051 | | セラク | 6 | 6.5 | | 18,271 | | | | | | | | | |
| アルプス技研 | 5.3 | | 9.5 | | 19,684 | | インソース | — | 1.9 | | 1,352 | | | | | | | | | |
| サニックス | 22 | | 17.4 | | 3,810 | | キャリアインデックス | — | 1.3 | | 4,277 | | | | | | | | | |
| ダイオーズ | 2.6 | | 2.2 | | 2,904 | | MS-Japan | — | 1.1 | | 2,162 | | | | | | | | | |
| 日本空調サービス | 12.8 | | 11.4 | | 8,401 | | リログループ | — | 0.8 | | 4,832 | | | | | | | | | |
| オリエンタルランド | 141.7 | | 128 | | 1,292,160 | | 東祥 | 4.9 | 59.3 | | 175,646 | | | | | | | | | |
| ダスキン | 33.6 | | 29.1 | | 77,958 | | エイチ・アイ・エス | 2.8 | 6.7 | | 24,220 | | | | | | | | | |
| 明光ネットワークジャパン | 16.3 | | 13.7 | | 17,385 | | ラックランド | 21.4 | 16.9 | | 64,135 | | | | | | | | | |
| ファルコホールディングス | 6.3 | | 5.6 | | 9,576 | | 共立メンテナンス | 2.2 | 2.1 | | 4,405 | | | | | | | | | |
| 秀英予備校 | 2.9 | | 2.4 | | 1,152 | | イチネンホールディングス | 10.6 | 19.3 | | 83,183 | | | | | | | | | |
| 田谷 | 2.6 | | 2 | | 1,340 | | 建設技術研究所 | 13.9 | 12.1 | | 18,428 | | | | | | | | | |
| ラウンドワン | 41 | | 33.6 | | 62,025 | | スペース | 8.4 | 7.5 | | 8,827 | | | | | | | | | |
| リゾートトラスト | 50.8 | | 45.9 | | 113,510 | | | 7 | 7 | | 10,311 | | | | | | | | | |

(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 2,185 | | 百万円 - |

■投資信託財産の構成

2018年2月7日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|-------------------|---|-----------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 株 式 | 千円 283,752,429 | | % 96.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 8,967,814 | | 3.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 292,720,244 | | 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

(2018年2月7日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 294,327,744,175円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 5,221,962,696 |
| 株 式(評価額) | 283,752,429,300 |
| 未 収 入 金 | 3,207,349,100 |
| 未 配 当 金 | 408,873,079 |
| 差 入 委 託 証 拠 | 1,737,130,000 |
| (B) 負 債 | 5,089,174,148 |
| 未 払 解 約 有 価 証 券 | 108,901,148 |
| 未 入 委 託 証 拠 金 代 用 | 3,372,773,000 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 代 用 | 1,607,500,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 289,238,570,027 |
| 元 次 期 繰 越 損 益 本 金 | 109,428,148,369 |
| (D) 受 益 当 たり 総 損 益 口 数 | 179,810,421,658 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D) | 109,428,148,369円 |
| | 26,432円 |

(注1) 期首元本額 126,730,528,618円
 追加設定元本額 21,919,995,643円
 一部解約元本額 39,222,375,892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 | 8,527,416,376円 |
| D I A M 国内株式パッシブ・ファンド | 1,876,669,491円 |
| M I T O ラップ型ファンド(安定型) | 4,058,956円 |
| M I T O ラップ型ファンド(中立型) | 9,163,587円 |
| M I T O ラップ型ファンド(積極型) | 17,247,960円 |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 19,644,822円 |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 15,103,701円 |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 11,638,894円 |
| たわらノーロード TOP I X | 133,947,908円 |
| たわらノーロード バランス(8資産均等型) | 11,761,649円 |
| たわらノーロード バランス(堅実型) | 125,101円 |
| たわらノーロード バランス(標準型) | 1,076,337円 |
| たわらノーロード バランス(積極型) | 3,879,083円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型) | 14,597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) | 186,393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) | 349,317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) | 441,025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) | 944,055円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(保守型) | 37,778円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型) | 33,023円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安成型) | 299,108円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型) | 326,987円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型) | 954,131円 |
| D I A M 国内株式インデックスファンド<DC年金> | 36,179,079,727円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 740,060,350円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 2,660,351,109円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 2,764,797,796円 |
| D I A M D C バランス30インデックスファンド | 323,312,556円 |
| D I A M D C バランス50インデックスファンド | 1,119,268,669円 |
| D I A M D C バランス70インデックスファンド | 1,049,315,773円 |
| マネックス資産設計ファンド(隔月分配型) | 47,106,085円 |
| マネックス資産設計ファンド(育成型) | 1,171,577,546円 |
| マネックス資産設計ファンド エゴリユーション | 24,024,004円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10) | 38,663,041円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20) | 96,018,721円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30) | 187,463,022円 |
| 投資のソムリエ | 1,425,039,544円 |
| クルーズコントロール | 742,851,962円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 98,587,223円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> | 146,987,989円 |
| D I A M D C バランス・F(成長型) | 200,841,570円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 280,295円 |
| D I A M コア資産設計ファンド(堅実型) | 4,871,101円 |
| D I A M コア資産設計ファンド(積極型) | 14,849,802円 |

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 31,638,887円
 ダイナミック・ナビゲーション 2,035,658円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 480,182,820円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045) 563,249円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055) 625,990円
 投資のソムリエ世界8資産バランスファンド(DC) 150,120円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035) 1,043,053円
 D I A M ワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) 70,701,371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) 134,139,818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) 293,336,654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) 16,233,373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) 70,316,222円
 D I A M 国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) 19,820,211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) 24,744,260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) 31,638,558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) 58,546,806円
 D I A M バランスファンド25VA(適格機関投資家限定) 1,078,582,552円
 D I A M バランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定) 1,021,293,696円
 D I A M バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) 2,792,304,258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) 202,887,062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) 98,032,612円
 D I A M アクア グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) 599,115,283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) 1,746,402,985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) 10,313,671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) 39,787,583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) 1,187,470,230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) 15,107,175,247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) 541,990,149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) 1,727,888,538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) 9,861,006,706円
 D I A M バランス30VA(適格機関投資家限定) 519,843円
 D I A M バランス50VA(適格機関投資家限定) 9,093,798円
 D I A M バランス70VA(適格機関投資家限定) 3,718,064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) 8,771,394,616円
 D I A M 世界バランス25VA(適格機関投資家限定) 70,413,424円
 D I A M 国内バランス30VA(適格機関投資家限定) 27,752,854円
 D I A M バランス20VA(適格機関投資家限定) 18,240,489円
 D I A M バランス40VA(適格機関投資家限定) 15,682,249円
 D I A M バランス60VA(適格機関投資家限定) 109,957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) 426,902,115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) 1,323,021,834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) 1,764,382,103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) 76,281,237円
 期末元本合計 109,428,148,369円

(注3) 担保資産
 代用として担保を提供している資産は次の通りです。
 株式 3,686,000,000円

■損益の状況

当期 自2017年2月8日 至2018年2月7日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 6,081,475,779円 |
| 受 取 配 当 金 | 6,079,847,739 |
| 受 取 利 息 | 3,392 |
| そ の 他 収 益 | 5,871,763 |
| 支 払 利 息 | △4,247,115 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 42,723,911,309 |
| 売 買 益 | 47,938,414,181 |
| 売 買 損 | △5,214,502,872 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 1,255,104,788 |
| 取 引 益 | 1,894,254,620 |
| 取 引 損 | △639,149,832 |
| (D) そ の 他 費 用 | △2,422,683 |
| (E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D) | 50,058,069,193 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 157,518,902,888 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △60,094,557,780 |
| (H) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 32,328,007,357 |
| (I) 合 計(E + F + G + H) | 179,810,421,658 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I) | 179,810,421,658 |

(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)

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15期（決算日 2018年2月21日）

（計算期間 2017年2月22日～2018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15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、「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）」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 | | シティ世界国債インデックス | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|-----------------------------|-------|--------|--------|---------|
| | 円 | 期中騰落率 | （除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（ベンチマーク） | 期中騰落率 | | | |
| 11期（2014年2月21日） | 16,392 | 13.0% | 102,469.19 | 12.6% | 97.6% | - | 383,685 |
| 12期（2015年2月23日） | 18,820 | 14.8% | 117,697.87 | 14.9% | 97.5% | - | 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 |

（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）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）シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックス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）。

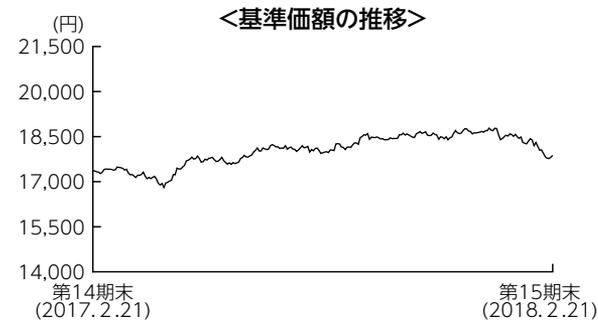
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 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) (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) 2017 年 2 月 21 日 | 円 17,364 | % - | ポイント 108,792.68 | % - | % 97.9 | % - |
| 2 月 末 | 17,314 | △0.3 | 108,568.93 | △0.2 | 97.3 | - |
| 3 月 末 | 17,317 | △0.3 | 108,641.98 | △0.1 | 96.8 | - |
| 4 月 末 | 17,422 | 0.3 | 109,024.53 | 0.2 | 96.9 | - |
| 5 月 末 | 17,684 | 1.8 | 110,685.94 | 1.7 | 97.7 | - |
| 6 月 末 | 18,019 | 3.8 | 112,709.17 | 3.6 | 98.4 | - |
| 7 月 末 | 18,008 | 3.7 | 112,671.90 | 3.6 | 98.2 | - |
| 8 月 末 | 18,265 | 5.2 | 114,354.58 | 5.1 | 98.1 | - |
| 9 月 末 | 18,469 | 6.4 | 115,558.22 | 6.2 | 97.8 | - |
| 10 月 末 | 18,471 | 6.4 | 115,508.10 | 6.2 | 97.4 | - |
| 11 月 末 | 18,487 | 6.5 | 115,672.53 | 6.3 | 97.9 | - |
| 12 月 末 | 18,719 | 7.8 | 117,078.37 | 7.6 | 98.1 | - |
| 2018 年 1 月 末 | 18,258 | 5.1 | 114,201.85 | 5.0 | 96.9 | - |
| (期 末) 2018 年 2 月 21 日 | 17,876 | 2.9 | 111,885.82 | 2.8 | 97.7 | - |

(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2月22日から2018年2月21日まで）

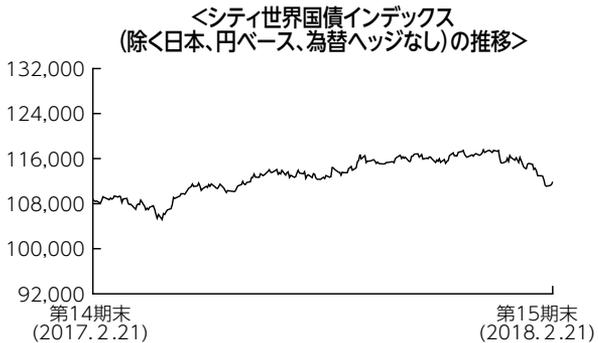


基準価額の推移

当ファンドの基準価額は17,876円となり、前期末比で2.9%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

世界的に景気が回復していることを背景にして、対ドイツ国債スプレッド（利回り格差）が広がっていたイタリア、スペイン、フランス等の国債利回りが低下（価格は上昇）したことや、ECB（欧州中央銀行）による金融政策の正常化が強く意識され円安ユーロ高が進んだことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、期初から2017年3月下旬にかけてFOMC（米連邦公開市場委員会）における利上げが意識されたことから債券利回りは上昇（価格は下落）して始まりました。米国のシリアへの空爆や北朝鮮情勢の緊迫化などが債券利回りの低下要因となった一方、各国中央銀行関係者が相次いで利上げに前向きな発言をしたことなどが上昇要因となり、12月末まではレンジ内の動きとなりました。年が明けると、株式市場の上昇や経済指標が良好だったことなどを背景にして期末にかけて債券利回りは上昇しました。

為替市場では、円は対ドルに対しては円高が進み、対ユーロに対しては円安が進みました。対ドルでは、2017年12月までレンジ内の動きとなりましたが、年が明けると、日銀による金融政策の正常化が意識されたことや、株式市場の急落からリスク回避的な動きが強まったことを背景にして、期末にかけて円高が進みました。一方、対ユーロでは、ECBによる金融政策の正常化が意識されたことなどから、円安が進みました。

ポートフォリオについて

ベンチマーク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 | 44.3% | △0.1% | |
| | カナダ | 2.2% | △0.0% | |
| | 計 | 46.4% | △0.2% | |
| 中南米 | メキシコ | 0.8% | △0.0% | |
| | 計 | 0.8% | △0.0% | |
| 欧州 | オーストリア | 1.5% | △0.1% | |
| | ベルギー | 2.5% | △0.1% | |
| | フィンランド | 0.6% | △0.1% | |
| | フランス | 9.9% | △0.3% | |
| | ドイツ | 7.3% | △0.1% | |
| | アイルランド | 0.8% | △0.1% | |
| | イタリア | 9.5% | △0.2% | |
| | オランダ | 2.3% | △0.1% | |
| | スペイン | 5.6% | △0.2% | |
| | ユーロ計 | 38.7% | 39.9% | △1.2% |
| | デンマーク | 0.6% | 0.6% | △0.1% |
| | スウェーデン | 0.4% | 0.5% | △0.1% |
| | スイス | 0.0% | 0.2% | △0.2% |
| | 英国 | 7.1% | 7.2% | △0.1% |
| ポーランド | 0.6% | 0.6% | △0.1% | |
| ノルウェー | 0.2% | 0.3% | △0.1% | |
| | 計 | 47.5% | 49.3% | △1.7% |
| 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 | 0.4% | 0.4% | △0.0% |
| | マレーシア | 0.4% | 0.4% | △0.1% |
| | 計 | 2.8% | 2.9% | △0.1% |
| アフリカ | 南アフリカ | 0.5% | 0.5% | △0.0% |
| | 計 | 0.5% | 0.5% | △0.0% |
| 現金など | 2.1% | - | - | |
| 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 | 41.3% | △0.6% | |
| | カナダ | 2.1% | 2.2% | △0.1% |
| | 計 | 43.4% | 44.1% | △0.7% |
| 中南米 | メキシコ | 0.8% | 0.8% | △0.0% |
| | 計 | 0.8% | 0.8% | △0.0% |
| 欧州 | オーストリア | 1.6% | 1.6% | △0.1% |
| | ベルギー | 2.5% | 2.7% | △0.1% |
| | フィンランド | 0.6% | 0.6% | △0.0% |
| | フランス | 10.3% | 10.5% | △0.2% |
| | ドイツ | 7.1% | 7.2% | △0.1% |
| | アイルランド | 0.8% | 0.9% | △0.1% |
| | イタリア | 10.0% | 10.2% | △0.2% |
| | オランダ | 2.1% | 2.1% | △0.1% |
| | スペイン | 5.9% | 6.1% | △0.1% |
| | ユーロ計 | 40.9% | 41.9% | △1.0% |
| | デンマーク | 0.6% | 0.6% | △0.0% |
| スウェーデン | 0.5% | 0.5% | △0.0% | |
| スイス | 0.0% | 0.2% | △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% | 2.3% | △0.1% |
| | シンガポール | 0.4% | 0.4% | △0.0% |
| | マレーシア | 0.4% | 0.5% | △0.1% |
| | 計 | 2.9% | 3.1% | △0.2% |
| アフリカ | 南アフリカ | 0.6% | 0.6% | △0.0% |
| | 計 | 0.6% | 0.6% | △0.0% |
| 現金など | 2.3% | - | - | |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | - | |

(注) 世界国債インデックスとはシティ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2.8%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で+0.1%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、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 | 0.012% |
| （保 管 費 用） | (2) | (0.010) |
| （そ の 他） | (0) | (0.001) |
| 合 計 | 2 | 0.012 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(18,042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8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2月22日から2018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 184,922 | 千アメリカ・ドル 293,487 | |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダ・ドル 14,554 | 千カナダ・ドル 20,648 | |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル 7,723 | 千オーストラリア・ドル 10,364 | |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポール・ドル 1,611 | 千シンガポール・ドル 2,641 | |
| | イギリス | 国債証券 | 千イギリス・ポンド 12,285 | 千イギリス・ポンド 32,531 | |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ 3,570 | 千デンマーク・クローネ 14,678 | |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ 7,841 | 千ノルウェー・クローネ 660 | |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデン・クローナ 7,996 | 千スウェーデン・クローナ 10,435 | |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ 39,926 | 千メキシコ・ペソ 79,526 | |
| | マレーシア | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット 1,908 | 千マレーシア・リンギット 6,039 | |
| | 南アフリカ | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド 14,403 | 千南アフリカ・ランド 19,987 | |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ 9,062 | 千ポーランド・ズロチ 14,268 | |
| 国 | ユーロ | アイルランド | 国債証券 | 千ユーロ 1,949 | 千ユーロ 3,818 |
| | | オランダ | 国債証券 | 3,472 | 12,666 |
| | | ベルギー | 国債証券 | 3,044 | 10,672 |
| | | フランス | 国債証券 | 17,867 | 46,456 |
| | | ドイツ | 国債証券 | 16,502 | 42,841 |
| | | スペイン | 国債証券 | 13,469 | 27,530 |
| | | イタリア | 国債証券 | 17,625 | 44,913 |
| | | フィンランド | 国債証券 | 687 | 2,167 |
| | オーストリア | 国債証券 | 2,994 | 4,836 | |

(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 (2017年2月22日から2018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 846,210 | 千アメリカ・ドル 837,189 | 千円 90,031,363 | % 41.3 | % - | % 16.9 | % 15.7 | % 8.8 | |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 50,650 | 千カナダ・ドル 53,987 | 千円 4,590,516 | 2.1 | - | 0.9 | 0.7 | 0.5 | |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 52,700 | 千オーストラリア・ドル 55,466 | 千円 4,706,926 | 2.2 | - | 1.4 | 0.6 | 0.2 | |
| シンガポール | 千シンガポール・ドル 9,250 | 千シンガポール・ドル 9,550 | 千円 778,949 | 0.4 | - | 0.2 | 0.2 | - | |
| イギリス | 千イギリス・ポンド 83,200 | 千イギリス・ポンド 101,610 | 千円 15,301,492 | 7.0 | - | 5.0 | 1.5 | 0.5 | |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 57,770 | 千デンマーク・クローネ 70,609 | 千円 1,257,549 | 0.6 | - | 0.4 | 0.1 | 0.1 | |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 43,360 | 千ノルウェー・クローネ 45,354 | 千円 622,265 | 0.3 | - | 0.2 | 0.1 | 0.0 | |
| スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ 66,280 | 千スウェーデン・クローナ 74,882 | 千円 994,434 | 0.5 | - | 0.2 | 0.2 | 0.1 | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 287,000 | 千メキシコ・ペソ 292,501 | 千円 1,681,884 | 0.8 | - | 0.5 | 0.2 | 0.1 | |
| マレーシア | 千マレーシア・リングギット 33,430 | 千マレーシア・リングギット 33,363 | 千円 918,489 | 0.4 | - | 0.2 | 0.1 | 0.0 | |
| 南アフリカ | 千南アフリカ・ランド 155,240 | 千南アフリカ・ランド 148,622 | 千円 1,362,871 | 0.6 | - | 0.6 | 0.0 | - | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 43,900 | 千ポーランド・ズロチ 45,657 | 千円 1,459,674 | 0.7 | - | 0.2 | 0.4 | 0.1 | |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | | | | |
| アイルランド | 11,690 | 13,006 | 1,725,608 | 0.8 | - | 0.5 | 0.2 | 0.1 | |
| オランダ | 29,660 | 34,239 | 4,542,619 | 2.1 | - | 1.3 | 0.6 | 0.2 | |
| ベルギー | 34,830 | 41,872 | 5,555,222 | 2.5 | - | 1.8 | 0.6 | 0.2 | |
| フランス | 144,580 | 169,206 | 22,448,608 | 10.3 | - | 6.6 | 2.7 | 1.0 | |
| ドイツ | 101,280 | 116,732 | 15,486,921 | 7.1 | - | 4.0 | 2.3 | 0.9 | |
| スペイン | 83,630 | 97,575 | 12,945,318 | 5.9 | - | 3.8 | 1.5 | 0.7 | |
| イタリア | 144,250 | 163,824 | 21,734,606 | 10.0 | - | 5.9 | 2.9 | 1.2 | |
| フィンランド | 8,700 | 9,556 | 1,267,806 | 0.6 | - | 0.4 | 0.2 | 0.0 | |
| オーストリア | 21,660 | 25,571 | 3,392,630 | 1.6 | - | 1.0 | 0.4 | 0.2 | |
| 合 計 | - | - | 千円 212,805,760 | 97.7 | - | 51.7 | 31.3 | 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 | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 期 評 価 額 | | 末 償還年月日 |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|
| | | | | 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 2.125 01/31/21 | 国債証券 | 2.1250 | 5,000 | 4,959 | 533,328 | 2021/01/31 |
| US T N/B 1.75 01/31/23 | 国債証券 | 1.7500 | 5,000 | 4,791 | 515,267 | 2023/01/31 |
| US T N/B 1.375 01/31/20 | 国債証券 | 1.3750 | 8,600 | 8,456 | 909,445 | 2020/01/31 |
| US T N/B 1.25 01/31/20 | 国債証券 | 1.2500 | 10,800 | 10,594 | 1,139,376 | 2020/01/31 |
| US T N/B 6.0 02/15/26 | 国債証券 | 6.0000 | 3,200 | 3,923 | 421,931 | 2026/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 国債証券 | 3.1250 | 1,800 | 1,801 | 193,722 | 2042/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 国債証券 | 3.1250 | 3,600 | 3,592 | 386,385 | 2043/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 5,000 | 4,389 | 472,079 | 2046/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/39 | 国債証券 | 3.5000 | 1,300 | 1,387 | 149,193 | 2039/02/15 |
| US T N/B 5.25 02/15/29 | 国債証券 | 5.2500 | 1,000 | 1,218 | 130,988 | 2029/02/15 |
| US T N/B 5.375 02/15/31 | 国債証券 | 5.3750 | 1,500 | 1,892 | 203,571 | 2031/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/36 | 国債証券 | 4.5000 | 2,000 | 2,415 | 259,709 | 2036/02/15 |
| US T N/B 4.75 02/15/41 | 国債証券 | 4.7500 | 1,800 | 2,286 | 245,849 | 2041/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 国債証券 | 3.6250 | 5,000 | 5,425 | 583,485 | 2044/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/22 | 国債証券 | 2.0000 | 17,500 | 17,132 | 1,842,391 | 2022/02/15 |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 国債証券 | 4.3750 | 750 | 899 | 96,678 | 2038/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 国債証券 | 4.6250 | 2,800 | 3,488 | 375,119 | 2040/02/15 |
| US T N/B 1.625 02/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 5,500 | 5,009 | 538,699 | 2026/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/45 | 国債証券 | 2.5000 | 5,500 | 4,845 | 521,090 | 2045/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/19 | 国債証券 | 2.7500 | 12,000 | 12,077 | 1,298,842 | 2019/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/20 | 国債証券 | 3.6250 | 17,000 | 17,444 | 1,876,023 | 2020/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 5,200 | 5,045 | 542,560 | 2047/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/24 | 国債証券 | 2.7500 | 9,400 | 9,399 | 1,010,795 | 2024/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 9,500 | 9,001 | 967,994 | 2025/02/15 |
| US T N/B 1.375 02/28/19 | 国債証券 | 1.3750 | 13,000 | 12,907 | 1,388,024 | 2019/02/28 |
| US T N/B 3.625 02/15/21 | 国債証券 | 3.6250 | 5,500 | 5,688 | 611,775 | 2021/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 9,500 | 9,210 | 990,460 | 2023/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 12,000 | 11,375 | 1,223,323 | 2027/02/15 |
| US T N/B 1.75 03/31/22 | 国債証券 | 1.7500 | 11,700 | 11,325 | 1,217,904 | 2022/03/31 |
| US T N/B 2.25 03/31/21 | 国債証券 | 2.2500 | 11,500 | 11,432 | 1,229,462 | 2021/03/31 |
| US T N/B 1.625 03/31/19 | 国債証券 | 1.6250 | 15,000 | 14,919 | 1,604,453 | 2019/03/31 |
| US T N/B 1.375 03/31/20 | 国債証券 | 1.3750 | 6,300 | 6,182 | 664,846 | 2020/03/31 |
| US T N/B 1.375 04/30/20 | 国債証券 | 1.3750 | 12,000 | 11,761 | 1,264,863 | 2020/04/30 |
| US T N/B 6.25 05/15/30 | 国債証券 | 6.2500 | 1,400 | 1,875 | 201,668 | 2030/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 国債証券 | 4.3750 | 2,000 | 2,412 | 259,489 | 2040/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 国債証券 | 4.3750 | 2,000 | 2,418 | 260,094 | 2041/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/42 | 国債証券 | 3.0000 | 2,270 | 2,222 | 239,023 | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.25 05/15/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,630 | 1,928 | 207,443 | 2039/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/19 | 国債証券 | 3.1250 | 13,000 | 13,152 | 1,414,446 | 2019/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 国債証券 | 2.8750 | 4,700 | 4,482 | 482,061 | 2043/05/15 |
| US T N/B 3.5 05/15/20 | 国債証券 | 3.5000 | 14,000 | 14,363 | 1,544,599 | 2020/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 国債証券 | 3.3750 | 5,200 | 5,412 | 582,051 | 2044/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 5,000 | 4,862 | 522,913 | 2045/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 6,900 | 6,688 | 719,297 | 2047/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 4,400 | 3,861 | 415,245 | 2046/05/15 |

| 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 1.125 05/31/19 | 国債証券 | 1.1250 | 11,000 | 10,860 | 1,167,963 | 2019/05/31 |
| US T N/B 1.75 05/15/22 | 国債証券 | 1.7500 | 11,600 | 11,214 | 1,206,035 | 2022/05/15 |
| US T N/B 1.375 05/31/20 | 国債証券 | 1.3750 | 3,500 | 3,426 | 368,478 | 2020/05/31 |
| US T N/B 4.5 05/15/38 | 国債証券 | 4.5000 | 1,100 | 1,341 | 144,216 | 2038/05/15 |
| US T N/B 1.75 05/15/23 | 国債証券 | 1.7500 | 7,000 | 6,681 | 718,581 | 2023/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/24 | 国債証券 | 2.5000 | 9,000 | 8,857 | 952,577 | 2024/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/21 | 国債証券 | 3.1250 | 8,000 | 8,161 | 877,655 | 2021/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | 国債証券 | 2.1250 | 5,000 | 4,767 | 512,745 | 2025/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 国債証券 | 2.3750 | 6,000 | 5,740 | 617,307 | 2027/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/37 | 国債証券 | 5.0000 | 800 | 1,029 | 110,685 | 2037/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 8,500 | 7,716 | 829,820 | 2026/05/15 |
| US T N/B 2.0 05/31/21 | 国債証券 | 2.0000 | 12,000 | 11,821 | 1,271,264 | 2021/05/31 |
| US T N/B 2.0 05/31/24 | 国債証券 | 2.0000 | 10,000 | 9,549 | 1,026,920 | 2024/05/31 |
| US T N/B 1.375 06/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 7,000 | 6,541 | 703,465 | 2023/06/30 |
| US T N/B 1.875 06/30/20 | 国債証券 | 1.8750 | 11,000 | 10,885 | 1,170,601 | 2020/06/30 |
| US T N/B 2.125 06/30/22 | 国債証券 | 2.1250 | 9,500 | 9,315 | 1,001,749 | 2022/06/30 |
| US T N/B 0.875 07/31/19 | 国債証券 | 0.8750 | 15,000 | 14,725 | 1,583,531 | 2019/07/31 |
| US T N/B 6.25 08/15/23 | 国債証券 | 6.2500 | 1,000 | 1,181 | 127,064 | 2023/08/15 |
| US T N/B 3.75 08/15/41 | 国債証券 | 3.7500 | 2,000 | 2,212 | 237,880 | 2041/08/15 |
| US T N/B 5.5 08/15/28 | 国債証券 | 5.5000 | 1,800 | 2,218 | 238,577 | 2028/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 国債証券 | 3.8750 | 2,100 | 2,363 | 254,221 | 2040/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 2,800 | 2,618 | 281,539 | 2042/08/15 |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 国債証券 | 3.1250 | 4,600 | 4,582 | 492,749 | 2044/08/15 |
| US T N/B 8.125 08/15/19 | 国債証券 | 8.1250 | 4,000 | 4,349 | 467,747 | 2019/08/15 |
| US T N/B 4.5 08/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | 1,400 | 1,713 | 184,242 | 2039/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | 4,200 | 4,555 | 489,879 | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | 4,900 | 4,648 | 499,855 | 2045/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 9,000 | 8,487 | 912,730 | 2025/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 6,100 | 5,620 | 604,432 | 2047/08/15 |
| US T N/B 2.125 08/15/21 | 国債証券 | 2.1250 | 11,000 | 10,861 | 1,168,058 | 2021/08/15 |
| US T N/B 2.5 08/15/23 | 国債証券 | 2.5000 | 8,000 | 7,916 | 851,372 | 2023/08/15 |
| US T N/B 2.375 08/15/24 | 国債証券 | 2.3750 | 8,900 | 8,676 | 933,101 | 2024/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/46 | 国債証券 | 2.2500 | 4,500 | 3,735 | 401,734 | 2046/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 8,000 | 7,560 | 813,062 | 2027/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/19 | 国債証券 | 3.6250 | 5,000 | 5,103 | 548,851 | 2019/08/15 |
| US T N/B 2.625 08/15/20 | 国債証券 | 2.6250 | 16,500 | 16,607 | 1,785,979 | 2020/08/15 |
| US T N/B 1.5 08/15/26 | 国債証券 | 1.5000 | 7,000 | 6,266 | 673,851 | 2026/08/15 |
| US T N/B 1.625 08/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 9,500 | 9,104 | 979,119 | 2022/08/15 |
| US T N/B 1.0 08/31/19 | 国債証券 | 1.0000 | 13,500 | 13,259 | 1,425,977 | 2019/08/31 |
| US T N/B 2.125 08/31/20 | 国債証券 | 2.1250 | 3,000 | 2,982 | 320,752 | 2020/08/31 |
| US T N/B 1.875 08/31/22 | 国債証券 | 1.8750 | 12,000 | 11,620 | 1,249,636 | 2022/08/31 |
| US T N/B 1.875 08/31/24 | 国債証券 | 1.8750 | 10,000 | 9,455 | 1,016,833 | 2024/08/31 |
| US T N/B 1.0 09/30/19 | 国債証券 | 1.0000 | 15,000 | 14,719 | 1,582,902 | 2019/09/30 |
| US T N/B 2.125 09/30/21 | 国債証券 | 2.1250 | 10,000 | 9,862 | 1,060,613 | 2021/09/30 |
| US T N/B 2.125 09/30/24 | 国債証券 | 2.1250 | 10,000 | 9,589 | 1,031,201 | 2024/09/30 |
| US T N/B 1.375 09/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 11,000 | 10,233 | 1,100,500 | 2023/09/30 |
| US T N/B 1.75 09/30/22 | 国債証券 | 1.7500 | 12,500 | 12,026 | 1,293,302 | 2022/09/30 |
| US T N/B 2.0 09/30/20 | 国債証券 | 2.0000 | 6,000 | 5,945 | 639,336 | 2020/09/30 |

| 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 1.75 10/31/20 | 国債証券 | 1.7500 | 6,000 | 5,902 | 634,703 | 2020/10/31 |
| US T N/B 1.25 10/31/19 | 国債証券 | 1.2500 | 15,000 | 14,762 | 1,587,516 | 2019/10/31 |
| US T N/B 8.0 11/15/21 | 国債証券 | 8.0000 | 6,000 | 7,167 | 770,803 | 2021/11/15 |
| US T N/B 5.25 11/15/28 | 国債証券 | 5.2500 | 1,500 | 1,821 | 195,852 | 2028/11/15 |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 国債証券 | 6.1250 | 1,400 | 1,782 | 191,663 | 2027/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/44 | 国債証券 | 3.0000 | 5,100 | 4,961 | 533,585 | 2044/11/15 |
| US T N/B 4.25 11/15/40 | 国債証券 | 4.2500 | 2,000 | 2,373 | 255,271 | 2040/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 3,400 | 3,175 | 341,467 | 2042/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 1,800 | 1,801 | 193,752 | 2041/11/15 |
| US T N/B 3.75 11/15/43 | 国債証券 | 3.7500 | 4,900 | 5,424 | 583,302 | 2043/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 3,900 | 3,789 | 407,574 | 2045/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 4,400 | 4,164 | 447,851 | 2046/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/24 | 国債証券 | 2.2500 | 10,600 | 10,233 | 1,100,471 | 2024/11/15 |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 1,660 | 1,999 | 215,055 | 2039/11/15 |
| US T N/B 2.625 11/15/20 | 国債証券 | 2.6250 | 6,000 | 6,037 | 649,272 | 2020/11/15 |
| US T N/B 3.375 11/15/19 | 国債証券 | 3.3750 | 4,000 | 4,078 | 438,578 | 2019/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/21 | 国債証券 | 2.0000 | 10,400 | 10,205 | 1,097,479 | 2021/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/25 | 国債証券 | 2.2500 | 10,000 | 9,575 | 1,029,770 | 2025/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/30/20 | 国債証券 | 2.0000 | 10,500 | 10,390 | 1,117,426 | 2020/11/30 |
| US T N/B 1.625 11/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 7,500 | 7,165 | 770,569 | 2022/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/23 | 国債証券 | 2.7500 | 10,000 | 10,015 | 1,077,077 | 2023/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/26 | 国債証券 | 2.0000 | 7,000 | 6,511 | 700,198 | 2026/11/15 |
| US T N/B 1.0 11/30/19 | 国債証券 | 1.0000 | 6,500 | 6,362 | 684,260 | 2019/11/30 |
| US T N/B 2.25 11/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 2,100 | 1,981 | 213,112 | 2027/11/15 |
| US T N/B 2.25 12/31/23 | 国債証券 | 2.2500 | 2,500 | 2,433 | 261,685 | 2023/12/31 |
| US T N/B 2.375 12/31/20 | 国債証券 | 2.3750 | 8,300 | 8,294 | 891,948 | 2020/12/31 |
| US T N/B 2.125 12/31/21 | 国債証券 | 2.1250 | 15,700 | 15,454 | 1,661,988 | 2021/12/31 |
| US T N/B 2.125 12/31/22 | 国債証券 | 2.1250 | 8,000 | 7,809 | 839,818 | 2022/12/31 |
| US T N/B 1.75 12/31/20 | 国債証券 | 1.7500 | 9,000 | 8,839 | 950,612 | 2020/12/31 |
| 小計 | - | - | 846,210 | 837,189 | 90,031,363 | - |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CANADA 1.75 03/01/19 | 国債証券 | 1.7500 | 1,100 | 1,101 | 93,664 | 2019/03/01 |
| CANADA 1.5 03/01/20 | 国債証券 | 1.5000 | 2,300 | 2,285 | 194,313 | 2020/03/01 |
| CANADA 1.75 03/01/23 | 国債証券 | 1.7500 | 600 | 589 | 50,125 | 2023/03/01 |
| CANADA 1.5 06/01/26 | 国債証券 | 1.5000 | 1,700 | 1,599 | 135,976 | 2026/06/01 |
| CANADA 8.0 06/01/27 | 国債証券 | 8.0000 | 1,000 | 1,471 | 125,146 | 2027/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,600 | 2,132 | 181,353 | 2029/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 1,550 | 2,204 | 187,411 | 2033/06/01 |
| CANADA 5.0 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 1,600 | 2,216 | 188,502 | 2037/06/01 |
| CANADA 2.5 06/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 1,600 | 1,628 | 138,438 | 2024/06/01 |
| CANADA 4.0 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 1,800 | 2,278 | 193,725 | 2041/06/01 |
| CANADA 3.25 06/01/21 | 国債証券 | 3.2500 | 4,700 | 4,889 | 415,742 | 2021/06/01 |
| CANADA 2.75 06/01/22 | 国債証券 | 2.7500 | 3,900 | 4,011 | 341,117 | 2022/06/01 |
| CANADA 1.5 06/01/23 | 国債証券 | 1.5000 | 2,300 | 2,228 | 189,469 | 2023/06/01 |
| CANADA 2.25 06/01/25 | 国債証券 | 2.2500 | 1,500 | 1,500 | 127,585 | 2025/06/01 |
| CANADA 1.0 06/01/27 | 国債証券 | 1.0000 | 800 | 712 | 60,558 | 2027/06/01 |
| CANADA 3.5 06/01/20 | 国債証券 | 3.5000 | 3,800 | 3,937 | 334,794 | 2020/06/01 |
| CANADA 3.75 06/01/19 | 国債証券 | 3.7500 | 3,700 | 3,795 | 322,712 | 2019/06/01 |

| 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 | | |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| CANADA 0.75 08/01/19 | 国債証券 | 0.7500 | 7,200 | 7,098 | 603,571 | 2019/08/01 | |
| CANADA 0.75 09/01/21 | 国債証券 | 0.7500 | 600 | 574 | 48,880 | 2021/09/01 | |
| CANADA 0.75 09/01/20 | 国債証券 | 0.7500 | 2,400 | 2,333 | 198,386 | 2020/09/01 | |
| CANADA 1.0 09/01/22 | 国債証券 | 1.0000 | 800 | 762 | 64,871 | 2022/09/01 | |
| CANADA 3.5 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 1,900 | 2,282 | 194,110 | 2045/12/01 | |
| CANADA 2.75 12/01/48 | 国債証券 | 2.7500 | 1,450 | 1,537 | 130,703 | 2048/12/01 | |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 750 | 815 | 69,354 | 2064/12/01 | |
| 小計 | — | — | 50,650 | 53,987 | 4,590,516 | — | |
| (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 | 1,134 | 96,297 | 2047/03/21 | |
| AUSTRALIAN 5.25 03/15/19 | 国債証券 | 5.2500 | 2,600 | 2,692 | 228,508 | 2019/03/15 | |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 | 国債証券 | 3.2500 | 3,100 | 3,205 | 272,028 | 2025/04/21 | |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 3,600 | 4,148 | 352,032 | 2027/04/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 国債証券 | 2.7500 | 3,100 | 3,123 | 265,094 | 2024/04/21 | |
| AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 国債証券 | 4.2500 | 3,600 | 3,980 | 337,823 | 2026/04/21 | |
| AUSTRALIAN 4.5 04/15/20 | 国債証券 | 4.5000 | 3,800 | 3,995 | 339,026 | 2020/04/15 | |
| AUSTRALIAN 5.5 04/21/23 | 国債証券 | 5.5000 | 3,000 | 3,437 | 291,664 | 2023/04/21 | |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 3,100 | 3,191 | 270,810 | 2029/04/21 | |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33 | 国債証券 | 4.5000 | 1,500 | 1,749 | 148,469 | 2033/04/21 | |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 1,500 | 1,597 | 135,532 | 2037/04/21 | |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 2,400 | 2,261 | 191,912 | 2028/05/21 | |
| AUSTRALIAN 5.75 05/15/21 | 国債証券 | 5.7500 | 3,700 | 4,106 | 348,516 | 2021/05/15 | |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 900 | 884 | 75,050 | 2039/06/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 900 | 841 | 71,398 | 2035/06/21 | |
| AUSTRALIAN 5.75 07/15/22 | 国債証券 | 5.7500 | 4,000 | 4,564 | 387,314 | 2022/07/15 | |
| AUSTRALIAN 2.75 10/21/19 | 国債証券 | 2.7500 | 1,500 | 1,519 | 128,958 | 2019/10/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28 | 国債証券 | 2.7500 | 2,700 | 2,657 | 225,476 | 2028/11/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27 | 国債証券 | 2.7500 | 2,900 | 2,863 | 242,988 | 2027/11/21 | |
| AUSTRALIAN 1.75 11/21/20 | 国債証券 | 1.7500 | 2,400 | 2,374 | 201,513 | 2020/11/21 | |
| AUSTRALIAN 2.0 12/21/21 | 国債証券 | 2.0000 | 1,150 | 1,137 | 96,507 | 2021/12/21 | |
| 小計 | — | — | 52,700 | 55,466 | 4,706,926 | — | |
| (シンガポール) | | % | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | 千円 | | |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27 | 国債証券 | 3.5000 | 900 | 982 | 80,168 | 2027/03/01 | |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46 | 国債証券 | 2.7500 | 410 | 403 | 32,908 | 2046/03/01 | |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42 | 国債証券 | 2.7500 | 550 | 544 | 44,431 | 2042/04/01 | |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25 | 国債証券 | 2.3750 | 500 | 503 | 41,024 | 2025/06/01 | |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29 | 国債証券 | 2.8750 | 400 | 414 | 33,808 | 2029/07/01 | |
| SINGAPORE 2.0 07/01/20 | 国債証券 | 2.0000 | 800 | 805 | 65,685 | 2020/07/01 | |
| SINGAPORE 3.25 09/01/20 | 国債証券 | 3.2500 | 1,340 | 1,389 | 113,366 | 2020/09/01 | |
| SINGAPORE 3.0 09/01/24 | 国債証券 | 3.0000 | 810 | 847 | 69,135 | 2024/09/01 | |
| SINGAPORE 3.125 09/01/22 | 国債証券 | 3.1250 | 1,600 | 1,680 | 137,086 | 2022/09/01 | |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30 | 国債証券 | 2.8750 | 460 | 475 | 38,755 | 2030/09/01 | |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33 | 国債証券 | 3.3750 | 480 | 523 | 42,689 | 2033/09/01 | |
| SINGAPORE 1.25 10/01/21 | 国債証券 | 1.2500 | 1,000 | 979 | 79,888 | 2021/10/01 | |
| 小計 | — | — | 9,250 | 9,550 | 778,949 | — | |
| (イギリス) | | % | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 千円 | | |
| UK TREASURY 3.25 01/22/44 | 国債証券 | 3.2500 | 2,800 | 3,521 | 530,227 | 2044/01/22 | |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45 | 国債証券 | 3.5000 | 2,650 | 3,490 | 525,606 | 2045/01/22 | |

| 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 4.0 01/22/60 | 国債証券 | 4.0000 | 1,700 | 2,818 | 424,427 | 2060/01/22 |
| UK TREASURY 1.5 01/22/21 | 国債証券 | 1.5000 | 2,700 | 2,750 | 414,163 | 2021/01/22 |
| UK TREASURY 5.0 03/07/25 | 国債証券 | 5.0000 | 2,030 | 2,531 | 381,208 | 2025/03/07 |
| UK TREASURY 4.5 03/07/19 | 国債証券 | 4.5000 | 400 | 416 | 62,683 | 2019/03/07 |
| UK TREASURY 4.0 03/07/22 | 国債証券 | 4.0000 | 2,300 | 2,577 | 388,141 | 2022/03/07 |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 国債証券 | 4.2500 | 2,450 | 3,331 | 501,728 | 2036/03/07 |
| UK TREASURY 4.75 03/07/20 | 国債証券 | 4.7500 | 1,850 | 2,001 | 301,405 | 2020/03/07 |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 国債証券 | 4.2500 | 1,850 | 2,417 | 364,119 | 2032/06/07 |
| UK TREASURY 8.0 06/07/21 | 国債証券 | 8.0000 | 1,700 | 2,092 | 315,119 | 2021/06/07 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47 | 国債証券 | 1.5000 | 2,000 | 1,798 | 270,851 | 2047/07/22 |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 国債証券 | 3.7500 | 2,100 | 3,097 | 466,484 | 2052/07/22 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57 | 国債証券 | 1.7500 | 1,000 | 986 | 148,572 | 2057/07/22 |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65 | 国債証券 | 2.5000 | 1,650 | 2,050 | 308,857 | 2065/07/22 |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68 | 国債証券 | 3.5000 | 2,000 | 3,180 | 478,996 | 2068/07/22 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/26 | 国債証券 | 1.5000 | 2,400 | 2,406 | 362,388 | 2026/07/22 |
| UK TREASURY 1.25 07/22/27 | 国債証券 | 1.2500 | 2,000 | 1,941 | 292,349 | 2027/07/22 |
| UK TREASURY 2.0 07/22/20 | 国債証券 | 2.0000 | 1,700 | 1,749 | 263,442 | 2020/07/22 |
| UK TREASURY 0.5 07/22/22 | 国債証券 | 0.5000 | 2,350 | 2,295 | 345,623 | 2022/07/22 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/19 | 国債証券 | 1.7500 | 4,400 | 4,467 | 672,793 | 2019/07/22 |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,700 | 2,388 | 359,633 | 2039/09/07 |
| UK TREASURY 3.75 09/07/21 | 国債証券 | 3.7500 | 1,850 | 2,033 | 306,283 | 2021/09/07 |
| UK TREASURY 2.25 09/07/23 | 国債証券 | 2.2500 | 2,800 | 2,961 | 445,896 | 2023/09/07 |
| UK TREASURY 2.75 09/07/24 | 国債証券 | 2.7500 | 2,000 | 2,184 | 328,921 | 2024/09/07 |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25 | 国債証券 | 2.0000 | 2,400 | 2,510 | 378,001 | 2025/09/07 |
| UK TREASURY 3.75 09/07/20 | 国債証券 | 3.7500 | 2,900 | 3,115 | 469,136 | 2020/09/07 |
| UK TREASURY 3.75 09/07/19 | 国債証券 | 3.7500 | 2,200 | 2,304 | 346,965 | 2019/09/07 |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34 | 国債証券 | 4.5000 | 2,350 | 3,229 | 486,346 | 2034/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37 | 国債証券 | 1.7500 | 900 | 872 | 131,315 | 2037/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/22 | 国債証券 | 1.7500 | 3,150 | 3,248 | 489,153 | 2022/09/07 |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28 | 国債証券 | 6.0000 | 1,350 | 1,934 | 291,262 | 2028/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 国債証券 | 4.7500 | 1,800 | 2,669 | 401,984 | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42 | 国債証券 | 4.5000 | 2,200 | 3,292 | 495,754 | 2042/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46 | 国債証券 | 4.2500 | 2,080 | 3,123 | 470,435 | 2046/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 国債証券 | 4.2500 | 2,040 | 3,394 | 511,186 | 2055/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27 | 国債証券 | 4.2500 | 1,700 | 2,111 | 318,045 | 2027/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40 | 国債証券 | 4.2500 | 1,980 | 2,813 | 423,667 | 2040/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30 | 国債証券 | 4.7500 | 1,700 | 2,282 | 343,709 | 2030/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49 | 国債証券 | 4.2500 | 2,070 | 3,218 | 484,601 | 2049/12/07 |
| 小計 | - | - | 83,200 | 101,610 | 15,301,492 | - |
| (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 | 14,900 | 24,067 | 428,647 | 2039/11/15 |
| DENMARK 1.75 11/15/25 | 国債証券 | 1.7500 | 13,470 | 14,710 | 261,988 | 2025/11/15 |
| DENMARK 4.0 11/15/19 | 国債証券 | 4.0000 | 7,900 | 8,526 | 151,849 | 2019/11/15 |
| DENMARK 3.0 11/15/21 | 国債証券 | 3.0000 | 13,000 | 14,500 | 258,248 | 2021/11/15 |
| DENMARK 1.5 11/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 5,500 | 5,888 | 104,865 | 2023/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 3,000 | 2,916 | 51,949 | 2027/11/15 |
| 小計 | - | - | 57,770 | 70,609 | 1,257,549 | - |
| (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 | 5,870 | 80,539 | 2026/02/19 |

| 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 | |
| (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 1.75 02/17/27 | 国債証券 | 1.7500 | 500 | 493 | 6,776 | 2027/02/17 |
| NORWAY 3.0 03/14/24 | 国債証券 | 3.0000 | 7,400 | 8,012 | 109,936 | 2024/03/14 |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国債証券 | 1.7500 | 3,800 | 3,810 | 52,278 | 2025/03/13 |
| NORWAY 4.5 05/22/19 | 国債証券 | 4.5000 | 6,560 | 6,876 | 94,350 | 2019/05/22 |
| NORWAY 2.0 05/24/23 | 国債証券 | 2.0000 | 7,600 | 7,815 | 107,223 | 2023/05/24 |
| NORWAY 3.75 05/25/21 | 国債証券 | 3.7500 | 11,500 | 12,475 | 171,159 | 2021/05/25 |
| 小計 | - | - | 43,360 | 45,354 | 622,265 | - |
| (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 4.25 03/12/19 | 国債証券 | 4.2500 | 8,800 | 9,268 | 123,079 | 2019/03/12 |
| SWEDEN 3.5 03/30/39 | 国債証券 | 3.5000 | 6,200 | 8,329 | 110,613 | 2039/03/30 |
| SWEDEN 2.5 05/12/25 | 国債証券 | 2.5000 | 10,300 | 11,771 | 156,319 | 2025/05/12 |
| SWEDEN 3.5 06/01/22 | 国債証券 | 3.5000 | 12,870 | 14,822 | 196,846 | 2022/06/01 |
| SWEDEN 1.5 11/13/23 | 国債証券 | 1.5000 | 9,700 | 10,382 | 137,884 | 2023/11/13 |
| SWEDEN 1.0 11/12/26 | 国債証券 | 1.0000 | 7,000 | 7,171 | 95,232 | 2026/11/12 |
| SWEDEN 5.0 12/01/20 | 国債証券 | 5.0000 | 11,410 | 13,136 | 174,458 | 2020/12/01 |
| 小計 | - | - | 66,280 | 74,882 | 994,434 | - |
| (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 | 5,000 | 4,417 | 25,401 | 2026/03/05 |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 国債証券 | 8.5000 | 31,000 | 32,705 | 188,059 | 2029/05/31 |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 国債証券 | 7.7500 | 10,000 | 9,955 | 57,242 | 2031/05/29 |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 10,000 | 9,852 | 56,649 | 2027/06/03 |
| MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22 | 国債証券 | 6.5000 | 26,000 | 24,902 | 143,186 | 2022/06/09 |
| MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21 | 国債証券 | 6.5000 | 38,000 | 36,733 | 211,215 | 2021/06/10 |
| MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 | 国債証券 | 8.0000 | 30,000 | 30,232 | 173,835 | 2020/06/11 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 国債証券 | 7.7500 | 22,000 | 21,673 | 124,622 | 2042/11/13 |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47 | 国債証券 | 8.0000 | 5,000 | 5,046 | 29,016 | 2047/11/07 |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 国債証券 | 8.5000 | 15,000 | 15,951 | 91,721 | 2038/11/18 |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 国債証券 | 10.0000 | 13,000 | 15,722 | 90,404 | 2036/11/20 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 国債証券 | 7.7500 | 7,000 | 6,944 | 39,929 | 2034/11/23 |
| MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 国債証券 | 10.0000 | 35,000 | 39,314 | 226,056 | 2024/12/05 |
| MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23 | 国債証券 | 8.0000 | 14,000 | 14,212 | 81,721 | 2023/12/07 |
| MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19 | 国債証券 | 5.0000 | 26,000 | 24,838 | 142,821 | 2019/12/11 |
| 小計 | - | - | 287,000 | 292,501 | 1,681,884 | - |
| (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 | 779 | 21,447 | 2027/03/15 |
| MALAYSIA 3.48 03/15/23 | 国債証券 | 3.4800 | 1,220 | 1,200 | 33,057 | 2023/03/15 |
| MALAYSIA 3.492 03/31/20 | 国債証券 | 3.4920 | 2,200 | 2,205 | 60,717 | 2020/03/31 |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26 | 国債証券 | 4.3920 | 3,070 | 3,116 | 85,791 | 2026/04/15 |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 国債証券 | 4.4980 | 1,800 | 1,803 | 49,646 | 2030/04/15 |
| MALAYSIA 4.127 04/15/32 | 国債証券 | 4.1270 | 1,850 | 1,766 | 48,632 | 2032/04/15 |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 国債証券 | 3.8440 | 1,210 | 1,124 | 30,963 | 2033/04/15 |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 国債証券 | 3.5020 | 2,570 | 2,419 | 66,596 | 2027/05/31 |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28 | 国債証券 | 3.7330 | 2,000 | 1,937 | 53,350 | 2028/06/15 |
| MALAYSIA 4.16 07/15/21 | 国債証券 | 4.1600 | 5,500 | 5,618 | 154,679 | 2021/07/15 |
| MALAYSIA 4.181 07/15/24 | 国債証券 | 4.1810 | 1,430 | 1,447 | 39,840 | 2024/07/15 |
| MALAYSIA 3.418 08/15/22 | 国債証券 | 3.4180 | 3,000 | 2,954 | 81,337 | 2022/08/15 |
| MALAYSIA 5.248 09/15/28 | 国債証券 | 5.2480 | 1,600 | 1,717 | 47,280 | 2028/09/15 |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 国債証券 | 4.9350 | 1,500 | 1,526 | 42,029 | 2043/09/30 |

| 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 | |
| (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 4.378 11/29/19 | 国債証券 | 4.3780 | 3,680 | 3,745 | 103,117 | 2019/11/29 |
| 小計 | — | — | 33,430 | 33,363 | 918,489 | — |
| (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 | 12,597 | 115,522 | 2030/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44 | 国債証券 | 8.7500 | 10,000 | 9,622 | 88,233 | 2044/01/31 |
| SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40 | 国債証券 | 9.0000 | 8,000 | 7,924 | 72,663 | 2040/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37 | 国債証券 | 8.5000 | 10,910 | 10,394 | 95,317 | 2037/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48 | 国債証券 | 8.7500 | 17,000 | 16,383 | 150,234 | 2048/02/28 |
| SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41 | 国債証券 | 6.5000 | 11,760 | 8,836 | 81,028 | 2041/02/28 |
| SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23 | 国債証券 | 7.7500 | 10,000 | 10,134 | 92,929 | 2023/02/28 |
| SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31 | 国債証券 | 7.0000 | 11,600 | 10,118 | 92,788 | 2031/02/28 |
| SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35 | 国債証券 | 8.8750 | 3,000 | 2,981 | 27,339 | 2035/02/28 |
| SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32 | 国債証券 | 8.2500 | 10,000 | 9,614 | 88,164 | 2032/03/31 |
| SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36 | 国債証券 | 6.2500 | 14,700 | 11,184 | 102,563 | 2036/03/31 |
| SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21 | 国債証券 | 6.7500 | 10,160 | 10,087 | 92,505 | 2021/03/31 |
| SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26 | 国債証券 | 10.5000 | 25,000 | 28,743 | 263,580 | 2026/12/21 |
| 小計 | — | — | 155,240 | 148,622 | 1,362,871 | — |
| (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 5.75 04/25/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,440 | 1,761 | 56,309 | 2029/04/25 |
| POLAND 1.5 04/25/20 | 国債証券 | 1.5000 | 3,000 | 2,989 | 95,583 | 2020/04/25 |
| POLAND 2.25 04/25/22 | 国債証券 | 2.2500 | 4,000 | 3,964 | 126,754 | 2022/04/25 |
| POLAND 2.5 07/25/26 | 国債証券 | 2.5000 | 4,200 | 3,954 | 126,425 | 2026/07/25 |
| POLAND 3.25 07/25/25 | 国債証券 | 3.2500 | 4,700 | 4,713 | 150,702 | 2025/07/25 |
| POLAND 2.5 07/25/27 | 国債証券 | 2.5000 | 2,300 | 2,133 | 68,207 | 2027/07/25 |
| POLAND 1.75 07/25/21 | 国債証券 | 1.7500 | 2,200 | 2,170 | 69,391 | 2021/07/25 |
| POLAND 3.25 07/25/19 | 国債証券 | 3.2500 | 2,500 | 2,562 | 81,921 | 2019/07/25 |
| POLAND 5.75 09/23/22 | 国債証券 | 5.7500 | 3,200 | 3,639 | 116,350 | 2022/09/23 |
| POLAND 5.25 10/25/20 | 国債証券 | 5.2500 | 6,890 | 7,499 | 239,745 | 2020/10/25 |
| POLAND 5.75 10/25/21 | 国債証券 | 5.7500 | 3,680 | 4,126 | 131,932 | 2021/10/25 |
| POLAND 4.0 10/25/23 | 国債証券 | 4.0000 | 3,100 | 3,284 | 105,018 | 2023/10/25 |
| POLAND 5.5 10/25/19 | 国債証券 | 5.5000 | 2,690 | 2,856 | 91,331 | 2019/10/25 |
| 小計 | — | — | 43,900 | 45,657 | 1,459,674 | — |
| (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 | 890 | 918 | 121,816 | 2045/02/18 |
| IRISH 3.4 03/18/24 | 国債証券 | 3.4000 | 930 | 1,093 | 145,083 | 2024/03/18 |
| IRISH 5.4 03/13/25 | 国債証券 | 5.4000 | 1,260 | 1,669 | 221,532 | 2025/03/13 |
| IRISH 3.9 03/20/23 | 国債証券 | 3.9000 | 700 | 829 | 110,004 | 2023/03/20 |
| IRISH 0.8 03/15/22 | 国債証券 | 0.8000 | 1,150 | 1,185 | 157,336 | 2022/03/15 |
| IRISH 4.5 04/18/20 | 国債証券 | 4.5000 | 1,130 | 1,250 | 165,923 | 2020/04/18 |
| IRISH 2.4 05/15/30 | 国債証券 | 2.4000 | 1,100 | 1,236 | 164,030 | 2030/05/15 |
| IRISH 1.0 05/15/26 | 国債証券 | 1.0000 | 1,350 | 1,363 | 180,940 | 2026/05/15 |
| IRISH 1.7 05/15/37 | 国債証券 | 1.7000 | 750 | 753 | 99,960 | 2037/05/15 |
| IRISH 4.4 06/18/19 | 国債証券 | 4.4000 | 480 | 511 | 67,810 | 2019/06/18 |
| IRISH 5.0 10/18/20 | 国債証券 | 5.0000 | 1,000 | 1,143 | 151,681 | 2020/10/18 |
| IRISH 5.9 10/18/19 | 国債証券 | 5.9000 | 950 | 1,051 | 139,487 | 2019/10/18 |
| 小計 | — | — | 11,690 | 13,006 | 1,725,608 | — |
| (ユーロ…オランダ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 国債証券 | 3.7500 | 1,800 | 2,702 | 358,581 | 2042/01/15 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|---------------------------|------|--------|--------|--------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…オランダ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 1,540 | 2,033 | 269,826 | 2047/01/15 |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/23 | 国債証券 | 3.7500 | 1,700 | 2,006 | 266,136 | 2023/01/15 |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28 | 国債証券 | 5.5000 | 1,600 | 2,317 | 307,454 | 2028/01/15 |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37 | 国債証券 | 4.0000 | 1,700 | 2,508 | 332,782 | 2037/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33 | 国債証券 | 2.5000 | 1,740 | 2,073 | 275,112 | 2033/01/15 |
| NETHERLANDS 01/15/22 | 国債証券 | — | 1,900 | 1,908 | 253,224 | 2022/01/15 |
| NETHERLANDS 0.25 01/15/20 | 国債証券 | 0.2500 | 2,150 | 2,182 | 289,607 | 2020/01/15 |
| NETHERLANDS 3.5 07/15/20 | 国債証券 | 3.5000 | 1,670 | 1,829 | 242,717 | 2020/07/15 |
| NETHERLANDS 3.25 07/15/21 | 国債証券 | 3.2500 | 2,060 | 2,327 | 308,801 | 2021/07/15 |
| NETHERLANDS 1.75 07/15/23 | 国債証券 | 1.7500 | 2,000 | 2,169 | 287,811 | 2023/07/15 |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 1,900 | 1,876 | 248,922 | 2026/07/15 |
| NETHERLANDS 2.25 07/15/22 | 国債証券 | 2.2500 | 1,550 | 1,706 | 226,416 | 2022/07/15 |
| NETHERLANDS 2.0 07/15/24 | 国債証券 | 2.0000 | 2,000 | 2,207 | 292,892 | 2024/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | 国債証券 | 0.2500 | 1,700 | 1,665 | 221,019 | 2025/07/15 |
| NETHERLANDS 4.0 07/15/19 | 国債証券 | 4.0000 | 1,200 | 1,277 | 169,529 | 2019/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | 国債証券 | 0.7500 | 1,450 | 1,445 | 191,780 | 2027/07/15 |
| 小計 | — | — | 29,660 | 34,239 | 4,542,619 | — |
| (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 | 1,800 | 2,101 | 278,758 | 2022/03/28 |
| BELGIUM 5.5 03/28/28 | 国債証券 | 5.5000 | 2,700 | 3,905 | 518,177 | 2028/03/28 |
| BELGIUM 4.25 03/28/41 | 国債証券 | 4.2500 | 2,000 | 3,037 | 403,043 | 2041/03/28 |
| BELGIUM 4.0 03/28/19 | 国債証券 | 4.0000 | 1,050 | 1,102 | 146,302 | 2019/03/28 |
| BELGIUM 4.5 03/28/26 | 国債証券 | 4.5000 | 1,200 | 1,565 | 207,692 | 2026/03/28 |
| BELGIUM 4.0 03/28/32 | 国債証券 | 4.0000 | 950 | 1,294 | 171,751 | 2032/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/35 | 国債証券 | 5.0000 | 2,500 | 3,891 | 516,242 | 2035/03/28 |
| BELGIUM 3.75 06/22/45 | 国債証券 | 3.7500 | 1,130 | 1,639 | 217,469 | 2045/06/22 |
| BELGIUM 1.6 06/22/47 | 国債証券 | 1.6000 | 900 | 863 | 114,519 | 2047/06/22 |
| BELGIUM 2.15 06/22/66 | 国債証券 | 2.1500 | 700 | 733 | 97,280 | 2066/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/26 | 国債証券 | 1.0000 | 1,500 | 1,529 | 202,969 | 2026/06/22 |
| BELGIUM 2.6 06/22/24 | 国債証券 | 2.6000 | 2,600 | 2,954 | 392,036 | 2024/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/31 | 国債証券 | 1.0000 | 1,300 | 1,262 | 167,503 | 2031/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/23 | 国債証券 | 2.2500 | 1,700 | 1,886 | 250,325 | 2023/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/34 | 国債証券 | 3.0000 | 850 | 1,050 | 139,409 | 2034/06/22 |
| BELGIUM 1.9 06/22/38 | 国債証券 | 1.9000 | 950 | 1,007 | 133,690 | 2038/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/25 | 国債証券 | 0.8000 | 2,000 | 2,029 | 269,240 | 2025/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/27 | 国債証券 | 0.8000 | 1,100 | 1,090 | 144,655 | 2027/06/22 |
| BELGIUM 1.45 06/22/37 | 国債証券 | 1.4500 | 150 | 148 | 19,645 | 2037/06/22 |
| BELGIUM 4.25 09/28/21 | 国債証券 | 4.2500 | 2,150 | 2,492 | 330,619 | 2021/09/28 |
| BELGIUM 3.75 09/28/20 | 国債証券 | 3.7500 | 2,200 | 2,435 | 323,081 | 2020/09/28 |
| BELGIUM 4.25 09/28/22 | 国債証券 | 4.2500 | 1,950 | 2,327 | 308,851 | 2022/09/28 |
| BELGIUM 3.0 09/28/19 | 国債証券 | 3.0000 | 1,300 | 1,372 | 182,129 | 2019/09/28 |
| BELGIUM 0.2 10/22/23 | 国債証券 | 0.2000 | 150 | 149 | 19,826 | 2023/10/22 |
| 小計 | — | — | 34,830 | 41,872 | 5,555,222 | — |
| (ユーロ…フランス) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FRANCE OAT 3.75 04/25/21 | 国債証券 | 3.7500 | 6,300 | 7,099 | 941,911 | 2021/04/25 |
| FRANCE BTAN 8.5 04/25/23 | 国債証券 | 8.5000 | 1,700 | 2,431 | 322,563 | 2023/04/25 |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26 | 国債証券 | 3.5000 | 4,840 | 5,944 | 788,655 | 2026/04/25 |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41 | 国債証券 | 4.5000 | 3,900 | 6,090 | 808,059 | 2041/04/25 |

| 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 | | |
| (ユーロ…フランス) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55 | 国債証券 | 4.0000 | 2,400 | 3,752 | 497,830 | 2055/04/25 | | |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60 | 国債証券 | 4.0000 | 1,940 | 3,108 | 412,345 | 2060/04/25 | | |
| FRANCE OAT 4.25 04/25/19 | 国債証券 | 4.2500 | 2,000 | 2,114 | 280,474 | 2019/04/25 | | |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 国債証券 | 5.5000 | 3,650 | 5,373 | 712,886 | 2029/04/25 | | |
| FRANCE OAT 3.0 04/25/22 | 国債証券 | 3.0000 | 5,300 | 5,970 | 792,141 | 2022/04/25 | | |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/20 | 国債証券 | 3.5000 | 8,300 | 9,011 | 1,195,596 | 2020/04/25 | | |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 3,100 | 4,705 | 624,330 | 2035/04/25 | | |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 3,000 | 3,979 | 527,992 | 2045/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 国債証券 | 1.7500 | 1,250 | 1,165 | 154,688 | 2066/05/25 | | |
| FRANCE OAT 2.25 05/25/24 | 国債証券 | 2.2500 | 4,000 | 4,462 | 592,031 | 2024/05/25 | | |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 国債証券 | 2.5000 | 3,900 | 4,494 | 596,220 | 2030/05/25 | | |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 1,500 | 1,464 | 194,238 | 2028/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31 | 国債証券 | 1.5000 | 4,200 | 4,333 | 574,989 | 2031/05/25 | | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25 | 国債証券 | 0.5000 | 3,700 | 3,687 | 489,200 | 2025/05/25 | | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26 | 国債証券 | 0.5000 | 2,200 | 2,164 | 287,122 | 2026/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27 | 国債証券 | 1.0000 | 4,000 | 4,047 | 537,021 | 2027/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/19 | 国債証券 | 1.0000 | 1,700 | 1,733 | 230,040 | 2019/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/23 | 国債証券 | 1.7500 | 4,400 | 4,759 | 631,381 | 2023/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 国債証券 | 1.2500 | 2,900 | 2,788 | 369,930 | 2036/05/25 | | |
| FRANCE OAT 05/25/22 | 国債証券 | — | 3,000 | 2,997 | 397,691 | 2022/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39 | 国債証券 | 1.7500 | 1,200 | 1,232 | 163,537 | 2039/06/25 | | |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/23 | 国債証券 | 4.2500 | 5,900 | 7,231 | 959,428 | 2023/10/25 | | |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25 | 国債証券 | 6.0000 | 2,900 | 4,085 | 541,987 | 2025/10/25 | | |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 国債証券 | 2.7500 | 4,000 | 4,686 | 621,813 | 2027/10/25 | | |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38 | 国債証券 | 4.0000 | 3,200 | 4,608 | 611,347 | 2038/10/25 | | |
| FRANCE OAT 3.25 10/25/21 | 国債証券 | 3.2500 | 5,200 | 5,847 | 775,753 | 2021/10/25 | | |
| FRANCE OAT 8.5 10/25/19 | 国債証券 | 8.5000 | 4,200 | 4,839 | 642,094 | 2019/10/25 | | |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 国債証券 | 5.7500 | 3,800 | 6,091 | 808,196 | 2032/10/25 | | |
| FRANCE OAT 2.25 10/25/22 | 国債証券 | 2.2500 | 4,000 | 4,404 | 584,395 | 2022/10/25 | | |
| FRANCE OAT 3.75 10/25/19 | 国債証券 | 3.7500 | 6,600 | 7,076 | 938,868 | 2019/10/25 | | |
| FRANCE OAT 2.5 10/25/20 | 国債証券 | 2.5000 | 8,700 | 9,360 | 1,241,881 | 2020/10/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 11/25/24 | 国債証券 | 1.7500 | 4,500 | 4,883 | 647,958 | 2024/11/25 | | |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25 | 国債証券 | 1.0000 | 3,700 | 3,803 | 504,608 | 2025/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26 | 国債証券 | 0.2500 | 3,000 | 2,863 | 379,884 | 2026/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.5 11/25/19 | 国債証券 | 0.5000 | 500 | 508 | 67,506 | 2019/11/25 | | |
| 小 計 | — | — | 144,580 | 169,206 | 22,448,608 | — | | |
| (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 | 2,300 | 305,206 | 2024/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 国債証券 | 5.6250 | 1,600 | 2,349 | 311,768 | 2028/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | 国債証券 | 6.2500 | 1,100 | 1,774 | 235,378 | 2030/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 | 国債証券 | 5.5000 | 2,050 | 3,195 | 423,925 | 2031/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | 国債証券 | 4.0000 | 2,800 | 4,153 | 551,092 | 2037/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22 | 国債証券 | 2.0000 | 4,400 | 4,773 | 633,267 | 2022/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20 | 国債証券 | 3.2500 | 3,600 | 3,859 | 512,071 | 2020/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21 | 国債証券 | 2.5000 | 2,200 | 2,383 | 316,274 | 2021/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 | 国債証券 | 0.5000 | 2,700 | 2,725 | 361,579 | 2025/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 3,200 | 3,202 | 424,896 | 2026/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 2,100 | 2,254 | 299,067 | 2023/02/15 | | |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|---------------------------|------|--------|---------|---------|------------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ドイツ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24 | 国債証券 | 1.7500 | 1,500 | 1,636 | 217,164 | 2024/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27 | 国債証券 | 0.2500 | 3,500 | 3,388 | 449,578 | 2027/02/15 |
| BUNDESSCHAT 03/15/19 | 国債証券 | — | 2,600 | 2,618 | 347,435 | 2019/03/15 |
| BUNDESUBL 0.5 04/12/19 | 国債証券 | 0.5000 | 3,100 | 3,141 | 416,796 | 2019/04/12 |
| BUNDESUBL 04/09/21 | 国債証券 | — | 2,200 | 2,223 | 294,991 | 2021/04/09 |
| BUNDESUBL 04/08/22 | 国債証券 | — | 3,000 | 3,016 | 400,171 | 2022/04/08 |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24 | 国債証券 | 1.5000 | 2,000 | 2,153 | 285,736 | 2024/05/15 |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 2,500 | 2,685 | 356,225 | 2023/05/15 |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27 | 国債証券 | 6.5000 | 1,750 | 2,680 | 355,667 | 2027/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 国債証券 | 4.7500 | 1,420 | 1,987 | 263,648 | 2028/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,660 | 2,605 | 345,685 | 2039/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 1,850 | 2,602 | 345,318 | 2042/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 | 国債証券 | 2.5000 | 2,700 | 3,389 | 449,652 | 2044/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国債証券 | 4.7500 | 2,000 | 3,371 | 447,267 | 2040/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21 | 国債証券 | 3.2500 | 3,150 | 3,527 | 468,001 | 2021/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20 | 国債証券 | 3.0000 | 3,000 | 3,249 | 431,108 | 2020/07/04 |
| DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22 | 国債証券 | 1.7500 | 2,400 | 2,595 | 344,332 | 2022/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19 | 国債証券 | 3.5000 | 4,400 | 4,650 | 616,963 | 2019/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国債証券 | 4.7500 | 2,400 | 3,726 | 494,433 | 2034/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 2,700 | 3,423 | 454,151 | 2046/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25 | 国債証券 | 1.0000 | 3,200 | 3,335 | 442,553 | 2025/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 1,700 | 1,672 | 221,826 | 2027/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/26 | 国債証券 | — | 2,800 | 2,671 | 354,376 | 2026/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 1,500 | 1,652 | 219,285 | 2023/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24 | 国債証券 | 1.0000 | 2,600 | 2,718 | 360,623 | 2024/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21 | 国債証券 | 2.2500 | 3,100 | 3,374 | 447,753 | 2021/09/04 |
| DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20 | 国債証券 | 2.2500 | 4,200 | 4,490 | 595,750 | 2020/09/04 |
| DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22 | 国債証券 | 1.5000 | 3,400 | 3,642 | 483,208 | 2022/09/04 |
| BUNDESUBL 0.25 10/16/20 | 国債証券 | 0.2500 | 1,500 | 1,527 | 202,684 | 2020/10/16 |
| 小計 | — | — | 101,280 | 116,732 | 15,486,921 | — |
| (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 | 2,700 | 3,296 | 437,290 | 2022/01/31 |
| SPAIN 6.0 01/31/29 | 国債証券 | 6.0000 | 3,000 | 4,305 | 571,247 | 2029/01/31 |
| SPAIN 4.8 01/31/24 | 国債証券 | 4.8000 | 2,200 | 2,722 | 361,234 | 2024/01/31 |
| SPAIN 4.2 01/31/37 | 国債証券 | 4.2000 | 2,380 | 3,099 | 411,223 | 2037/01/31 |
| SPAIN 5.4 01/31/23 | 国債証券 | 5.4000 | 2,800 | 3,472 | 460,726 | 2023/01/31 |
| SPAIN 0.05 01/31/21 | 国債証券 | 0.0500 | 400 | 400 | 53,113 | 2021/01/31 |
| SPAIN 1.4 01/31/20 | 国債証券 | 1.4000 | 400 | 412 | 54,704 | 2020/01/31 |
| SPAIN 1.6 04/30/25 | 国債証券 | 1.6000 | 2,500 | 2,604 | 345,535 | 2025/04/30 |
| SPAIN 3.8 04/30/24 | 国債証券 | 3.8000 | 2,700 | 3,190 | 423,227 | 2024/04/30 |
| SPAIN 5.5 04/30/21 | 国債証券 | 5.5000 | 3,600 | 4,223 | 560,358 | 2021/04/30 |
| SPAIN 4.0 04/30/20 | 国債証券 | 4.0000 | 4,000 | 4,363 | 578,913 | 2020/04/30 |
| SPAIN 1.5 04/30/27 | 国債証券 | 1.5000 | 2,600 | 2,613 | 346,666 | 2027/04/30 |
| SPAIN 1.95 04/30/26 | 国債証券 | 1.9500 | 2,500 | 2,634 | 349,495 | 2026/04/30 |
| SPAIN 2.75 04/30/19 | 国債証券 | 2.7500 | 1,400 | 1,452 | 192,647 | 2019/04/30 |
| SPAIN 0.4 04/30/22 | 国債証券 | 0.4000 | 2,200 | 2,206 | 292,778 | 2022/04/30 |
| SPAIN 5.9 07/30/26 | 国債証券 | 5.9000 | 2,500 | 3,423 | 454,132 | 2026/07/30 |
| SPAIN 4.9 07/30/40 | 国債証券 | 4.9000 | 2,000 | 2,866 | 380,232 | 2040/07/30 |

| 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 | |
| (ユーロ…スペイン) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| SPAIN 4.7 07/30/41 | 国債証券 | 4.7000 | 2,100 | 2,955 | 392,153 | 2041/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/66 | 国債証券 | 3.4500 | 950 | 1,077 | 142,960 | 2066/07/30 |
| SPAIN 4.65 07/30/25 | 国債証券 | 4.6500 | 2,600 | 3,270 | 433,885 | 2025/07/30 |
| SPAIN 1.95 07/30/30 | 国債証券 | 1.9500 | 2,700 | 2,736 | 363,098 | 2030/07/30 |
| SPAIN 5.75 07/30/32 | 国債証券 | 5.7500 | 2,400 | 3,557 | 471,937 | 2032/07/30 |
| SPAIN 2.35 07/30/33 | 国債証券 | 2.3500 | 1,000 | 1,031 | 136,782 | 2033/07/30 |
| SPAIN 4.6 07/30/19 | 国債証券 | 4.6000 | 4,100 | 4,391 | 582,670 | 2019/07/30 |
| SPAIN 0.75 07/30/21 | 国債証券 | 0.7500 | 1,700 | 1,738 | 230,676 | 2021/07/30 |
| SPAIN 1.15 07/30/20 | 国債証券 | 1.1500 | 2,100 | 2,163 | 287,093 | 2020/07/30 |
| SPAIN 2.75 10/31/24 | 国債証券 | 2.7500 | 2,700 | 3,027 | 401,656 | 2024/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/28 | 国債証券 | 5.1500 | 2,100 | 2,821 | 374,308 | 2028/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/44 | 国債証券 | 5.1500 | 1,500 | 2,249 | 298,491 | 2044/10/31 |
| SPAIN 2.9 10/31/46 | 国債証券 | 2.9000 | 1,800 | 1,899 | 252,062 | 2046/10/31 |
| SPAIN 4.85 10/31/20 | 国債証券 | 4.8500 | 2,900 | 3,283 | 435,602 | 2020/10/31 |
| SPAIN 2.15 10/31/25 | 国債証券 | 2.1500 | 2,600 | 2,793 | 370,584 | 2025/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/27 | 国債証券 | 1.4500 | 1,400 | 1,390 | 184,512 | 2027/10/31 |
| SPAIN 1.3 10/31/26 | 国債証券 | 1.3000 | 2,600 | 2,590 | 343,634 | 2026/10/31 |
| SPAIN 4.4 10/31/23 | 国債証券 | 4.4000 | 2,300 | 2,783 | 369,245 | 2023/10/31 |
| SPAIN 4.3 10/31/19 | 国債証券 | 4.3000 | 4,200 | 4,525 | 600,431 | 2019/10/31 |
| 小計 | — | — | 83,630 | 97,575 | 12,945,318 | — |
| (ユーロ…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ITALY BTPS 4.5 02/01/20 | 国債証券 | 4.5000 | 4,500 | 4,898 | 649,898 | 2020/02/01 |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 2,400 | 3,342 | 443,478 | 2033/02/01 |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37 | 国債証券 | 4.0000 | 3,500 | 4,137 | 548,948 | 2037/02/01 |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47 | 国債証券 | 2.7000 | 1,650 | 1,537 | 203,954 | 2047/03/01 |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 国債証券 | 3.4500 | 250 | 264 | 35,095 | 2048/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/24 | 国債証券 | 4.5000 | 3,700 | 4,393 | 582,874 | 2024/03/01 |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67 | 国債証券 | 2.8000 | 1,400 | 1,246 | 165,381 | 2067/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/25 | 国債証券 | 5.0000 | 2,400 | 2,954 | 391,963 | 2025/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/19 | 国債証券 | 4.5000 | 5,100 | 5,356 | 710,623 | 2019/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/22 | 国債証券 | 5.0000 | 4,400 | 5,175 | 686,604 | 2022/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26 | 国債証券 | 4.5000 | 2,900 | 3,495 | 463,730 | 2026/03/01 |
| ITALY BTPS 4.25 03/01/20 | 国債証券 | 4.2500 | 4,600 | 5,004 | 663,925 | 2020/03/01 |
| ITALY BTPS 3.75 03/01/21 | 国債証券 | 3.7500 | 3,300 | 3,652 | 484,542 | 2021/03/01 |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 国債証券 | 1.6500 | 2,800 | 2,530 | 335,717 | 2032/03/01 |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 国債証券 | 3.5000 | 2,950 | 3,292 | 436,834 | 2030/03/01 |
| ITALY BTPS 0.95 03/15/23 | 国債証券 | 0.9500 | 2,500 | 2,502 | 331,973 | 2023/03/15 |
| ITALY BTPS 1.35 04/15/22 | 国債証券 | 1.3500 | 2,500 | 2,572 | 341,323 | 2022/04/15 |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31 | 国債証券 | 6.0000 | 3,700 | 5,182 | 687,574 | 2031/05/01 |
| ITALY BTPS 4.5 05/01/23 | 国債証券 | 4.5000 | 1,400 | 1,650 | 218,910 | 2023/05/01 |
| ITALY BTPS 3.75 05/01/21 | 国債証券 | 3.7500 | 2,300 | 2,552 | 338,614 | 2021/05/01 |
| ITALY BTPS 1.85 05/15/24 | 国債証券 | 1.8500 | 600 | 618 | 82,109 | 2024/05/15 |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26 | 国債証券 | 1.6000 | 1,500 | 1,473 | 195,502 | 2026/06/01 |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25 | 国債証券 | 1.5000 | 2,500 | 2,480 | 329,131 | 2025/06/01 |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27 | 国債証券 | 2.2000 | 2,800 | 2,843 | 377,271 | 2027/06/01 |
| ITALY BTPS 3.75 08/01/21 | 国債証券 | 3.7500 | 3,200 | 3,570 | 473,663 | 2021/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34 | 国債証券 | 5.0000 | 2,800 | 3,675 | 487,673 | 2034/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39 | 国債証券 | 5.0000 | 3,000 | 3,990 | 529,353 | 2039/08/01 |

| 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 4.75 08/01/23 | 国債証券 | 4.7500 | 1,900 | 2,275 | 301,857 | 2023/08/01 |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 1,300 | 1,299 | 172,346 | 2027/08/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | 4.7500 | 2,050 | 2,668 | 354,063 | 2044/09/01 |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | 3.2500 | 2,000 | 2,073 | 275,080 | 2046/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | 4.7500 | 2,400 | 2,970 | 394,045 | 2028/09/01 |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40 | 国債証券 | 5.0000 | 2,750 | 3,647 | 483,963 | 2040/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/21 | 国債証券 | 4.7500 | 3,900 | 4,495 | 596,421 | 2021/09/01 |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | 2.4500 | 1,100 | 1,077 | 142,984 | 2033/09/01 |
| ITALY BTPS 4.0 09/01/20 | 国債証券 | 4.0000 | 3,700 | 4,066 | 539,476 | 2020/09/01 |
| ITALY BTPS 3.75 09/01/24 | 国債証券 | 3.7500 | 1,900 | 2,178 | 288,989 | 2024/09/01 |
| ITALY BTPS 4.25 09/01/19 | 国債証券 | 4.2500 | 6,400 | 6,837 | 907,148 | 2019/09/01 |
| ITALY BTPS 5.5 09/01/22 | 国債証券 | 5.5000 | 3,900 | 4,726 | 627,078 | 2022/09/01 |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 1,500 | 1,395 | 185,194 | 2036/09/01 |
| ITALY BTPS 1.45 09/15/22 | 国債証券 | 1.4500 | 1,500 | 1,546 | 205,144 | 2022/09/15 |
| ITALY BTPS 0.65 10/15/23 | 国債証券 | 0.6500 | 2,100 | 2,047 | 271,680 | 2023/10/15 |
| ITALY BTPS 9.0 11/01/23 | 国債証券 | 9.0000 | 1,900 | 2,724 | 361,523 | 2023/11/01 |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 国債証券 | 7.2500 | 1,800 | 2,574 | 341,516 | 2026/11/01 |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27 | 国債証券 | 6.5000 | 3,300 | 4,593 | 609,432 | 2027/11/01 |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 国債証券 | 5.2500 | 3,500 | 4,552 | 604,019 | 2029/11/01 |
| ITALY BTPS 5.5 11/01/22 | 国債証券 | 5.5000 | 2,500 | 3,039 | 403,260 | 2022/11/01 |
| ITALY BTPS 0.65 11/01/20 | 国債証券 | 0.6500 | 3,600 | 3,651 | 484,441 | 2020/11/01 |
| ITALY BTPS 0.35 11/01/21 | 国債証券 | 0.3500 | 1,700 | 1,696 | 225,056 | 2021/11/01 |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25 | 国債証券 | 2.0000 | 2,700 | 2,751 | 364,982 | 2025/12/01 |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 国債証券 | 1.2500 | 2,000 | 1,893 | 251,189 | 2026/12/01 |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 4,000 | 4,265 | 565,885 | 2024/12/01 |
| ITALY BTPS 2.15 12/15/21 | 国債証券 | 2.1500 | 2,200 | 2,337 | 310,116 | 2021/12/15 |
| ITALY BTPS 1.05 12/01/19 | 国債証券 | 1.0500 | 2,000 | 2,042 | 271,028 | 2019/12/01 |
| 小計 | - | - | 144,250 | 163,824 | 21,734,606 | - |
| (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 | 747 | 99,193 | 2024/04/15 |
| FINLAND 3.5 04/15/21 | 国債証券 | 3.5000 | 700 | 782 | 103,756 | 2021/04/15 |
| FINLAND 0.75 04/15/31 | 国債証券 | 0.7500 | 450 | 430 | 57,150 | 2031/04/15 |
| FINLAND 3.375 04/15/20 | 国債証券 | 3.3750 | 980 | 1,060 | 140,641 | 2020/04/15 |
| FINLAND 0.5 04/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 600 | 592 | 78,626 | 2026/04/15 |
| FINLAND 1.5 04/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 1,150 | 1,227 | 162,853 | 2023/04/15 |
| FINLAND 4.0 07/04/25 | 国債証券 | 4.0000 | 800 | 999 | 132,659 | 2025/07/04 |
| FINLAND 2.75 07/04/28 | 国債証券 | 2.7500 | 630 | 747 | 99,192 | 2028/07/04 |
| FINLAND 2.625 07/04/42 | 国債証券 | 2.6250 | 660 | 834 | 110,693 | 2042/07/04 |
| FINLAND 4.375 07/04/19 | 国債証券 | 4.3750 | 620 | 662 | 87,840 | 2019/07/04 |
| FINLAND 0.875 09/15/25 | 国債証券 | 0.8750 | 300 | 306 | 40,685 | 2025/09/15 |
| FINLAND 1.625 09/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 400 | 428 | 56,905 | 2022/09/15 |
| FINLAND 09/15/23 | 国債証券 | - | 230 | 226 | 30,052 | 2023/09/15 |
| FINLAND 0.375 09/15/20 | 国債証券 | 0.3750 | 500 | 509 | 67,554 | 2020/09/15 |
| 小計 | - | - | 8,700 | 9,556 | 1,267,806 | - |
| (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 | 1,353 | 179,624 | 2062/01/26 |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47 | 国債証券 | 1.5000 | 230 | 225 | 29,902 | 2047/02/20 |
| AUSTRIA 4.35 03/15/19 | 国債証券 | 4.3500 | 1,050 | 1,104 | 146,550 | 2019/03/15 |

| 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…オーストリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26 | 国債証券 | 4.8500 | 1,300 | 1,738 | 230,597 | 2026/03/15 |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 国債証券 | 4.1500 | 1,650 | 2,432 | 322,666 | 2037/03/15 |
| AUSTRIA 3.65 04/20/22 | 国債証券 | 3.6500 | 1,200 | 1,382 | 183,458 | 2022/04/20 |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34 | 国債証券 | 2.4000 | 900 | 1,047 | 138,939 | 2034/05/23 |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 国債証券 | 3.1500 | 810 | 1,104 | 146,540 | 2044/06/20 |
| AUSTRIA 1.95 06/18/19 | 国債証券 | 1.9500 | 1,400 | 1,446 | 191,872 | 2019/06/18 |
| AUSTRIA 3.9 07/15/20 | 国債証券 | 3.9000 | 1,700 | 1,873 | 248,622 | 2020/07/15 |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 国債証券 | 6.2500 | 1,150 | 1,721 | 228,347 | 2027/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/23 | 国債証券 | - | 350 | 345 | 45,798 | 2023/07/15 |
| AUSTRIA 3.5 09/15/21 | 国債証券 | 3.5000 | 1,900 | 2,147 | 284,842 | 2021/09/15 |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17 | 国債証券 | 2.1000 | 100 | 104 | 13,839 | 2117/09/20 |
| AUSTRIA 1.65 10/21/24 | 国債証券 | 1.6500 | 1,250 | 1,349 | 179,059 | 2024/10/21 |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 国債証券 | 0.7500 | 1,300 | 1,300 | 172,534 | 2026/10/20 |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25 | 国債証券 | 1.2000 | 1,000 | 1,045 | 138,763 | 2025/10/20 |
| AUSTRIA 1.75 10/20/23 | 国債証券 | 1.7500 | 1,400 | 1,516 | 201,209 | 2023/10/20 |
| AUSTRIA 0.25 10/18/19 | 国債証券 | 0.2500 | 250 | 253 | 33,594 | 2019/10/18 |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86 | 国債証券 | 1.5000 | 400 | 342 | 45,447 | 2086/11/02 |
| AUSTRIA 3.4 11/22/22 | 国債証券 | 3.4000 | 1,500 | 1,736 | 230,415 | 2022/11/22 |
| 小 計 | - | - | 21,660 | 25,571 | 3,392,630 | - |
| 合 計 | - | - | - | - | 212,805,760 | - |

■投資信託財産の構成

2018年2月21日現在

| 項 目 | 期 間 | |
|-------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 | % |
| 公 社 債 | 212,805,760 | 97.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 5,129,614 | 2.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 217,935,374 | 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、217,710,466千円、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、2018年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.54円、1カナダ・ドル=85.03円、1オーストラリア・ドル=84.86円、1シンガポール・ドル=81.56円、1イギリス・ポンド=150.59円、1スイス・フラン=114.92円、1デンマーク・クローネ=17.81円、1ノルウェー・クローネ=13.72円、1スウェーデン・クローナ=13.28円、1メキシコ・ペソ=5.75円、1マレーシア・リングギット=27.53円、1南アフリカ・ランド=9.17円、1ポーランド・ズロチ=31.97円、1ユーロ=132.67円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年2月21日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 218,310,227,233円 |
| コ ー ル ・ 公 司 等 | 3,270,760,374 |
| 未 収 入 金 | 212,805,760,129 |
| 未 収 利 息 | 374,880,520 |
| 前 払 費 用 | 1,828,216,079 |
| (B) 負 債 | 447,097,960 |
| 未 払 金 | 374,852,960 |
| 未 払 解 約 金 | 72,245,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 217,863,129,273 |
| 元 本 | 121,875,729,918 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 95,987,399,355 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 121,875,729,918口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 17,876円 |

(注1) 期首元本額 143,106,772,360円
 追加設定元本額 24,631,114,274円
 一部解約元本額 45,862,156,716円

(注2) 期末における元本の内訳
 D I AM外国債券パッシブ・ファンド 8,180,656,532円
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 16,550,949円
 M I T O ラップ型ファンド (中立的型) 44,049,919円
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 50,607,050円
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 84,070,384円
 グローバル8資産ラップファンド (中立的型) 72,228,889円
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 35,964,363円
 たわらノーロード 先進国債券 1,535,100,824円
 たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け> 606,412円
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 18,990,483円
 たわらノーロード バランス (堅実型) 148,917円
 たわらノーロード バランス (標準型) 1,062,375円
 たわらノーロード バランス (積極型) 485,021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) 27,649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) 479,499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) 494,676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) 133,194円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 56,026円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 331,864円
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 181,560円
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 255,754円
 D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金> 5,036,271,157円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 474,597,820円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 1,515,570,262円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 1,682,020,108円
 D I AM DCバランス30インデックスファンド 366,252,324円
 D I AM DCバランス50インデックスファンド 780,311,672円
 D I AM DCバランス70インデックスファンド 633,352,049円
 マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 23,441,361円
 マネックス資産設計ファンド (育成型) 585,178,050円
 マネックス資産設計ファンド エポリューション 6,898,943円
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 17,867,916円
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 39,193,230円
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 71,081,407円
 クルーズコントロール 471,522,151円
 D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金> 67,264,964円

D I AM DC バランス・F (成長型) 119,784,654円
 クルーズコントロール<DC年金> 175,031円
 D I AMコア資産設計ファンド (堅実型) 1,547,650円
 D I AMコア資産設計ファンド (積極型) 4,761,061円
 ダイナミック・ナビゲーション 116,328円
 D I AMパッシブ資産分散ファンド 1,427,367,462円
 D I AM高倍フルヘ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) 6,984,591,409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) 4,074,076,473円
 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) 3,765,907,771円
 先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) 576,382,992円
 D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 107,448,126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) 971,191,594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) 712,187,045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) 57,495,581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) 107,057,634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) 26,555,966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) 12,520,379円
 D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 72,192,093円
 D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 85,457,559円
 D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 3,803,080,276円
 D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 2,505,827,352円
 D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 4,224,822,451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) 766,253,872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) 516,627,848円
 D I AMアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 3,600,829,521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) 9,268,529,264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) 13,975,529円
 D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 85,144,612円
 D I AM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定) 3,043,371,686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) 15,217,078,121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) 19,907,287,350円
 D I AMバランス30VA (適格機関投資家限定) 2,361,904円
 D I AMバランス50VA (適格機関投資家限定) 34,508,457円
 D I AMバランス70VA (適格機関投資家限定) 5,621,656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) 17,709,441,950円
 D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 107,900,809円
 D I AMバランス20VA (適格機関投資家限定) 83,137,353円
 D I AMバランス40VA (適格機関投資家限定) 59,633,095円
 D I AMバランス60VA (適格機関投資家限定) 165,250円
 期末元本合計 121,875,729,918円

■損益の状況

当期 自2017年2月22日 至2018年2月21日

| 項 | 目 | 当 期 |
|--------------------------|---|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | | 6,396,523,685円 |
| 受 取 利 息 | | 6,397,013,677 |
| 支 払 利 息 | | △489,992 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | | 1,702,540,323 |
| 売 買 益 | | 12,881,740,776 |
| 売 買 損 | | △11,179,200,453 |
| (C) そ の 他 費 用 | | △27,989,199 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | | 8,071,074,809 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | | 105,378,243,251 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | | △37,173,122,431 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | | 19,711,203,726 |
| (H) 合 計(D + E + F + G) | | 95,987,399,355 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | | 95,987,399,355 |

(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》

■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)

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16期（決算日 2018年2月15日）

（計算期間 2017年2月16日～2018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 | 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 | | | |
| 12期(2014年2月17日) | 22,679 | 31.2 | ポイント 722,183.69 | % 31.4 | % 95.0 | % 3.0 | 百万円 311,562 |
| 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 |

(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）。

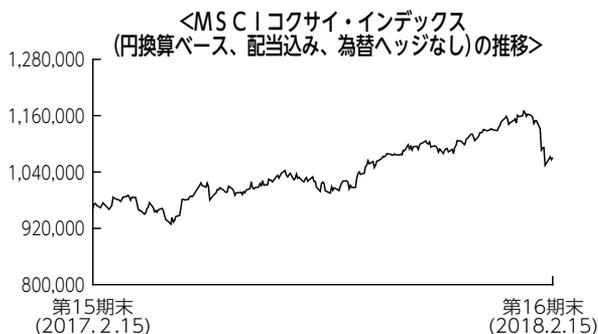
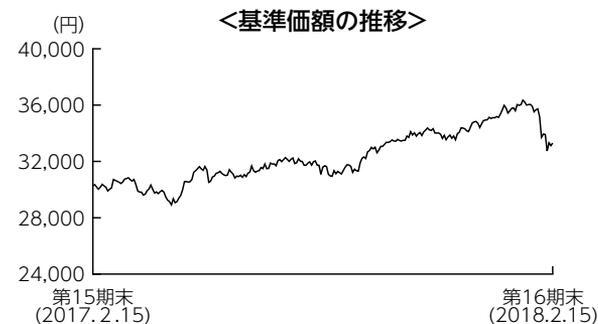
■当期中の基準価額と市況の推移

| 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) 2017年 2月 15日 | 30,270 | % - | 971,437.64 | % - | % 95.6 | % 1.7 |
| 2 月 末 | 30,024 | △0.8 | 965,055.42 | △0.7 | 95.1 | 2.3 |
| 3 月 末 | 30,317 | 0.2 | 974,738.81 | 0.3 | 95.2 | 2.1 |
| 4 月 末 | 30,529 | 0.9 | 980,526.27 | 0.9 | 95.8 | 1.5 |
| 5 月 末 | 30,996 | 2.4 | 996,447.74 | 2.6 | 93.9 | 3.4 |
| 6 月 末 | 31,483 | 4.0 | 1,011,833.79 | 4.2 | 95.4 | 2.0 |
| 7 月 末 | 31,724 | 4.8 | 1,020,073.85 | 5.0 | 95.5 | 1.8 |
| 8 月 末 | 31,604 | 4.4 | 1,016,768.62 | 4.7 | 94.1 | 3.4 |
| 9 月 末 | 33,074 | 9.3 | 1,063,690.07 | 9.5 | 95.6 | 2.0 |
| 10 月 末 | 33,840 | 11.8 | 1,088,210.90 | 12.0 | 94.5 | 3.1 |
| 11 月 末 | 34,071 | 12.6 | 1,096,331.27 | 12.9 | 95.3 | 2.2 |
| 12 月 末 | 35,129 | 16.1 | 1,130,329.13 | 16.4 | 94.7 | 2.8 |
| 2018年 1 月 末 | 35,522 | 17.4 | 1,143,342.43 | 17.7 | 94.7 | 3.0 |
| (期 末) 2018年 2月 15日 | 33,302 | 10.0 | 1,070,930.74 | 10.2 | 95.7 | 2.2 |

(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2月16日から2018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33,302円となり、前期末比で10.0%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場では、欧州通貨に対しては円安となりプラスに寄与しましたが、北米やオセアニア通貨に対しては円高となりマイナスに寄与しました。一方外国株式市場は、企業業績や政策への期待が高まった米国をはじめとして上昇基調が続ぎ、期末にかけて調整局面となったものの、多くの市場で前期末比プラスを維持したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

外国株式市場は、米国では好調な内容の企業決算やF R B（米連邦準備理事会）の金融政策の継続性が好感されたことに加え、トランプ政権の経済政策や税制改革案への期待などから上昇基調を維持しましたが、期末には長期金利の上昇が嫌気され調整しました。欧州ではフランス大統領選挙の結果などから上昇した後、長期金利とユーロの上昇などから反落しました。その後はE C B（欧州中央銀行）による量的緩和策の延長示唆などから持ち直したものの、米国市場の調整を受け期末にかけて下落しました。

ドル／円相場は、F R Bの金融政策の正常化と、トランプ政権の財政拡大策への思惑で金利が上下したことから狭いレンジでの値動きが続きましたが、2018年1月後半に米政府高官がドル安を容認する姿勢を表明したことなどから円高が進行しました。ユーロ／円相場はフランス大統領選挙の結果を受けた安心感からユーロ高となりました。E C Bの金融政策の正常化が意識されたこともユーロ相場を押し上げました。

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 | 銀行 | 9.6% |
| 2 | ソフトウェア・サービス | 9.0 |
| 3 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.5 |
| 4 | 資本財 | 7.3 |
| 5 | エネルギー | 7.2 |
| 6 | 食品・飲料・タバコ | 5.7 |
| 7 | 素材 | 5.0 |
| 8 | 各種金融 | 4.4 |
| 9 | 保険 | 4.1 |
| 10 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 3.9 |



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 |

(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(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10.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマーク比で△0.2%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) 売買委託手数料 | 1円 | 0.003% |
| (株 式) | (0) | (0.001) |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投 資 証 券) | (0) | (0.000) |
| (b) 有価証券取引税 | 1 | 0.003 |
| (株 式) | (1) | (0.003) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投 資 証 券) | (0) | (0.000) |
| (c) その他費用 | 9 | 0.027 |
| (そ の 他) | (9) | (0.027) |
| 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(32,344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8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2月16日から2018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 15,082.96 (2,003.85) | 千アメリカ・ドル 75,009 (△4,804) | 百株 29,880.47 | 千アメリカ・ドル 177,121 | | | | |
| | カ | ナ | ダ | 百株 1,956.18 (△299.25) | 千カナダ・ドル 7,902 (-) | 百株 3,578.36 | 千カナダ・ドル 11,994 | | | | | |
| | オ | ー | ス | ト | ラ | リア | 百株 2,308.92 (△98.59) | 千オーストラリア・ドル 3,878 (△29) | 百株 7,643.47 | 千オーストラリア・ドル 8,517 | | |
| | 香 | | | 港 | 百株 8,233 (2,715.49) | 千香港・ドル 14,512 (-) | 百株 7,383.19 | 千香港・ドル 22,229 | | | | |
| | シ | ン | ガ | ポ | ー | ル | 百株 2,398 (-) | 千シンガポール・ドル 845 (-) | 百株 4,450 | 千シンガポール・ドル 1,939 | | |
| | ニ | ュ | ー | ジ | ー | ラ | ン | ド | 百株 372.49 (-) | 千ニュージーランド・ドル 487 (-) | 百株 505.38 | 千ニュージーランド・ドル 173 |
| | イ | ギ | リ | ス | 百株 14,020.83 (149,367.08) | 千イギリス・ポンド 8,322 (△190) | 百株 171,520 | 千イギリス・ポンド 12,513 | | | | |
| | イ | ス | ラ | エ | ル | 百株 - | 千イスラエル・シケル - | 百株 228.12 | 千イスラエル・シケル 881 | | | |
| | ス | | イ | ス | 百株 1,074.1 (1,596.59) | 千スイス・フラン 5,054 (△488) | 百株 2,978.46 | 千スイス・フラン 12,864 | | | | |
| | デ | ン | マ | ー | ク | 百株 235.24 (-) | 千デンマーク・クローネ 7,739 (-) | 百株 309.93 | 千デンマーク・クローネ 10,644 | | | |
| | ノ | ル | ウ | エ | ー | 百株 - | 千ノルウェー・クローネ - | 百株 194.51 | 千ノルウェー・クローネ 4,127 | | | |
| | ス | ウ | エ | ー | デ | ン | 百株 625.32 (779.26) | 千スウェーデン・クローナ 12,234 (-) | 百株 2,198.05 | 千スウェーデン・クローナ 27,900 | | |
| 国 | ユ | イ | イ | ギ | リ | ス | 百株 160.9 (-) | 千ユーロ 529 (-) | 百株 338.3 | 千ユーロ 1,062 | | |
| | | | ア | イ | ル | ラ | ン | ド | 百株 589.78 (△21,253.5) | 千ユーロ 485 (-) | 百株 99.22 | 千ユーロ 316 |
| | | | オ | ラ | ン | ダ | 百株 565.17 (-) | 千ユーロ 1,526 (△5) | 百株 1,459.05 | 千ユーロ 2,525 | | |
| | | | ベ | ル | ギ | ー | 百株 57.81 (76.6) | 千ユーロ 407 (-) | 百株 122.62 | 千ユーロ 869 | | |
| | | | ル | ク | セ | ン | ブル | グ | 百株 74.76 (△871.65) | 千ユーロ 167 (-) | 百株 175.32 | 千ユーロ 331 |
| | | | フ | ラ | ン | ス | 百株 1,125.14 (206.47) | 千ユーロ 5,171 (△769) | 百株 1,584.94 | 千ユーロ 7,005 | | |
| | | | ド | イ | ツ | 百株 1,510.06 (1,156.1) | 千ユーロ 5,721 (△325) | 百株 2,529.34 | 千ユーロ 7,553 | | | |

| | | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|---------|-------------|-------------------------------|--------------------|-----------------|---------------|
| | | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | ユ ー ロ ム | ス イ ス | 百株 - | 千ユーロ - | 百株 141.05 | 千ユーロ 743 |
| | | ポ ル ト ガ ル | 百株 - | 千ユーロ - | 百株 387.2 | 千ユーロ 106 |
| | | ス ペ イ ン | 百株 3,070.29 (34,774.01) | 千ユーロ 2,340 - | 百株 44,463.72 | 千ユーロ 3,627 |
| | | イ タ リ ア | 百株 3,358.28 (△4,157.83) | 千ユーロ 138 - | 百株 2,965.89 | 千ユーロ 1,732 |
| | | フ ィ ン ラ ン ド | 百株 31.13 - | 千ユーロ 138 - | 百株 469.02 | 千ユーロ 787 |
| | | オ ー ス ト リ ア | 百株 - | 千ユーロ - | 百株 25.7 | 千ユーロ 103 |

(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 | 1.717 (-) | 207 (-) | - (-) | - (-) |
| SL GREEN | 1.861 (-) | 190 (-) | 4.201 (-) | 429 (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 1.051 (-) | 197 (-) | 1.6 (-) | 277 (-) |
| EQUINIX INC | 0.512 (-) | 230 (-) | 0.305 (-) | 131 (-) |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 6.724 (-) | 675 (-) | 3.675 (-) | 367 (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | - (-) | - (-) | 0.759 (-) | 175 (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 1.525 (-) | 202 (-) | 3.122 (-) | 390 (-) |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 1.418 (-) | 217 (-) | 2.405 (-) | 374 (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | - (-) | - (-) | 6.999 (-) | 126 (-) |
| REALTY INCOME CORP | 4.459 (-) | 256 (-) | 5.521 (-) | 285 (-) |
| REGENCY CENTERS CORP | 3.929 (-) | 276 (-) | - (-) | - (-) |
| UDR INC | - (-) | - (-) | 4.339 (-) | 157 (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | - (-) | - (-) | 1.691 (-) | 265 (-) |
| VENTAS INC | - (-) | - (-) | 1.99 (-) | 133 (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | - (-) | - (-) | - (-) | - (-) |
| WEYERHAEUSER CO | 5.644 (-) | 184 (-) | 10.713 (-) | 360 (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | - (-) | - (-) | 1.839 (-) | 140 (-) |

| | 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 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 3.331 | 404 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| VEREIT INC | 12.775 | 115 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| AMERICAN TOWER CORP | — | — | 0.972 | 125 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| JBG SMITH PROPERTIES | — | — | 6.105 | 213 |
| | (6.105) | (—) | (—) | (—) |
| INVITATION HOMES INC | 22.567 | 523 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | — | — | 0.728 | 19 |
| | (0.728) | (19) | (—) | (—) |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| STOCKLAND | — | — | 66.82 | 314 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| GOODMAN GROUP | — | — | 22.008 | 184 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| 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 INVT | — | — | — | — |
| | (—) | (△1) | (—) | (—) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 203.5 | 347 | 414.5 | 685 |
| | (—) | (12) | (—) | (—) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | — | — | — | — |
| | (—) | (△2) | (—) | (—) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST-RTS | — | — | 44.753 | 11 |
| | (44.753) | (△12) | (—) | (—) |
| 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 | 14.763 | 149 | 35.939 | 350 |
| | (△4.081) | (△39) | (—) | (—) |
| INTU PROPERTIES PLC | — | — | 74.712 | 146 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| SEGRO PLC | 10.185 | 46 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| SEGRO PLC-RTS | — | — | 10.185 | 11 |
| | (10.185) | (—) | (—) | (—) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GECINA SA | 0.458 | 58 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| FONCIERE DES REGIONS | — | — | — | — |
| | (—) | (△2) | (—) | (—) |
| GECINA SA-RTS | — | — | 3.212 | 8 |
| | (3.212) | (—) | (—) | (—) |

(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 77,196 | 百万円 76,328 | 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 | 43,644,879 | 千円 |
| (b) | 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 273,628,164 | 千円 |
| (c) | 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 0.15 | |

(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2月16日から2018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 | 300.84 | 288.29 | 41,832 | 4,470,201 | | | インターネット販売・通信販売 |
| ABBOTT LABORATORIES | 1,279.14 | 1,226.02 | 7,145 | 763,540 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| AES CORP | 455.79 | 455.79 | 468 | 50,020 | | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 679.24 | 623.73 | 9,652 | 1,031,503 | | | 情報技術サービス |
| ADVANCED MICRO DEVICES | - | 595.29 | 726 | 77,607 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| ADOBE SYSTEMS INC | 376.84 | 351.38 | 6,926 | 740,192 | | | ソフトウェア |
| CHUBB LTD | 348.45 | 327.73 | 4,827 | 515,827 | | | 保険 |
| AGCO CORP | 56.1 | 56.1 | 384 | 41,130 | | | 機械 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 156.71 | 150.19 | 2,422 | 258,827 | | | 化学 |
| ALLEGHANY CORP | 10.54 | 10.54 | 619 | 66,236 | | | 保険 |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS | 652.07 | - | - | - | | | 化学 |
| RALPH LAUREN CORP | 47.03 | 34.97 | 373 | 39,865 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ALLSTATE CORP | 273.16 | 257.54 | 2,447 | 261,529 | | | 保険 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 538.83 | 514.41 | 7,735 | 826,636 | | | コングロマリット |
| AMGEN INC | 556.7 | 515.12 | 9,247 | 988,180 | | | バイオテクノロジー |
| HESS CORP | 204.21 | 204.21 | 926 | 99,005 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 583.49 | 535.81 | 5,156 | 550,980 | | | 消費者金融 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 369.6 | 348.59 | 2,276 | 243,244 | | | 電力 |
| AFLAC INC | 306.73 | 282.18 | 2,473 | 264,297 | | | 保険 |
| AMERICAN INTL GROUP | 795.35 | 634.48 | 3,769 | 402,802 | | | 保険 |
| AMERCO | 5.51 | 5.51 | 195 | 20,931 | | | 陸運・鉄道 |
| ANALOG DEVICES | 230.69 | 258.69 | 2,202 | 235,330 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| ANADARKO PETROLEUM CORP | 410.03 | 387.91 | 2,318 | 247,800 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 172.66 | 160.15 | 1,973 | 210,839 | | | バイオテクノロジー |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 688.62 | 645.78 | 2,422 | 258,849 | | | 建設関連製品 |
| TIME WARNER | 579.64 | 545.67 | 5,157 | 551,148 | | | メディア |
| JONES LANG LASALLE INC | 38.15 | 28.18 | 449 | 48,078 | | | 不動産管理・開発 |
| VALERO ENERGY CORP | 354.05 | 321.05 | 2,973 | 317,789 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| APACHE CORP | 283.09 | 250.25 | 955 | 102,153 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ANSYS INC | 56.19 | 56.19 | 886 | 94,690 | | | ソフトウェア |
| APPLE INC | 4,022.14 | 3,645.93 | 61,021 | 6,520,803 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| APPLIED MATERIALS INC | 829 | 753.04 | 3,912 | 418,121 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| ALBEMARLE CORP | 79.04 | 79.04 | 883 | 94,361 | | | 化学 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 444.21 | 383.03 | 1,601 | 171,171 | | | 食品 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 78.31 | 78.31 | 595 | 63,673 | | | 電力 |
| AMEREN CORP | 173.12 | 173.12 | 946 | 101,155 | | | 総合公益事業 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 74.03 | 57.56 | 461 | 49,323 | | | 電子装置・機器・部品 |
| AUTOLIV INC | 61.97 | 61.97 | 899 | 96,119 | | | 自動車部品 |
| AUTODESK INC | 142.59 | 142.59 | 1,567 | 167,486 | | | ソフトウェア |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 342.27 | 312.05 | 3,517 | 375,838 | | | 情報技術サービス |
| AUTOZONE INC | 22.29 | 20.15 | 1,452 | 155,213 | | | 専門小売り |
| AVERY DENNISON CORP | 73.68 | 62.62 | 739 | 79,040 | | | 容器・包装 |
| AVNET INC | 102.88 | 102.88 | 431 | 46,063 | | | 電子装置・機器・部品 |
| BAKER HUGHES INC | 309.16 | - | - | - | | | エネルギー設備・サービス |
| BALL CORP | 121.62 | 243.24 | 927 | 99,083 | | | 容器・包装 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 912.51 | 897.17 | 17,991 | 1,922,608 | | | 各種金融サービス |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 791.07 | 737.49 | 4,128 | 441,168 | | | 資本市場 |
| CR BARD INC | 53.09 | - | - | - | | | ヘルスケア機器・用品 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 376.87 | 348.76 | 2,302 | 246,083 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| BED BATH & BEYOND INC | 107.44 | - | - | - | | | 専門小売り |
| BECTON DICKINSON & CO | 158.08 | 185.86 | 4,087 | 436,842 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| AMETEK INC | 167.75 | 167.75 | 1,253 | 133,923 | | | 電気設備 |
| BE AEROSPACE INC | 82.29 | - | - | - | | | 航空宇宙・防衛 |
| VERIZON COMM INC | 3,050.99 | 2,874.66 | 14,232 | 1,520,878 | | | 各種電気通信サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-----------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| WR BERKLEY CORP | 81.34 | 81.34 | 564 | 60,348 | 保険 |
| BEST BUY CO INC | 210.33 | 192.1 | 1,393 | 148,867 | 専門小売り |
| YUM! BRANDS INC | 284.94 | 237.38 | 1,848 | 197,553 | ホテル・レストラン・レジャー |
| FIRSTENERGY CORP | 307.96 | 307.96 | 983 | 105,142 | 電力 |
| H&R BLOCK INC | 161.14 | 161.14 | 434 | 46,389 | 各種消費者サービス |
| BOEING CO | 441.46 | 395.46 | 13,637 | 1,457,296 | 航空宇宙・防衛 |
| ROBERT HALF INTL INC | 108.46 | 81.58 | 457 | 48,923 | 専門サービス |
| BORGWARNER INC | 146.48 | 146.48 | 783 | 83,727 | 自動車部品 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 1,005.78 | 975.41 | 2,615 | 279,446 | ヘルスケア機器・用品 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 98.94 | 98.94 | 914 | 97,723 | 航空貨物・物流サービス |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | - | 72.33 | 770 | 82,362 | ソフトウェア |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC | 18.38 | 18.38 | 1,148 | 122,690 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,244.92 | 1,166.34 | 7,622 | 814,490 | 医薬品 |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP INC | 37.88 | 37.88 | 717 | 76,686 | 資本市場 |
| INGREDION INC | 53.05 | 53.05 | 689 | 73,690 | 食品 |
| ONEOK INC | 164.01 | 261.77 | 1,504 | 160,759 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | - | 44.18 | 488 | 52,219 | 保険 |
| UNITED RENTALS INC | 63.32 | 63.32 | 1,057 | 113,025 | 商社・流通業 |
| SEMPRA ENERGY | 181.76 | 169.12 | 1,783 | 190,607 | 総合公益事業 |
| FEDEX CORP | 186.72 | 181.03 | 4,359 | 465,863 | 航空貨物・物流サービス |
| VERISIGN INC | 63.21 | 63.21 | 720 | 76,989 | インターネットソフトウェア・サービス |
| AMPHENOL CORP | 233.04 | 214.9 | 1,876 | 200,569 | 電子装置・機器・部品 |
| BROWN-FORMAN CORP | 166.42 | 136.12 | 916 | 97,951 | 飲料 |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 223.37 | - | - | - | 各種電気通信サービス |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 1,270.92 | 1,270.92 | 773 | 82,708 | メディア |
| CSX CORP | 694.49 | 639.92 | 3,529 | 377,125 | 陸運・鉄道 |
| CABOT OIL & GAS CORP | 380.49 | 322.61 | 774 | 82,737 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CAMPBELL SOUP CO | 140.5 | 140.5 | 659 | 70,504 | 食品 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 232.39 | 206.13 | 1,058 | 113,152 | コンピュータ・周辺機器 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 130.81 | 122.4 | 2,619 | 279,904 | 飲料 |
| CARDINAL HEALTH INC | 242.12 | 221.25 | 1,489 | 159,210 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED | 273.39 | 249.16 | 1,742 | 186,163 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CATERPILLAR INC | 440.65 | 422.78 | 6,682 | 714,087 | 機械 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 98.32 | 98.32 | 994 | 106,325 | ソフトウェア |
| CELGENE CORP | 576.2 | 547.31 | 5,166 | 552,045 | バイオテクノロジー |
| CORE LABORATORIES N.V. | 36.12 | - | - | - | エネルギー設備・サービス |
| CITRIX SYSTEMS INC | 108.96 | 108.96 | 974 | 104,139 | ソフトウェア |
| CENTURYLINK INC | 393.84 | 636.8 | 1,119 | 119,629 | 各種電気通信サービス |
| CERNER CORP | 237.65 | 208.09 | 1,294 | 138,355 | ヘルスケア・テクノロジー |
| JPMORGAN CHASE & CO | 2,699.75 | 2,489.45 | 28,636 | 3,060,058 | 銀行 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 188.22 | 188.22 | 920 | 98,313 | 家庭用品 |
| CIGNA CORP | 190.66 | 175.95 | 3,440 | 367,673 | 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 | 109.82 | 829 | 88,684 | 保険 |
| CINTAS CORP | 62.82 | 62.82 | 1,032 | 110,333 | 商業サービス・用品 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 962.33 | - | - | - | 各種電気通信サービス |
| CISCO SYSTEMS INC | 3,754.61 | 3,545.12 | 14,921 | 1,594,501 | 通信機器 |
| CLOROX COMPANY | 93.31 | 93.31 | 1,201 | 128,427 | 家庭用品 |
| COCA-COLA CO/THE | 3,065.59 | 2,862.56 | 12,623 | 1,348,988 | 飲料 |
| COGNEX CORP | - | 115.08 | 668 | 71,386 | 電子装置・機器・部品 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 631.28 | 598.19 | 4,164 | 445,029 | 家庭用品 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 253.01 | 224.36 | 3,258 | 348,214 | ホテル・レストラン・レジャー |
| COMERICA INC | 120.68 | 120.68 | 1,175 | 125,605 | 銀行 |
| COMCAST CORP-CL A | 1,795.52 | 3,332.55 | 13,140 | 1,404,166 | メディア |
| CA INC | 227.32 | 227.32 | 789 | 84,412 | ソフトウェア |
| COMPUTER SCIENCES CORP | 105.56 | - | - | - | 情報技術サービス |
| CONAGRA BRANDS INC | 319.42 | 283.23 | 1,006 | 107,565 | 食品 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 236.6 | 217.5 | 1,650 | 176,383 | 総合公益事業 |

| 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| CMS ENERGY CORP | 223.72 | 192.91 | 827 | 88,435 | 総合公益事業 |
| COOPER COS INC | 37.94 | 37.94 | 871 | 93,163 | ヘルスケア機器・用品 |
| MOLSON COORS BREWING CO | 138.55 | 138.55 | 1,114 | 119,109 | 飲料 |
| CORNING INC | 791.97 | 656.41 | 1,937 | 207,065 | 電子装置・機器・部品 |
| WR GRACE & CO | 59.23 | 33.14 | 218 | 23,372 | 化学 |
| SEALED AIR CORP | 160.41 | 138.7 | 589 | 63,006 | 容器・包装 |
| CUMMINS INC | 121.94 | 112.39 | 1,865 | 199,365 | 機械 |
| DR HORTON INC | 244.98 | 244.98 | 1,112 | 118,903 | 家庭用耐久財 |
| DANAHER CORP | 463.24 | 445.24 | 4,278 | 457,227 | ヘルスケア機器・用品 |
| MOODY'S CORP | 129.24 | 118.22 | 1,933 | 206,612 | 資本市場 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 454.69 | 415.89 | 3,319 | 354,736 | 情報技術サービス |
| TARGET CORP | 402.45 | 374.86 | 2,824 | 301,833 | 複合小売り |
| DEERE & CO | 204.74 | 193.64 | 3,161 | 337,865 | 機械 |
| MORGAN STANLEY | 1,063.41 | 962.61 | 5,299 | 566,269 | 資本市場 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 173.75 | 173.75 | 1,121 | 119,793 | 商業サービス・用品 |
| COSTAR GROUP INC | 22.78 | 22.78 | 787 | 84,135 | インターネットソフトウェア・サービス |
| THE WALT DISNEY CO | 1,139.84 | 1,087.74 | 11,377 | 1,215,827 | メディア |
| DOLLAR TREE INC | 174.93 | 174.93 | 1,851 | 197,903 | 複合小売り |
| DOVER CORP | 107.36 | 107.36 | 1,070 | 114,369 | 機械 |
| DOW CHEMICAL | 838.95 | - | - | - | 化学 |
| OMNICOM GROUP | 169.93 | 169.93 | 1,406 | 150,317 | メディア |
| DTE ENERGY CO | 131.22 | 131.22 | 1,328 | 141,946 | 総合公益事業 |
| DUKE ENERGY CORP | 517.65 | 492.92 | 3,720 | 397,579 | 電力 |
| FLOWSERVE CORP | 84.06 | 84.06 | 354 | 37,897 | 機械 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 94.36 | 94.36 | 902 | 96,406 | ホテル・レストラン・レジャー |
| EBAY INC | 829.14 | 707.31 | 3,001 | 320,774 | インターネットソフトウェア・サービス |
| BANK OF AMERICA CORP | 7,614.01 | 7,087.28 | 22,679 | 2,423,509 | 銀行 |
| CITIGROUP INC | 2,166.01 | 1,934.5 | 14,839 | 1,585,754 | 銀行 |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 101.93 | 101.93 | 1,016 | 108,595 | 化学 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 187.4 | 187.4 | 965 | 103,191 | 資本市場 |
| EATON CORP PLC | 348 | 322.34 | 2,664 | 284,758 | 電気設備 |
| EATON VANCE CORP | 91.84 | 91.84 | 508 | 54,359 | 資本市場 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 208.77 | 208.77 | 806 | 86,180 | ソフトウェア |
| DISH NETWORK CORP | 161.5 | 161.5 | 725 | 77,539 | メディア |
| ECOLAB INC | 200.98 | 190.09 | 2,467 | 263,662 | 化学 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 231.05 | 217.66 | 2,693 | 287,878 | ソフトウェア |
| SALESFORCE.COM INC | 491.19 | 482.4 | 5,259 | 561,990 | ソフトウェア |
| EMERSON ELECTRIC CO | 480.79 | 456.25 | 3,253 | 347,671 | 電気設備 |
| ATMOS ENERGY CORP | 82.21 | 82.21 | 659 | 70,490 | ガス |
| WEATHERFORD INTL PLC | 704.4 | - | - | - | エネルギー設備・サービス |
| ENTERGY CORP | 139.84 | 121.99 | 902 | 96,439 | 電力 |
| EOG RESOURCES INC | 427.07 | 399.63 | 4,266 | 455,912 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EQUIFAX INC | 84.95 | 84.95 | 968 | 103,531 | 専門サービス |
| EQT CORP | 138.74 | 171.49 | 831 | 88,896 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE | 161.34 | 161.34 | 2,254 | 240,905 | パーソナル用品 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL | 142.79 | 125.5 | 799 | 85,387 | 航空貨物・物流サービス |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 479.94 | 389.11 | 2,915 | 311,561 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 3,098.35 | 2,987.36 | 22,841 | 2,440,827 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FMC CORP | 106.94 | 89.7 | 764 | 81,724 | 化学 |
| NEXTERA ENERGY INC | 346.12 | 335.13 | 5,029 | 537,466 | 電力 |
| ASSURANT INC | 49.6 | 40.89 | 366 | 39,168 | 保険 |
| FASTENAL CO | 216.54 | 216.54 | 1,183 | 126,457 | 商社・流通業 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 577.32 | 521.73 | 1,734 | 185,375 | 銀行 |
| M&T BANK CORP | 106.64 | 97.99 | 1,881 | 201,026 | 銀行 |
| FISERV INC | 158.8 | 140.95 | 1,950 | 208,456 | 情報技術サービス |
| FLIR SYSTEMS INC | 116.23 | 116.23 | 570 | 60,946 | 電子装置・機器・部品 |
| MACY'S INC | 245.12 | 192.66 | 493 | 52,786 | 複合小売り |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|--------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| FORD MOTOR CO | 2,791.41 | 2,618.95 | 2,812 | 300,570 | 自動車 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 275.1 | 223.14 | 888 | 94,925 | 資本市場 |
| FREEMONT-MCMORAN INC | 968.12 | 968.12 | 1,851 | 197,802 | 金属・鉱業 |
| FLEX LTD | 443.63 | 359.13 | 613 | 65,547 | 電子装置・機器・部品 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 121.76 | 121.76 | 830 | 88,736 | 保険 |
| TEGNA INC | 169.63 | — | — | — | メディア |
| GAP INC/THE | 182.95 | 182.95 | 605 | 64,730 | 専門小売り |
| DENTSPLY SIRONA INC | 174.77 | 174.77 | 999 | 106,788 | ヘルスケア機器・用品 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 192.55 | 179.42 | 3,915 | 418,446 | 航空宇宙・防衛 |
| GENERAL MILLS INC | 438.79 | 387.27 | 2,169 | 231,872 | 食品 |
| GENUINE PARTS CO | 110.94 | 97.85 | 968 | 103,464 | 販売 |
| GILEAD SCIENCES INC | 982.71 | 919.6 | 7,524 | 804,032 | バイオテクノロジー |
| GARTNER INC | 68.29 | 71.53 | 861 | 92,075 | 情報技術サービス |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 180.97 | 180.97 | 535 | 57,203 | 自動車部品 |
| MCKESSON CORP | 169.86 | 150.54 | 2,239 | 239,321 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| NVIDIA CORP | 397.6 | 426.45 | 10,295 | 1,100,161 | 半導体・半導体製造装置 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 6,699.33 | 6,080.18 | 9,059 | 968,094 | コンプロマリット |
| WW GRAINGER INC | 44.86 | 38.32 | 1,014 | 108,407 | 商社・流通業 |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 222.36 | — | — | — | ソフトウェア |
| HALLIBURTON CO | 646.33 | 615.28 | 2,945 | 314,739 | エネルギー設備・サービス |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 295.22 | 295.22 | 1,886 | 201,586 | 飲料 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 271.15 | 253.81 | 6,664 | 712,173 | 資本市場 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 129.01 | 129.01 | 618 | 66,090 | 自動車 |
| HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE | 56.79 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| HARRIS CORP | 89.54 | 89.54 | 1,387 | 148,279 | 航空宇宙・防衛 |
| HASBRO INC | 89.09 | 77.36 | 748 | 79,947 | レジャー用品 |
| HENRY SCHEIN INC | 57.13 | 114.26 | 781 | 83,551 | 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 | 72.13 | 476 | 50,964 | エネルギー設備・サービス |
| HERSHEY FOODS CORP | 113.06 | 101.32 | 1,003 | 107,209 | 食品 |
| HP INC | 1,310.66 | 1,227.25 | 2,612 | 279,205 | コンピュータ・周辺機器 |
| F5 NETWORKS INC | 48.74 | 48.74 | 699 | 74,739 | 通信機器 |
| CROWN HOLDINGS INC NPR | 114.81 | 77.81 | 394 | 42,114 | 容器・包装 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 636.98 | — | — | — | タバコ |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 34.47 | 34.47 | 471 | 50,433 | バイオテクノロジー |
| JUNIPER NETWORKS INC | 277.4 | 277.4 | 725 | 77,575 | 通信機器 |
| HOLLYFRONTIER CORP | 138.88 | 110.51 | 516 | 55,242 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HOLOGIC INC | 175 | 191.33 | 727 | 77,754 | ヘルスケア機器・用品 |
| UNUM GROUP | 160 | 160 | 839 | 89,676 | 保険 |
| HOME DEPOT INC | 922.04 | 834.42 | 15,410 | 1,646,809 | 専門小売り |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 128.87 | 128.87 | 1,089 | 116,420 | バイオテクノロジー |
| HORMEL FOODS CORP | 233.22 | 193.45 | 658 | 70,367 | 食品 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 319.52 | 319.52 | 836 | 89,422 | 総合公益事業 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | — | 23.37 | 476 | 50,877 | 建設関連製品 |
| HUMANA INC | 115.8 | 104.68 | 2,799 | 299,194 | 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 | 59.27 | 711 | 76,003 | 陸運・鉄道 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 751.61 | 751.61 | 1,194 | 127,623 | 銀行 |
| RED HAT INC | 134.72 | 120.98 | 1,623 | 173,479 | ソフトウェア |
| BIOGEN INC | 162.73 | 148.61 | 4,400 | 470,188 | バイオテクノロジー |
| IDEX CORP | — | 46.99 | 634 | 67,808 | 機械 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 235.99 | 220.32 | 3,579 | 382,509 | 機械 |
| INTUIT INC | 177.39 | 169.34 | 2,775 | 296,588 | ソフトウェア |
| IDEXX LABORATORIES INC | 70.5 | 62.55 | 1,115 | 119,150 | ヘルスケア機器・用品 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 194.9 | 167.3 | 1,512 | 161,596 | 機械 |
| INTEL CORP | 3,532.16 | 3,312.36 | 15,031 | 1,606,264 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 55.78 | 55.78 | 807 | 86,340 | 化学 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 283.75 | 283.75 | 1,656 | 177,017 | 容器・包装 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 291.57 | 291.57 | 714 | 76,303 | メディア |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 79.31 | 79.31 | 504 | 53,952 | 建設・土木 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | - | 41.73 | 497 | 53,190 | 情報技術サービス |
| INCYTE CORP | 123.6 | 123.6 | 1,089 | 116,454 | バイオテクノロジー |
| JOHNSON & JOHNSON | 2,048.04 | 1,895.11 | 24,573 | 2,625,966 | 医薬品 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 293.04 | 255.3 | 1,392 | 148,765 | 保険 |
| KLA-TENCOR CORP | 117.24 | 117.24 | 1,259 | 134,641 | 半導体・半導体製造装置 |
| DEVON ENERGY CORP | 341.84 | 341.84 | 1,215 | 129,897 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WESTAR ENERGY INC | 99.11 | 99.11 | 493 | 52,753 | 電力 |
| KELLOGG CO | 189.22 | 189.22 | 1,281 | 136,970 | 食品 |
| EAST WEST BANCORP INC | - | 85.09 | 569 | 60,875 | 銀行 |
| KEYCORP | 812.64 | 715.5 | 1,514 | 161,862 | 銀行 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 266.63 | 242.02 | 2,728 | 291,545 | 家庭用品 |
| BLACKROCK INC/NEW YORK | 90.3 | 86.16 | 4,652 | 497,125 | 資本市場 |
| KOHL'S CORP | 148.62 | 113.57 | 733 | 78,362 | 複合小売り |
| KROGER CO | 693.81 | 620.93 | 1,763 | 188,441 | 食品・生活必需品小売り |
| LAM RESEARCH CORP | 115.22 | 115.22 | 2,108 | 225,329 | 半導体・半導体製造装置 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 74.55 | 61.57 | 714 | 76,314 | 容器・包装 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 126.22 | 126.22 | 844 | 90,193 | インターネットソフトウェア・サービス |
| LEGGETT & PLATT INC | 95.88 | 95.88 | 430 | 46,034 | 家庭用耐久財 |
| LENNAR CORP | 148.5 | 162 | 991 | 105,997 | 家庭用耐久財 |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 214.62 | 214.62 | 541 | 57,840 | 各種金融サービス |
| ELI LILLY & CO | 741.2 | 702.83 | 5,413 | 578,529 | 医薬品 |
| L BRANDS INC | 185.83 | 162.62 | 810 | 86,661 | 専門小売り |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 172.76 | 141.63 | 1,094 | 116,990 | 保険 |
| LINEAR TECH CORP | 174.56 | - | - | - | 半導体・半導体製造装置 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 517.38 | 479.82 | 5,114 | 546,576 | 航空貨物・物流サービス |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 242.66 | 223.57 | 1,558 | 166,518 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 197.23 | 182.4 | 6,468 | 691,277 | 航空宇宙・防衛 |
| LOEWS CORP | 213.46 | 213.46 | 1,043 | 111,474 | 保険 |
| RANGE RESOURCES CORP | 136.97 | 136.97 | 179 | 19,232 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LOWE'S COS INC | 651.95 | 581.78 | 5,639 | 602,604 | 専門小売り |
| DOMINION ENERGY INC | 470.31 | 451.31 | 3,355 | 358,519 | 総合公益事業 |
| SCANA CORP | 109.02 | 109.02 | 397 | 42,498 | 総合公益事業 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 321.98 | 321.98 | 1,108 | 118,496 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MCCORMICK & CO INC | 91.63 | 74.76 | 775 | 82,892 | 食品 |
| MCDONALD'S CORPORATION | 636.62 | 575.15 | 9,201 | 983,307 | ホテル・レストラン・レジャー |
| S&P GLOBAL INC | 202.95 | 184.09 | 3,424 | 365,955 | 資本市場 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 32.72 | 28.55 | 692 | 74,010 | 保険 |
| MANPOWERGROUP INC | 57.03 | 42.57 | 523 | 55,939 | 専門サービス |
| MARKEL CORPORATION | 9.89 | 9.89 | 1,102 | 117,839 | 保険 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 157.76 | 147.74 | 1,923 | 205,568 | ヘルスケア機器・用品 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 383.23 | 358.21 | 2,946 | 314,877 | 保険 |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO | 40.56 | - | - | - | パーソナル用品 |
| MASCO CORP | 230.43 | 230.43 | 989 | 105,734 | 建設関連製品 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 43.87 | 43.87 | 946 | 101,119 | 建設資材 |
| MATTEL INC | 240.03 | 240.03 | 396 | 42,347 | レジャー用品 |
| METLIFE INC | 707.19 | 649.37 | 3,032 | 324,059 | 保険 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 203.42 | 203.42 | 1,203 | 128,555 | 半導体・半導体製造装置 |
| MEDTRONIC PLC | 1,042.27 | 951.77 | 7,791 | 832,566 | ヘルスケア機器・用品 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 433.73 | 500.52 | 3,486 | 372,526 | ソフトウェア |
| CVS HEALTH CORP | 793.53 | 719.13 | 5,018 | 536,309 | 食品・生活必需品小売り |
| MERCK & CO.INC. | 2,069.07 | 1,931.11 | 10,601 | 1,132,907 | 医薬品 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 71.76 | 71.76 | 1,239 | 132,423 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MICROSOFT CORP | 5,534.14 | 5,166.74 | 46,919 | 5,013,782 | ソフトウェア |
| MICRON TECH INC | 761.46 | 761.46 | 3,308 | 353,550 | 半導体・半導体製造装置 |
| MIDDLEBY CORP | 41 | 41 | 547 | 58,472 | 機械 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 151.76 | 153.31 | 1,260 | 134,682 | 半導体・半導体製造装置 |

| 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 | 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 | | |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 349.22 | 264.63 | 589 | 62,947 | | 半導体・半導体製造装置 |
| 3M CO | 452.18 | 424.07 | 9,838 | 1,051,333 | | コングロマリット |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 47.59 | 40.42 | 1,024 | 109,493 | | 家庭用耐久財 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 111.5 | 105.82 | 1,111 | 118,755 | | 通信機器 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 87.89 | 72.47 | 770 | 82,382 | | 陸運・鉄道 |
| MURPHY OIL CORPORATION | 124.43 | — | — | — | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 165.87 | — | — | — | | 医薬品 |
| MYLAN NV | 347.54 | 313.44 | 1,295 | 138,465 | | 医薬品 |
| ILLUMINA INC | 112.55 | 104.53 | 2,332 | 249,215 | | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| XCEL ENERGY INC | 375.54 | 375.54 | 1,623 | 173,442 | | 電力 |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 269.38 | 269.38 | 946 | 101,153 | | エネルギー設備・サービス |
| NETAPP INC | 206.41 | 183.87 | 1,114 | 119,147 | | コンピュータ・周辺機器 |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 137.4 | 137.4 | 367 | 39,246 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NEWELL BRANDS INC | 323.24 | 362.06 | 984 | 105,236 | | 家庭用耐久財 |
| DUN & BRADSTREET CORP | 30.12 | — | — | — | | 専門サービス |
| NEWMONT MINING CORP | 380.93 | 380.93 | 1,485 | 158,754 | | 金属・鉱業 |
| NVR INC | — | 2.36 | 722 | 77,170 | | 家庭用耐久財 |
| NIKE INC-CL B | 998.76 | 925.05 | 6,286 | 671,790 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOBLE ENERGY INC | 310.05 | 310.05 | 820 | 87,667 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NORDSTROM INC | 94.87 | 94.87 | 477 | 51,054 | | 複合小売り |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 226.04 | 199.73 | 2,841 | 303,606 | | 陸運・鉄道 |
| EVERSOURCE ENERGY | 230.85 | 230.85 | 1,329 | 142,041 | | 電力 |
| NISOURCE INC | 221.98 | 221.98 | 504 | 53,941 | | 総合公益事業 |
| TAPESTRY INC | 191.75 | 191.75 | 968 | 103,456 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NORTHERN TRUST CORP | 160.9 | 160.9 | 1,652 | 176,562 | | 資本市場 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 126.2 | 115.69 | 4,044 | 432,222 | | 航空宇宙・防衛 |
| WELLS FARGO & CO | 3,580.22 | 3,326.95 | 19,811 | 2,117,108 | | 銀行 |
| NUCOR CORP | 237.8 | 237.8 | 1,550 | 165,656 | | 金属・鉱業 |
| MONSANTO CO | 332.43 | 308.56 | 3,708 | 396,266 | | 化学 |
| CHENIERE ENERGY INC | 159.27 | 159.27 | 926 | 99,019 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 372.94 | 330.07 | 3,214 | 343,471 | | 消費者金融 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 565.46 | 541.21 | 3,780 | 403,968 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | — | 38.14 | 528 | 56,455 | | 陸運・鉄道 |
| OGE ENERGY CORP | 160.28 | 160.28 | 493 | 52,718 | | 電力 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 70.17 | 63.75 | 1,578 | 168,639 | | 専門小売り |
| ORACLE CORP | 2,313.9 | 2,189.56 | 10,827 | 1,157,013 | | ソフトウェア |
| PACCAR INC | 265.78 | 244.57 | 1,690 | 180,643 | | 機械 |
| EXELON CORP | 696.07 | 699.1 | 2,558 | 273,423 | | 電力 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 99.81 | 88.08 | 1,619 | 173,081 | | 機械 |
| PATTERSON COS INC | 71.69 | — | — | — | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PAYCHEX INC | 231.41 | 231.41 | 1,512 | 161,650 | | 情報技術サービス |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 65.26 | 65.26 | 328 | 35,140 | | 保険 |
| MEDNAX INC | 78.24 | — | — | — | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 52.55 | 52.55 | 1,294 | 138,332 | | ヘルスケア機器・用品 |
| PPL CORPORATION | 499.57 | 456.66 | 1,382 | 147,713 | | 電力 |
| PEPSICO INC | 1,076.08 | 1,003.05 | 10,944 | 1,169,505 | | 飲料 |
| PENTAIR PLC | 117.75 | 117.75 | 833 | 89,098 | | 機械 |
| PFIZER INC | 4,536.02 | 4,197.44 | 14,770 | 1,578,406 | | 医薬品 |
| CONOCOPHILLIPS | 917.66 | 861.15 | 4,780 | 510,816 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PVH CORP | 66.82 | 53.87 | 811 | 86,728 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| PG&E CORP | 376.51 | 343.61 | 1,342 | 143,494 | | 電力 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 129.77 | 121.58 | 2,182 | 233,207 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,460.55 | 1,359.28 | 8,859 | 946,756 | | タバコ |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 364.46 | 345.38 | 5,466 | 584,131 | | 銀行 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 50.1 | 38.45 | 449 | 48,072 | | レジャー用品 |
| GARMIN LTD | 77.95 | 77.95 | 498 | 53,310 | | 家庭用耐久財 |
| AETNA INC | 261.11 | 237.44 | 4,197 | 448,515 | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|----------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| FLUOR CORP (NEW) | 98.21 | 98.21 | 563 | 60,208 | 建設・土木 |
| PPG INDUSTRIES INC | 192.89 | 176.74 | 2,055 | 219,687 | 化学 |
| IPG PHOTONICS CORP | — | 24.41 | 616 | 65,852 | 電子装置・機器・部品 |
| PRAXAIR INC | 218.68 | 205.19 | 3,181 | 340,015 | 化学 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 325.74 | 308.69 | 5,783 | 618,004 | 食品・生活必需品小売り |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 183.04 | 163.03 | 1,765 | 188,708 | 資本市場 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 103.78 | 103.78 | 1,053 | 112,573 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO | 1,914.88 | 1,799.72 | 14,520 | 1,551,622 | 家庭用品 |
| PROGRESSIVE CORP | 443.58 | 413.36 | 2,327 | 248,686 | 保険 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 371.15 | 371.15 | 1,767 | 188,866 | 総合公益事業 |
| PULTE GROUP INC | 254.77 | 212.09 | 624 | 66,767 | 家庭用耐久財 |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC | 398.7 | 303.88 | 420 | 44,974 | 貯蓄・担当・不動産金融 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 107.69 | 107.69 | 1,158 | 123,800 | 情報技術サービス |
| QUALCOMM INC | 1,099.93 | 1,042.28 | 6,940 | 741,666 | 半導体・半導体製造装置 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 101.87 | 101.87 | 927 | 99,082 | 資本市場 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 35.35 | 25.5 | 330 | 35,312 | 保険 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 56.59 | 56.59 | 1,871 | 199,975 | バイオテクノロジー |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC | 46.42 | 46.42 | 714 | 76,380 | 保険 |
| AUTONATION INC | 57.72 | 57.72 | 304 | 32,523 | 専門小売り |
| RESMED INC | 113.76 | 93.94 | 878 | 93,829 | ヘルスケア機器・用品 |
| US BANCORP | 1,278.15 | 1,186.41 | 6,562 | 701,218 | 銀行 |
| SEATTLE GENETICS INC /WA | 73.17 | 73.17 | 395 | 42,269 | バイオテクノロジー |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 86.74 | 86.74 | 781 | 83,458 | 保険 |
| RITE AID CORP | 85.98 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| ROSS STORES INC | 305.42 | 281.89 | 2,224 | 237,758 | 専門小売り |
| ROLLINS INC | — | 53.57 | 258 | 27,592 | 商業サービス・用品 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 78.2 | 69.83 | 1,893 | 202,288 | コンピュータ |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 96.67 | 88.67 | 1,658 | 177,272 | 電気設備 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 135.67 | 122.93 | 1,604 | 171,468 | ホテル・レストラン・レジャー |
| RAYTHEON COMPANY | 219.4 | 204.63 | 4,350 | 464,843 | 航空宇宙・防衛 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 43.99 | 38.48 | 962 | 102,819 | 情報技術サービス |
| ACCENTURE PLC-CL A | 464.33 | 437.4 | 6,989 | 746,867 | 情報技術サービス |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 1,153.09 | 1,064.78 | 4,574 | 488,809 | 食品 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 99.19 | 88.49 | 1,409 | 150,587 | 保険 |
| ROCKWELL COLLINS INC | 95.35 | 120.86 | 1,624 | 173,630 | 航空宇宙・防衛 |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC | 212.29 | 197.55 | 2,777 | 296,809 | 保険 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 230.52 | 227.18 | 2,180 | 233,053 | 情報技術サービス |
| PRICELINE GROUP INC | 36.7 | 34.6 | 6,291 | 672,330 | インターネット販売・通信販売 |
| SCHLUMBERGER LTD | 1,035.7 | 984.76 | 6,486 | 693,159 | エネルギー設備・サービス |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 880.2 | 839.88 | 4,400 | 470,287 | 資本市場 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 152.55 | 141.75 | 1,668 | 178,284 | ヘルスケア機器・用品 |
| BUNGE LTD | 113.67 | 103.34 | 775 | 82,888 | 食品 |
| SEI INVESTMENTS CO | 111.07 | 93.15 | 679 | 72,644 | 資本市場 |
| ANTHEM INC | 195.43 | 184.48 | 4,335 | 463,307 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 143.48 | 122.57 | 1,181 | 126,263 | 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 | 214.42 | 1,356 | 144,970 | 保険 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 59.58 | 59.58 | 2,416 | 258,272 | 化学 |
| CENTENE CORP | 138.99 | 127.13 | 1,298 | 138,744 | 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 | 858 | 91,717 | 銀行 |
| IAC INTERACTIVE CORP | — | 50.5 | 756 | 80,806 | インターネットソフトウェア・サービス |
| SMITH (A.O.) CORP | 95.65 | 95.65 | 612 | 65,476 | 建設関連製品 |
| ACUITY BRANDS INC | 30.87 | 30.87 | 468 | 50,032 | 電気設備 |
| SNAP-ON INC | 39.32 | 39.32 | 625 | 66,820 | 機械 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 321.42 | 302.03 | 3,360 | 359,123 | 保険 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 52.73 | 52.73 | 574 | 61,429 | 専門小売り |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 389.97 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EDISON INTERNATIONAL | 241.39 | 219.63 | 1,301 | 139,034 | 電力 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| SOUTHERN CO | 733.54 | 703.53 | 3,065 | 327,631 | 電力 |
| BB&T CORP | 598.28 | 558.28 | 3,056 | 326,566 | 銀行 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 113.52 | 113.52 | 655 | 70,030 | 旅客航空輸送業 |
| AT&T INC | 4,604.98 | 4,324.05 | 15,743 | 1,682,389 | 各種電気通信サービス |
| CHEVRON CORP | 1,408.02 | 1,334.69 | 15,166 | 1,620,647 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 115.9 | 105.28 | 1,676 | 179,182 | 機械 |
| STAPLES INC | 526.62 | - | - | - | 専門小売り |
| STATE STREET CORP | 291.22 | 270.99 | 2,816 | 300,989 | 資本市場 |
| STARBUCKS CORP | 1,089.82 | 1,014.69 | 5,681 | 607,098 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STEEL DYNAMICS INC | - | 153.09 | 716 | 76,544 | 金属・鋳業 |
| STRYKER CORP | 251.17 | 241.4 | 3,771 | 403,036 | ヘルスケア機器・用品 |
| NETFLIX INC | 318.78 | 305.87 | 8,136 | 869,428 | インターネット販売・通信販売 |
| STERICYCLE INC | 68.53 | 68.53 | 509 | 54,403 | 商業サービス・用品 |
| SUNTRUST BANKS INC | 377.16 | 347.56 | 2,435 | 260,241 | 銀行 |
| SYMANTEC CORP | 465.81 | 416.94 | 1,126 | 120,385 | ソフトウェア |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | - | 97.93 | 476 | 50,932 | 陸運・鉄道 |
| SYNOPSIS INC | 106.56 | 106.56 | 923 | 98,634 | ソフトウェア |
| SYSCO CORP | 407.82 | 359.26 | 2,096 | 224,008 | 食品・生活必需品小売り |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 28.37 | 77.88 | 3,192 | 341,120 | ヘルスケア機器・用品 |
| TELEFLEX INC | 32.03 | 32.03 | 835 | 89,319 | ヘルスケア機器・用品 |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 677.17 | 638.53 | 1,234 | 131,894 | 医薬品 |
| ANDEAVOR | 93.95 | 115 | 1,134 | 121,180 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 748.8 | 696.26 | 7,149 | 763,963 | 半導体・半導体製造装置 |
| TEXTRON INC | 190.76 | 190.76 | 1,121 | 119,861 | 航空宇宙・防衛 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 293.4 | 280.65 | 5,846 | 624,727 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| TIFFANY & CO | 87.33 | 87.33 | 900 | 96,223 | 専門小売り |
| TOLL BROTHERS INC | 133.56 | 95.26 | 442 | 47,324 | 家庭用耐久財 |
| TORCHMARK CORP | 76.99 | 76.99 | 664 | 71,000 | 保険 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 112.79 | 112.79 | 954 | 101,990 | 情報技術サービス |
| DAVITA INC | 122.45 | 108.78 | 813 | 86,891 | 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 | 92.76 | 630 | 67,403 | 専門小売り |
| TRIMBLE INC | 200.73 | 200.73 | 803 | 85,821 | 電子装置・機器・部品 |
| TYSON FOODS INC | 216.21 | 216.21 | 1,639 | 175,222 | 食品 |
| UGI CORP | 120.68 | 120.68 | 521 | 55,774 | ガス |
| MARATHON OIL CORP | 667.02 | 587.47 | 995 | 106,407 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| UNION PACIFIC CORP | 620.06 | 566.17 | 7,540 | 805,811 | 陸運・鉄道 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 592.3 | 536.9 | 6,802 | 726,917 | 航空宇宙・防衛 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 712.72 | 683.78 | 15,643 | 1,671,666 | 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 | 63.51 | 742 | 79,302 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VALSPAR CORP | 61.22 | - | - | - | 化学 |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 68.48 | 68.48 | 818 | 87,469 | ヘルスケア機器・用品 |
| VF CORP | 243.09 | 243.09 | 2,034 | 217,398 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CBS CORP | 311.52 | 237.81 | 1,328 | 141,928 | メディア |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 189.57 | 177.42 | 2,790 | 298,150 | バイオテクノロジー |
| VULCAN MATERIALS CO | 99.77 | 89.64 | 1,161 | 124,162 | 建設資材 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 686.96 | 632.86 | 4,334 | 463,180 | 食品・生活必需品小売り |
| WALMART INC | 1,160.11 | 1,061.26 | 10,793 | 1,153,341 | 食品・生活必需品小売り |
| WASTE MANAGEMENT INC | 340.95 | 322.16 | 2,661 | 284,358 | 商業サービス・用品 |
| WATERS CORP | 59.63 | 59.63 | 1,220 | 130,385 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| ALLERGAN PLC | 294.78 | 233.13 | 3,884 | 415,113 | 医薬品 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 87.55 | 76.71 | 928 | 99,194 | 食品 |
| VAIL RESORTS INC | - | 25.98 | 551 | 58,936 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESTERN DIGITAL CORP | 221.06 | 205.16 | 1,709 | 182,687 | コンピュータ・周辺機器 |
| WABTEC CORP | 73.63 | 54.97 | 402 | 42,998 | 機械 |
| WHIRLPOOL CORP | 55.53 | 55.53 | 950 | 101,594 | 家庭用耐久財 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 135.29 | 135.29 | 1,415 | 151,293 | 半導体・半導体製造装置 |
| WYNN RESORTS LTD | 62.79 | 62.79 | 1,030 | 110,147 | ホテル・レストラン・レジャー |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------------|---------|--------|----------|-----------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| WHOLE FOODS MARKET INC | 226.75 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| NASDAQ INC | 91.32 | 91.32 | 728 | 77,833 | 資本市場 |
| CME GROUP INC | 251.49 | 242.03 | 3,924 | 419,373 | 資本市場 |
| WILLIAMS COS INC | 547.22 | 610.81 | 1,831 | 195,682 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 74.89 | — | — | — | 専門小売り |
| LKQ CORP | 229.48 | 229.48 | 950 | 101,620 | 販売 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 163.83 | 163.83 | 624 | 66,718 | 電力 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 231.17 | 231.17 | 1,390 | 148,562 | 総合公益事業 |
| FOOT LOCKER INC | 94.76 | — | — | — | 専門小売り |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 186.31 | 186.31 | 1,051 | 112,386 | 資本市場 |
| CARMAX INC | 135.13 | 135.13 | 861 | 92,098 | 専門小売り |
| XEROX CORP | 698.21 | 174.55 | 519 | 55,565 | コンピュータ・周辺機器 |
| XILINX INC | 187.77 | 168.37 | 1,125 | 120,294 | 半導体・半導体製造装置 |
| ALTABA INC | 662.77 | — | — | — | インターネットソフトウェア・サービス |
| CIMAREX ENERGY CO | 70.03 | 70.03 | 715 | 76,472 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TJX COMPANIES INC | 485.66 | 439.99 | 3,369 | 360,011 | 専門小売り |
| ZIONS BANCORP | — | 165.84 | 903 | 96,600 | 銀行 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 947 | 764 | 524 | 56,005 | 不動産管理・開発 |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 200 | 157 | 968 | 103,463 | コングロマリット |
| JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD | — | 171 | 655 | 70,077 | コングロマリット |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | — | 60.51 | 725 | 77,580 | バイオテクノロジー |
| SIGNATURE BANK | 41.71 | 41.71 | 638 | 68,194 | 銀行 |
| CBRE GROUP INC | 209.76 | 209.76 | 944 | 100,956 | 不動産管理・開発 |
| LIBERTY GLOBAL PLC | 160.73 | 124.35 | 453 | 48,488 | メディア |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 940 | 844.86 | 1,636 | 174,875 | 銀行 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 39.35 | 32.56 | 683 | 72,990 | ホテル・レストラン・レジャー |
| T-MOBILE US INC | 211.88 | 211.88 | 1,242 | 132,724 | 無線通信サービス |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 337.34 | 283.87 | 2,113 | 225,839 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MOSAIC CO/THE | 265.25 | 265.25 | 682 | 72,902 | 化学 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS | 309.14 | 273.32 | 988 | 105,670 | メディア |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC | 799.25 | 753.4 | 2,753 | 294,257 | メディア |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP | 54.73 | 54.73 | 350 | 37,459 | 運送インフラ |
| CELANESE CORP | 107.66 | 94.91 | 975 | 104,240 | 化学 |
| DEXCOM INC | 61.61 | — | — | — | ヘルスケア機器・用品 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A | 104.23 | 104.23 | 248 | 26,541 | メディア |
| EXPEDIA INC | 97.86 | 87.09 | 871 | 93,157 | インターネット販売・通信販売 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 184.75 | 184.75 | 732 | 78,298 | 化学 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 116.27 | 105.78 | 1,698 | 181,480 | 資本市場 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 505.37 | 418.18 | 1,460 | 156,046 | メディア |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 462.98 | 420.85 | 2,990 | 319,616 | 資本市場 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 146.96 | 146.96 | 261 | 27,890 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VIACOM INC-CLASS B | 275.27 | 246.12 | 835 | 89,237 | メディア |
| LIVE NATION | — | 88.64 | 401 | 42,917 | メディア |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 20.89 | 18.07 | 523 | 55,980 | ホテル・レストラン・レジャー |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 61.91 | 61.91 | 406 | 43,451 | 旅客航空輸送業 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 38.12 | 38.12 | 1,106 | 118,290 | 航空宇宙・防衛 |
| MASTERCARD INC | 724.64 | 670.15 | 11,561 | 1,235,454 | 情報技術サービス |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP | 295.31 | 295.31 | 825 | 88,264 | インターネット販売・通信販売 |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 74.36 | 74.36 | 904 | 96,680 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HANESBRANDS INC | 276.19 | 276.19 | 583 | 62,391 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| WESTERN UNION CO | 352.22 | 352.22 | 715 | 76,405 | 情報技術サービス |
| OWENS CORNING | — | 73.33 | 632 | 67,640 | 建設関連製品 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | — | 93.22 | 612 | 65,476 | 情報技術サービス |
| AERCAP HOLDINGS NV | 115.86 | 115.86 | 610 | 65,209 | 商社・流通業 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC | — | 75.76 | 697 | 74,553 | 航空宇宙・防衛 |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR | 180.99 | 180.99 | 508 | 54,308 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SPECTRA ENERGY CORP | 516.46 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 83.3 | 83.3 | 810 | 86,646 | 情報技術サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 184.4 | 227.46 | 445 | 47,591 | 銀行 |
| DELTA AIR LINES INC | 146.11 | 94.73 | 494 | 52,841 | 旅客航空輸送業 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 63.54 | 63.54 | 341 | 36,461 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DISCOVER FINANCIAL | 308.04 | 271.77 | 2,109 | 225,389 | 消費者金融 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 270.26 | 243.11 | 2,424 | 259,111 | 電子装置・機器・部品 |
| CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX | 105.52 | 105.52 | 1,549 | 165,597 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WABCO HOLDING INC | 43.79 | 31.76 | 454 | 48,607 | 機械 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 90.52 | 66.83 | 542 | 58,002 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VMWARE INC | 54.91 | 54.91 | 683 | 73,005 | ソフトウェア |
| MERCADOLIBRE INC | 28.61 | 28.61 | 1,074 | 114,864 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ULTA BEAUTY INC | 43.32 | 43.32 | 895 | 95,712 | 専門小売り |
| INVESCO LTD | 298.24 | 298.24 | 989 | 105,712 | 資本市場 |
| MSCI INC | 64.62 | 64.62 | 941 | 100,575 | 資本市場 |
| CALPINE CORP NPR | 278.76 | - | - | - | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,158.85 | 1,089.48 | 11,171 | 1,193,789 | タバコ |
| VISA INC | 1,411.88 | 1,300.02 | 15,708 | 1,678,572 | 情報技術サービス |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 143.77 | 125.72 | 1,444 | 154,375 | 飲料 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 143.01 | 119.92 | 939 | 100,377 | 水道 |
| SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE | 65.85 | 65.85 | 576 | 61,627 | メディア |
| SIGNET JEWELERS LTD | 60.95 | - | - | - | 専門小売り |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 160.85 | 160.85 | 364 | 38,983 | メディア |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 397.47 | 366.73 | 2,499 | 267,110 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 116.24 | 116.24 | 734 | 78,453 | 建設関連製品 |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC | 18.26 | 18.26 | 192 | 20,591 | 家庭用品 |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE | 1,404.75 | 1,339.61 | 2,337 | 249,798 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| XYLEM INC | 116.3 | 128.73 | 943 | 100,845 | 機械 |
| ALKERMES PLC | 120.53 | 120.53 | 714 | 76,364 | バイオテクノロジー |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | 270.49 | 230.62 | 2,582 | 276,013 | 化学 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 34.79 | 34.79 | 839 | 89,744 | 航空宇宙・防衛 |
| SPLUNK INC | 106.74 | 106.74 | 985 | 105,336 | ソフトウェア |
| HCA HEALTHCARE INC | 233.2 | 201.73 | 2,015 | 215,374 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VERISK ANALYTICS INC | 122.27 | 100.53 | 971 | 103,806 | 専門サービス |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 48.46 | 39.87 | 581 | 62,135 | 医薬品 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 65.44 | 65.44 | 1,274 | 136,201 | 情報技術サービス |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO | 136.97 | - | - | - | 食品 |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 105.55 | 106.68 | 1,015 | 108,469 | 銀行 |
| CIT GROUP INC | 162.66 | 92.87 | 497 | 53,123 | 銀行 |
| NXP SEMICONDUCTOR NV | 226.52 | 226.52 | 2,602 | 278,077 | 半導体・半導体製造装置 |
| TARGA RESOURCES CORP | 125.32 | 164.45 | 786 | 84,017 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | - | 4,056 | 141 | 15,169 | 運送インフラ |
| LEAR CORP | 51.32 | 51.32 | 986 | 105,381 | 自動車部品 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | - | 70.4 | 809 | 86,513 | 資本市場 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | - | 106.33 | 529 | 56,539 | ソフトウェア |
| DOLLAR GENERAL CORP | 215 | 193.55 | 1,871 | 199,940 | 複合小売り |
| FORTINET INC | 113.99 | 113.99 | 551 | 58,931 | ソフトウェア |
| AON PLC | 206.06 | 184.87 | 2,587 | 276,513 | 保険 |
| TESLA INC | 98.75 | 93.57 | 3,015 | 322,274 | 自動車 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV | 113.92 | 113.92 | 602 | 64,373 | 電気設備 |
| GENERAL MOTORS CO | 1,054.43 | 911.38 | 3,810 | 407,187 | 自動車 |
| WORLDPAY INC | 121.41 | 104.48 | 776 | 82,942 | 情報技術サービス |
| TRIPADVISOR INC | 92.63 | 92.63 | 377 | 40,306 | インターネット販売・通信販売 |
| ALLY FINANCIAL INC | 352.51 | 314.09 | 894 | 95,622 | 消費者金融 |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 119.23 | 99.58 | 631 | 67,443 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VOYA FINANCIAL INC | 135.25 | 135.25 | 692 | 73,983 | 各種金融サービス |
| APTIV PLC | 205.32 | 190.69 | 1,767 | 188,875 | 自動車部品 |
| PHILLIPS 66 | 346.86 | 309.76 | 2,890 | 308,931 | 石油・ガス・消耗燃料 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 期末 | |
| | | | 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 | |
| FACEBOOK INC | 1,735.36 | 1,675.84 | 30,084 | 3,214,848 | インターネットソフトウェア・サービス |
| IQVIA HOLDINGS INC | 119.68 | 100.51 | 1,052 | 112,431 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 56.16 | 70.54 | 866 | 92,588 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SERVICENOW INC | 126.4 | 122.06 | 1,803 | 192,702 | ソフトウェア |
| WHITELWAVE FOODS CO | 144.44 | - | - | - | 食品 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 70.48 | 62.15 | 984 | 105,179 | 通信機器 |
| TESARO INC | - | 26.46 | 163 | 17,434 | バイオテクノロジー |
| WORKDAY INC | 87.1 | 91.87 | 1,108 | 118,503 | ソフトウェア |
| ABBVIE INC | 1,213.23 | 1,122.99 | 12,698 | 1,356,990 | バイオテクノロジー |
| ZOETIS INC | 344.81 | 344.25 | 2,563 | 273,912 | 医薬品 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD | 122.24 | 122.24 | 719 | 76,912 | ホテル・レストラン・レジャー |
| COTY INC | 388.71 | 314.4 | 668 | 71,393 | パーソナル用品 |
| NEWS CORP/NEW-CL A | 302.63 | 302.63 | 494 | 52,841 | メディア |
| MALLINCKRODT PLC | 94.19 | - | - | - | 医薬品 |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | - | 128.91 | 463 | 49,563 | 商社・流通業 |
| CDW CORP | 98.77 | 108.24 | 761 | 81,405 | 電子装置・機器・部品 |
| SPRINT CORP | 638.82 | 638.82 | 339 | 36,248 | 無線通信サービス |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 101.99 | 101.99 | 520 | 55,659 | 旅客航空輸送業 |
| ARCONIC INC | 342.59 | 275.13 | 701 | 74,912 | 航空宇宙・防衛 |
| ENVISION HEALTHCARE CORP | 47.3 | 86.92 | 324 | 34,663 | 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 | 456 | 48,754 | メディア |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 50.06 | 50.06 | 211 | 22,558 | メディア |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C | 183.3 | 133.68 | 558 | 59,668 | メディア |
| XL GROUP LTD | 202.59 | 171.66 | 746 | 79,794 | 保険 |
| BROADCOM LTD | 294.75 | 287.37 | 7,117 | 760,523 | 半導体・半導体製造装置 |
| DELL TECHNOLOGIES INC | 172.83 | 150.74 | 1,053 | 112,547 | ソフトウェア |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 154.1 | 154.1 | 248 | 26,577 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BAKER HUGHES A GE CO | - | 284.04 | 750 | 80,191 | エネルギー設備・サービス |
| TECHNIPFMC LTD | 148.16 | 325.56 | 981 | 104,924 | エネルギー設備・サービス |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC | - | 62.91 | 350 | 37,451 | 保険 |
| ANTERO RESOURCES CORP | 131.63 | 131.63 | 240 | 25,698 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VEEVA SYSTEMS INC | - | 69.8 | 404 | 43,186 | ヘルスケア・テクノロジー |
| TWITTER INC | 436.92 | 436.92 | 1,474 | 157,576 | インターネットソフトウェア・サービス |
| PLAINS GP HOLDINGS LP | 78.37 | 78.37 | 178 | 19,069 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMMScope HOLDING CO INC | - | 129.2 | 502 | 53,678 | 通信機器 |
| ALLEGION PLC | - | 54.02 | 431 | 46,163 | 建設関連製品 |
| PERRIGO CO PLC | 103.22 | 85.53 | 741 | 79,204 | 医薬品 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 147.96 | 147.96 | 1,272 | 135,927 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ARAMARK | 173.07 | 173.07 | 712 | 76,103 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SABRE CORP | 176.24 | 176.24 | 380 | 40,622 | 情報技術サービス |
| NAVIENT CORP | 226.36 | - | - | - | 消費者金融 |
| PARSLEY ENERGY INC | 109.49 | 174.54 | 409 | 43,774 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ARISTA NETWORKS INC | - | 31.58 | 954 | 101,954 | 通信機器 |
| IHS MARKIT LTD | 267.41 | 275.11 | 1,268 | 135,525 | 専門サービス |
| FNF GROUP | 205.71 | 177.6 | 679 | 72,649 | 保険 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 626.91 | 574.85 | 2,109 | 225,442 | 消費者金融 |
| MOBILEYE NV | 140.01 | - | - | - | ソフトウェア |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | 390.2 | 348.45 | 1,597 | 170,724 | 銀行 |
| CDK GLOBAL INC | 83.09 | 83.09 | 595 | 63,591 | ソフトウェア |
| QORVO INC | 105.99 | 87.84 | 692 | 73,985 | 半導体・半導体製造装置 |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 113.89 | 113.89 | 412 | 44,032 | 各種電気通信サービス |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I | 78.18 | 78.18 | 704 | 75,314 | メディア |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 147.1 | 147.1 | 453 | 48,477 | 化学 |
| LIBERTY LILAC GROUP-C | 63.05 | - | - | - | メディア |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 268.4 | 268.4 | 885 | 94,590 | 専門サービス |
| TRANSUNION | - | 103.41 | 577 | 61,683 | 専門サービス |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC | 51.28 | - | - | - | 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 | |
| SQUARE INC | - | 173.76 | 727 | 77,707 | 情報技術サービス |
| DOWDUPONT INC | - | 1,652.19 | 11,785 | 1,259,352 | 化学 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC | 160.9 | 140 | 521 | 55,682 | 飲料 |
| WESTROCK CO | 177.44 | 177.44 | 1,140 | 121,920 | 容器・包装 |
| KRAFT HEINZ CO | 453.82 | 438.18 | 3,151 | 336,757 | 食品 |
| FORTIVE CORP | 237.58 | 216.82 | 1,608 | 171,893 | 機械 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 101.57 | 188.79 | 1,309 | 139,967 | 商業サービス・用品 |
| ALPHABET INC-CL A | 219.99 | 208.92 | 22,410 | 2,394,823 | インターネットソフトウェア・サービス |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | 1,215.9 | 1,132.42 | 1,828 | 195,431 | コンピュータ・周辺機器 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 805.67 | 810.79 | 6,264 | 669,475 | 情報技術サービス |
| FIRST DATA CORP | 220.35 | 220.35 | 349 | 37,297 | 情報技術サービス |
| DXC TECHNOLOGY CO | - | 196.49 | 1,967 | 210,263 | 情報技術サービス |
| ZILLOW GROUP INC-C | 81.34 | 81.34 | 382 | 40,826 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ALPHABET INC-CL C | 231.39 | 222.97 | 23,851 | 2,548,728 | インターネットソフトウェア・サービス |
| L3 TECHNOLOGIES INC | 58.92 | 58.92 | 1,231 | 131,590 | 航空宇宙・防衛 |
| CHEMOURS CO | - | 127.23 | 623 | 66,633 | 化学 |
| ATHENE HOLDING LTD | - | 89.84 | 436 | 46,686 | 保険 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC | 161.19 | 135.83 | 4,875 | 520,994 | メディア |
| VISTRA ENERGY CORP | - | 158.25 | 288 | 30,878 | 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> | 232,562.52 600銘柄 | 219,768.86 602銘柄 | 1,670,715 - | 178,532,685 <62.8%> |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 161.41 | 161.41 | 922 | 78,879 | 金属・鉱業 |
| ALIMENTATION COUCHE TARD INC | 307.28 | 307.28 | 1,878 | 160,565 | 食品・生活必需品小売り |
| BARRICK GOLD CORP | 836.48 | 836.48 | 1,433 | 122,554 | 金属・鉱業 |
| ATCO LTD | 71.93 | 71.93 | 302 | 25,867 | 総合公益事業 |
| BANK OF MONTREAL | 477.43 | 454.51 | 4,418 | 377,675 | 銀行 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 894.36 | 844.84 | 6,566 | 561,342 | 銀行 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 237.56 | 237.56 | 1,466 | 125,332 | 銀行 |
| BCE INC | 115.68 | 115.68 | 643 | 55,008 | 各種電気通信サービス |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT | 650.43 | 575 | 2,782 | 237,841 | 資本市場 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN | 258.19 | 258.19 | 593 | 50,761 | 医薬品 |
| BOMBARDIER INC 'B' | 1,516.15 | 1,516.15 | 498 | 42,638 | 航空宇宙・防衛 |
| SAPUTO INC | 206.8 | 141.01 | 571 | 48,816 | 食品 |
| BLACKBERRY LTD | 396.52 | 396.52 | 599 | 51,248 | ソフトウェア |
| CGI GROUP INC | 152.28 | 152.28 | 1,103 | 94,359 | 情報技術サービス |
| CCL INDUSTRIES INC | 22.68 | 113.4 | 633 | 54,137 | 容器・包装 |
| CAE INC | 230 | 230 | 531 | 45,415 | 航空宇宙・防衛 |
| CAMECO CORP | 326.27 | 326.27 | 379 | 32,407 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROGERS COMM-CL B | 259.67 | 259.67 | 1,483 | 126,809 | 無線通信サービス |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 301.59 | 294.71 | 3,404 | 290,990 | 銀行 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 843.39 | 794.2 | 3,149 | 269,244 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN TIRE CORP-CL A | 48.62 | 48.62 | 796 | 68,055 | 複合小売り |
| CANADIAN UTILITIES LTD | 91.19 | 91.19 | 312 | 26,705 | 総合公益事業 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 573.06 | 526.87 | 5,076 | 433,930 | 陸運・鉄道 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 114.17 | 114.17 | 219 | 18,728 | 不動産管理・開発 |
| AGRIUM INC | 93.82 | - | - | - | 化学 |
| YAMANA GOLD INC | 675.2 | - | - | - | 金属・鉱業 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 139.3 | 139.3 | 541 | 46,283 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OPEN TEXT CORP | 197.56 | 197.56 | 876 | 74,895 | ソフトウェア |
| ELDORADO GOLD CORP | 467.9 | - | - | - | 金属・鉱業 |
| EMPIRE CO LTD | 150.93 | 150.93 | 351 | 30,008 | 食品・生活必需品小売り |
| KINROSS GOLD CORP | 997.41 | 997.41 | 534 | 45,698 | 金属・鉱業 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 98.92 | 98.92 | 328 | 28,072 | 商社・流通業 |
| FORTIS INC | 290.02 | 290.02 | 1,151 | 98,395 | 電力 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 552.96 | 552.96 | 1,166 | 99,686 | 金属・鉱業 |
| TELUS CORP | 189.45 | 159.45 | 706 | 60,352 | 各種電気通信サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|--|----------|----------|--------|---------|-------|--------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 千株 | 千円 | | | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | | | | | |
| GREAT WEST LIFECO INC | 248.37 | 192.48 | 654 | 55,907 | | | 保険 |
| IMPERIAL OIL LTD | 215.42 | 215.42 | 747 | 63,878 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENBRIDGE INC | 688.27 | 1,126.14 | 4,826 | 412,580 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| IGM FINANCIAL INC | 84.26 | 84.26 | 330 | 28,241 | | | 資本市場 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 879.95 | 879.95 | 319 | 27,304 | | | 金属・鉱業 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 1,441.96 | 1,365.17 | 3,395 | 290,219 | | | 保険 |
| LINAMAR CORP | 38.27 | 38.27 | 267 | 22,886 | | | 自動車部品 |
| LOBLAW CO LTD | 179.36 | 153.54 | 990 | 84,666 | | | 食品・生活必需品小売り |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC | 65.24 | 65.24 | 381 | 32,618 | | | 保険 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 292.08 | 253.39 | 1,734 | 148,239 | | | 自動車部品 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 464.05 | 408.42 | 2,110 | 180,388 | | | 保険 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 18.05 | 19.85 | 1,250 | 106,885 | | | 保険 |
| METRO INC | 193.5 | 123.89 | 481 | 41,195 | | | 食品・生活必需品小売り |
| HUSKY ENERGY INC | 287.49 | 287.49 | 470 | 40,253 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 399.92 | 399.92 | 357 | 30,527 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| METHANEX CORP | 73.81 | 73.81 | 531 | 45,395 | | | 化学 |
| ONEX CORP | 66.46 | 66.46 | 588 | 50,276 | | | 各種金融サービス |
| GOLDCORP INC | 676.52 | 510.66 | 856 | 73,246 | | | 金属・鉱業 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 610.76 | - | - | - | | | 化学 |
| POWER CORP OF CANADA | 250.52 | 250.52 | 749 | 64,029 | | | 保険 |
| POWER FINANCIAL CORP | 174.84 | 174.84 | 573 | 49,005 | | | 保険 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 1,108.68 | 1,039.45 | 10,447 | 893,053 | | | 銀行 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 124.59 | 131.34 | 693 | 59,244 | | | 建設・土木 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 106.07 | 106.07 | 2,416 | 206,552 | | | 陸運・鉄道 |
| SHAW COMM INC-B | 340.29 | 275.48 | 704 | 60,188 | | | メディア |
| SUNCOR ENERGY INC | 1,262.73 | 1,168.95 | 4,970 | 424,867 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LUNDIN MINING CORP | - | 352.68 | 306 | 26,197 | | | 金属・鉱業 |
| ENCANA CORP | 692.57 | 692.57 | 970 | 82,940 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 410.16 | 410.16 | 1,556 | 133,089 | | | 金属・鉱業 |
| THOMSON REUTERS CORP | 251.28 | 204.69 | 1,027 | 87,851 | | | 資本市場 |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$ | 1,385.62 | 1,311.89 | 9,487 | 810,999 | | | 銀行 |
| TRANSCANADA CORP | 628.95 | 628.95 | 3,373 | 288,382 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 56.96 | 56.96 | 491 | 42,048 | | | 紙製品・林産品 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 31.05 | 31.05 | 321 | 27,499 | | | 食品・生活必需品小売り |
| INTACT FINANCIAL CORP | 107.18 | 107.85 | 1,044 | 89,286 | | | 保険 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 339.43 | 339.43 | 846 | 72,333 | | | 金属・鉱業 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 14.94 | 14.94 | 1,218 | 104,127 | | | ソフトウェア |
| FRANCO-NEVADA CORP NPR | 139.19 | 127.87 | 1,187 | 101,466 | | | 金属・鉱業 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 24.29 | - | - | - | | | 商業サービス・用品 |
| CI FINANCIAL CORP | 206.95 | 206.95 | 575 | 49,213 | | | 資本市場 |
| VERESEN INC | 249.82 | - | - | - | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TOURMALINE OIL CORP | 157.79 | 157.79 | 290 | 24,831 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KEYERA CORP | 137.28 | 137.28 | 448 | 38,325 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ALTAGAS LTD | 125.38 | 125.38 | 325 | 27,844 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 307.19 | 308.5 | 1,245 | 106,484 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DOLLARAMA INC | 92.86 | 75.04 | 1,149 | 98,275 | | | 複合小売り |
| CENOVUS ENERGY INC W/I | 591.24 | 805.45 | 795 | 68,023 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VERMILION ENERGY INC | 82.91 | 82.91 | 350 | 29,964 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ARC RESOURCES LTD | 229.97 | 229.97 | 284 | 24,356 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 144.93 | - | - | - | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | 306.31 | 306.31 | 152 | 13,013 | | | 各種金融サービス |
| INTER PIPELINE LTD | 240.83 | 240.83 | 549 | 46,936 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NUTRIEN LTD | - | 453.51 | 2,527 | 216,081 | | | 化学 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 149.61 | 149.61 | 435 | 37,189 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD | 172.31 | 172.31 | 274 | 23,492 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 173.9 | 153.53 | 1,108 | 94,766 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| SHOPIFY INC | - | 50.21 | 861 | 73,602 | | | インターネットソフトウェア・サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--------------------------------|------------------|-------------------|--------------|----------------------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| HYDRO ONE LTD | 166.12 | 133.54 | 270 | 23,115 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 28,933.66 86銘柄 | 119,748 - | 10,236,103 <3.6%> | |
| (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 | 738 | 62,502 | 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 | 2,216.6 | 2,038.83 | 5,635 | 477,030 | 銀行 |
| AMCOR LTD | 807.41 | 807.41 | 1,147 | 97,121 | 容器・包装 |
| WESTPAC BANKING CORPORATION | 2,482.37 | 2,399.94 | 7,240 | 612,918 | 銀行 |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 305.69 | 305.69 | 364 | 30,844 | 銀行 |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 1,141.25 | 1,141.25 | 582 | 49,269 | 金属・鉱業 |
| TELSTRA CORP LTD | 3,145.74 | 2,729.19 | 936 | 79,241 | 各種電気通信サービス |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 390.14 | 390.14 | 424 | 35,898 | 銀行 |
| AMP LTD | 2,004.98 | 2,004.98 | 1,044 | 88,424 | 各種金融サービス |
| ASX LTD | 163.54 | 102.9 | 556 | 47,123 | 資本市場 |
| BHP BILLITON LTD | 2,416.14 | 2,320.53 | 6,966 | 589,691 | 金属・鉱業 |
| CALTEX AUSTRALIA LTD | 209.46 | 209.46 | 702 | 59,433 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | - | 221.82 | 95 | 8,092 | 複合小売り |
| COMPUTERSHARE LT | 380.4 | 380.4 | 657 | 55,675 | 情報技術サービス |
| CSL LIMITED | 334.99 | 322.12 | 4,808 | 407,075 | バイオテクノロジー |
| REA GROUP LTD | 41.19 | 41.19 | 312 | 26,432 | インターネットソフトウェア・サービス |
| TRANSURBAN GROUP | 1,495.91 | 1,495.91 | 1,732 | 146,636 | 運送インフラ |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 486.01 | 486.01 | 400 | 33,941 | 飲料 |
| COCHLEAR LTD | 39.92 | 39.92 | 702 | 59,471 | ヘルスケア機器・用品 |
| ORIGIN ENERGY LTD | 1,433.3 | 1,217.21 | 1,011 | 85,623 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 1,275.79 | 1,212.08 | 8,966 | 759,053 | 銀行 |
| BORAL LIMITED | 601.88 | 861.01 | 634 | 53,715 | 建設資材 |
| RIO TINTO LIMITED | 318.97 | 268.22 | 2,115 | 179,118 | 金属・鉱業 |
| APA GROUP | 732.53 | 732.53 | 575 | 48,738 | ガス |
| ARISTOCRAT LEISU | 444.06 | 373.93 | 881 | 74,638 | ホテル・レストラン・レジャー |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 1,714.71 | 1,714.71 | 1,286 | 108,862 | 保険 |
| TPG TELECOM LTD | 287.19 | 287.19 | 171 | 14,537 | 各種電気通信サービス |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 47.06 | 32.75 | 162 | 13,742 | ホテル・レストラン・レジャー |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 357.9 | 284.89 | 649 | 55,008 | 建設資材 |
| ORICA LTD | 253.08 | 253.08 | 462 | 39,118 | 化学 |
| CIMIC GROUP LTD | 87.09 | 87.09 | 388 | 32,872 | 建設・土木 |
| BLUESCOPE STEEL LTD | - | 369.41 | 542 | 45,936 | 金属・鉱業 |
| SYDNEY AIRPORT | 851.3 | 851.3 | 546 | 46,264 | 運送インフラ |
| MACQUARIE GROUP LTD | 218.69 | 216.27 | 2,208 | 186,917 | 資本市場 |
| SUNCORP GROUP LTD | 931.81 | 931.81 | 1,241 | 105,065 | 保険 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 2,007.14 | 1,928.82 | 5,574 | 471,863 | 銀行 |
| NEWCREST MINING LTD | 611.1 | 515.33 | 1,149 | 97,278 | 金属・鉱業 |
| OIL SEARCH LTD | 937.15 | 937.15 | 689 | 58,386 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INCITEC PIVOT LTD | 1,364.26 | 1,364.26 | 495 | 41,920 | 化学 |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 953.9 | 953.9 | 992 | 83,977 | 保険 |
| CHALLENGER FINANCIAL SERVICES | 457.07 | 457.07 | 562 | 47,589 | 各種金融サービス |
| SANTOS LTD | 1,338.62 | 1,338.62 | 653 | 55,297 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SONIC HEALTHCARE | 261.92 | 261.92 | 634 | 53,677 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 707.76 | 1,263.48 | 563 | 47,701 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESFARMERS LTD | 863.31 | 810.21 | 3,284 | 278,040 | 食品・生活必需品小売り |
| ALUMINA LIMITED | 1,846.13 | 1,846.13 | 411 | 34,849 | 金属・鉱業 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 579.23 | 602.49 | 1,872 | 158,510 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 923.44 | 912.94 | 2,441 | 206,647 | 食品・生活必需品小売り |
| DUET GROUP | 2,077.76 | - | - | - | 総合公益事業 |
| SEEK LTD | 258.99 | 258.99 | 515 | 43,627 | 専門サービス |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD | 45.81 | 45.81 | 213 | 18,031 | ホテル・レストラン・レジャー |
| TATTS GROUP LTD | 1,099.37 | - | - | - | ホテル・レストラン・レジャー |
| AUSNET SERVICES | 1,650.66 | 1,650.66 | 259 | 22,007 | 電力 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|---------------------|---------------------|-------------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 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 | |
| AGL ENERGY LTD | 463.15 | 463.15 | 1,008 | 85,389 | 総合公益事業 |
| BRAMBLES LTD | 1,152.55 | 1,152.55 | 1,106 | 93,660 | 商業サービス・用品 |
| CROWN RESORTS LTD | 328.61 | 328.61 | 422 | 35,744 | ホテル・レストラン・レジャー |
| VOCUS GROUP LTD | 430.23 | - | - | - | 各種電気通信サービス |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 1,715.22 | 1,391.84 | 630 | 53,372 | 陸運・鉄道 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 639.22 | 507.89 | 863 | 73,087 | 飲料 |
| HEALTHSCOPE LTD | 1,490.47 | 1,490.47 | 278 | 23,593 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MEDIBANK PVT LTD | 2,348.49 | 1,771.76 | 533 | 45,143 | 保険 |
| SOUTH32 LTD(AUD) | 4,320.27 | 3,670.57 | 1,358 | 114,964 | 金属・鉱業 |
| 小 計 | 株 数 金 額 銘柄 数<比率> | 株 数 金 額 銘柄 数<比率> | 83,407 | 7,060,405 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| ASM PACIFIC TECH | 166 | 166 | 1,747 | 23,877 | 半導体・半導体製造装置 |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 1,640 | 1,640 | 3,040 | 41,534 | 不動産管理・開発 |
| BANK OF EAST ASIA | 762.6 | 762.6 | 2,467 | 33,699 | 銀行 |
| CLP HOLDINGS LTD | 1,305 | 1,195 | 9,141 | 124,876 | 電力 |
| PCCW LTD | 3,310 | 3,310 | 1,472 | 20,120 | 各種電気通信サービス |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 920 | - | - | - | 旅客航空輸送業 |
| LI & FUNG LTD | 5,324 | 5,324 | 2,102 | 28,726 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 490 | 490 | 3,204 | 43,774 | 電力 |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 895.4 | 790.4 | 21,562 | 294,538 | 資本市場 |
| MTR CORP | 1,185 | 1,185 | 4,811 | 65,719 | 陸運・鉄道 |
| HANG LUNG GROUP LTD | 630 | 630 | 1,694 | 23,149 | 不動産管理・開発 |
| HANG SENG BANK LTD | 560 | 560 | 10,724 | 146,489 | 銀行 |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 942.22 | 838.44 | 4,171 | 56,979 | 不動産管理・開発 |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 1,125 | 965 | 6,354 | 86,802 | 電力 |
| (THE) WHARF HOLDINGS LTD | 957.5 | 957.5 | 2,743 | 37,472 | 不動産管理・開発 |
| HONG KONG & CHINA GAS | 6,165.88 | 6,100.46 | 9,053 | 123,665 | ガス |
| HYSAN DEVELOPMENT CO | - | 500 | 2,180 | 29,778 | 不動産管理・開発 |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 1,890 | 1,640 | 10,766 | 147,071 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY PROPERTIES LTD | 430 | 330 | 1,146 | 15,664 | 不動産管理・開発 |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 2,870 | 2,620 | 10,218 | 139,577 | 銀行 |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS | 505 | 505 | 1,734 | 23,695 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 4,412.66 | 4,412.66 | 5,118 | 69,921 | 不動産管理・開発 |
| SINO LAND CO | 2,554 | 2,554 | 3,493 | 47,726 | 不動産管理・開発 |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 1,130 | 1,030 | 12,978 | 177,279 | 不動産管理・開発 |
| SWIRE PACIFIC LTD A | 425 | 300 | 2,227 | 30,427 | 不動産管理・開発 |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 1,135 | 1,135 | 5,436 | 74,264 | 家庭用耐久財 |
| WHELOCK & CO LTD | 560 | 560 | 3,166 | 43,258 | 不動産管理・開発 |
| KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD | - | 2,580 | 1,287 | 17,586 | 資本市場 |
| MINITH GROUP LTD | - | 440 | 1,894 | 25,874 | 自動車部品 |
| SJM HOLDINGS LTD | - | 1,560 | 1,148 | 15,683 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN MACAU LTD | 1,244 | 1,244 | 3,327 | 45,456 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | 648 | 648 | 1,415 | 19,340 | ホテル・レストラン・レジャー |
| AIA GROUP LTD | 8,926.27 | 8,496.27 | 53,016 | 724,208 | 保険 |
| HKT TRUST / HKT LTD | 2,140 | 2,820 | 2,741 | 37,442 | 各種電気通信サービス |
| SANDS CHINA LTD | 1,980 | 1,692 | 7,427 | 101,464 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 1,042 | 1,042 | 2,698 | 36,865 | 不動産管理・開発 |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD | - | 957.5 | 4,859 | 66,378 | 不動産管理・開発 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD | 2,300 | 2,300 | 1,665 | 22,746 | 電力 |
| WH GROUP LTD | 5,305 | 5,305 | 4,801 | 65,582 | 食品 |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 1,993.32 | 1,993.32 | 19,504 | 266,433 | コンプロマリット |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 1,988.32 | 1,843.32 | 12,488 | 170,592 | 不動産管理・開発 |
| 小 計 | 株 数 金 額 銘柄 数<比率> | 株 数 金 額 銘柄 数<比率> | 261,035 | 3,565,749 | |
| (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 | 408 | 33,219 | 航空宇宙・防衛 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|---|-------------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|------------------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 千円 | 千円 | | | |
| (シンガポール) | 百株 | 百株 | 千シンガポール・ドル | 千円 | | | |
| SEBACORP INDUSTRIES | 814 | 814 | 258 | 21,036 | | | コンプロマリット |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 1,237 | 1,237 | 326 | 26,540 | | | メディア |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 6,921.4 | 6,921.4 | 245 | 19,968 | | | 食品 |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 1,331 | 1,242 | 3,481 | 282,927 | | | 銀行 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 290 | 290 | 358 | 29,130 | | | 不動産管理・開発 |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 102.44 | 59.44 | 220 | 17,941 | | | 販売 |
| SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD | 423 | 423 | 219 | 17,876 | | | 運送インフラ |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 689 | 689 | 509 | 41,380 | | | 資本市場 |
| CAPITALAND LTD | 1,924.15 | 1,924.15 | 679 | 55,200 | | | 不動産管理・開発 |
| GENTING SINGAPORE PLC | 4,164 | 4,164 | 508 | 41,285 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| KEPPEL CORP LTD | 1,193 | 984 | 767 | 62,376 | | | コンプロマリット |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 1,779 | 1,779 | 359 | 29,205 | | | 陸運・鉄道 |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 2,490.53 | 2,254.53 | 2,764 | 224,634 | | | 銀行 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 5,919.22 | 5,919.22 | 1,982 | 161,153 | | | 各種電気通信サービス |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 475 | 475 | 529 | 43,042 | | | 旅客航空輸送業 |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 945 | 945 | 2,479 | 201,523 | | | 銀行 |
| UOL GROUP LIMITED | - | 405 | 332 | 27,022 | | | 不動産管理・開発 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 1,510 | 920 | 274 | 22,280 | | | 食品 |
| YANGZJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 1,457 | 1,888 | 252 | 20,560 | | | 機械 |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD | 1,721 | - | - | - | | | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | |
| | 36,635.74 20銘柄 | 34,583.74 20銘柄 | 16,959 - | 1,378,306 <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 | 979.92 | 613 | 48,326 | | | 運送インフラ |
| FISHER & PAYKEL | - | 372.49 | 476 | 37,561 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| FLETCHER BUILDING LTD | 752.81 | 752.81 | 530 | 41,810 | | | 建設資材 |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 2,101.61 | 1,596.23 | 541 | 42,629 | | | 各種電気通信サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | |
| | 3,834.34 3銘柄 | 3,701.45 4銘柄 | 2,162 - | 170,327 <0.1%> | | | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | | |
| ABERDEEN ASSET MGMT | 713.41 | - | - | - | | | 資本市場 |
| ANTOFAGASTA PLC | 259.05 | 259.05 | 237 | 35,517 | | | 金属・鉱業 |
| ASHTAD GROUP | 352.33 | 352.33 | 706 | 105,737 | | | 商社・流通業 |
| SEVERN TRENT PLC | 148.97 | 148.97 | 257 | 38,575 | | | 水道 |
| BHP BILLITON PLC | 1,533.23 | 1,533.23 | 2,414 | 361,361 | | | 金属・鉱業 |
| BARCLAYS PLC | 12,470.81 | 11,642.6 | 2,278 | 341,039 | | | 銀行 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 826.82 | 646.82 | 354 | 53,035 | | | 家庭用耐久財 |
| BT GROUP PLC | 6,212.2 | 5,766.86 | 1,300 | 194,647 | | | 各種電気通信サービス |
| SKY PLC | 722.1 | 722.1 | 781 | 116,946 | | | メディア |
| BUNZL PLC | 269.29 | 222.41 | 451 | 67,612 | | | 商社・流通業 |
| EASYJET PLC | 136.28 | 136.28 | 225 | 33,687 | | | 旅客航空輸送業 |
| CAPITA PLC | 548.94 | 548.94 | 104 | 15,570 | | | 専門サービス |
| AVIVA PLC | 3,068.04 | 2,778.61 | 1,365 | 204,374 | | | 保険 |
| CRODA INTERNATIONAL | 109.65 | 84.07 | 363 | 54,424 | | | 化学 |
| DIAGEO PLC | 1,864.18 | 1,797.03 | 4,444 | 665,320 | | | 飲料 |
| SCHRODERS PLC | 71.88 | 66.97 | 225 | 33,680 | | | 資本市場 |
| DCC PLC | 72.81 | 59.36 | 403 | 60,418 | | | コンプロマリット |
| NATIONAL GRID PLC | 2,802.03 | 2,298.84 | 1,710 | 256,072 | | | 総合公益事業 |
| GKN PLC | 1,341.8 | 1,341.8 | 551 | 82,605 | | | 自動車部品 |
| KINGFISHER PLC | 1,656.8 | 1,656.8 | 594 | 89,028 | | | 専門小売り |
| BAE SYSTEMS PLC | 2,419.05 | 2,251.76 | 1,288 | 192,923 | | | 航空宇宙・防衛 |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC | 119.87 | - | - | - | | | 消費者金融 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,385.48 | 1,629.3 | 7,234 | 1,082,798 | | | タバコ |
| COBHAM PLC | 1,427.39 | 1,427.39 | 170 | 25,445 | | | 航空宇宙・防衛 |
| NEXT PLC | 97.31 | 97.31 | 468 | 70,073 | | | 複合小売り |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 703.88 | 657.39 | 1,724 | 258,196 | | | タバコ |
| IMI PLC | 212.18 | 212.18 | 262 | 39,254 | | | 機械 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 125.27 | 125.27 | 388 | 58,201 | 化学 |
| ANGLO AMERICAN PLC | 1,050.1 | 935.73 | 1,584 | 237,177 | 金属・鉱業 |
| COMPASS GROUP PLC | 1,197.16 | 1,151.11 | 1,782 | 266,803 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HSBC HOLDINGS PLC | 14,863.52 | 14,150.41 | 10,614 | 1,588,736 | 銀行 |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 4,236.49 | 4,236.49 | 1,070 | 160,178 | 保険 |
| CENTRICA PLC | 3,927.66 | 3,927.66 | 500 | 74,897 | 総合公益事業 |
| UNILEVER PLC | 973.69 | 893.05 | 3,386 | 506,883 | パーソナル用品 |
| MEGGITT PLC | 621.81 | 621.81 | 289 | 43,399 | 航空宇宙・防衛 |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS | 1,556.82 | 1,556.82 | 337 | 50,566 | 食品・生活必需品小売り |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 555.99 | 347.14 | 232 | 34,771 | 水道 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC GRP | 808.64 | 808.64 | 487 | 73,009 | 保険 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 253.08 | 253.08 | 661 | 99,020 | 食品 |
| PEARSON PLC | 650.09 | 650.09 | 434 | 64,961 | メディア |
| PERSIMMON PLC | 231.5 | 231.5 | 557 | 83,508 | 家庭用耐久財 |
| PRUDENTIAL PLC | 1,942.75 | 1,829.73 | 3,317 | 496,533 | 保険 |
| RIO TINTO PLC | 902.16 | 859.76 | 3,461 | 518,101 | 金属・鉱業 |
| VODAFONE GROUP PLC | 19,744.79 | 19,065.94 | 3,807 | 569,901 | 無線通信サービス |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 469.78 | 472.31 | 2,986 | 447,006 | 家庭用品 |
| RELX PLC | 806.89 | 723.05 | 1,053 | 157,631 | 専門サービス |
| OLD MUTUAL PLC | 3,899.86 | 3,392.96 | 812 | 121,581 | 保険 |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC | 1,462.6 | 1,169.66 | 959 | 143,666 | 航空宇宙・防衛 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 2,794.42 | 2,461.07 | 676 | 101,265 | 銀行 |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 408.84 | 408.84 | 457 | 68,538 | 資本市場 |
| TRAVIS PERKINS PLC | 203.57 | 203.57 | 284 | 42,536 | 商社・流通業 |
| SSE PLC | 730.43 | 730.43 | 869 | 130,212 | 電力 |
| BP PLC | 13,979.56 | 13,848.28 | 6,576 | 984,377 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SHIRE PLC | 680.23 | 654.57 | 2,052 | 307,203 | バイオテクノロジー |
| SAGE GROUP PLC(THE) | 852.71 | 852.71 | 588 | 88,016 | ソフトウェア |
| SMITHS GROUP PLC | 317.2 | 317.2 | 489 | 73,330 | コングロメリット |
| STANDARD CHARTERED PLC | 2,514.34 | 2,375.33 | 1,921 | 287,631 | 銀行 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 48,855.54 | 50,551.36 | 3,366 | 503,930 | 銀行 |
| TATE & LYLE PLC | 399.15 | - | - | - | 食品 |
| TAYLOR WIMPLEY PLC | 2,530.22 | 2,530.22 | 469 | 70,328 | 家庭用耐久財 |
| TESCO PLC | 6,247.03 | 5,629.88 | 1,138 | 170,389 | 食品・生活必需品小売り |
| 3I GROUP PLC | 784.91 | 667.84 | 595 | 89,066 | 資本市場 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 661.55 | 661.55 | 832 | 124,617 | ヘルスケア機器・用品 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 3,636.78 | 3,455.37 | 4,460 | 667,601 | 医薬品 |
| WEIR GROUP | 183.36 | 183.36 | 370 | 55,521 | 機械 |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 249.07 | 218.88 | 869 | 130,130 | 資本市場 |
| BABCOCK INT'L GROUP | 213.02 | 213.02 | 135 | 20,355 | 商業サービス・用品 |
| WPP PLC | 975.55 | 906.28 | 1,254 | 187,742 | メディア |
| FERGUSON PLC | 182.38 | 182.38 | 937 | 140,315 | 商社・流通業 |
| ASTRAZENECA PLC | 941.92 | 887.62 | 4,287 | 641,708 | 医薬品 |
| WHITBREAD PLC | 121.59 | 121.59 | 463 | 69,431 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CARNIVAL PLC | 131.53 | 131.53 | 638 | 95,543 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 1,202.9 | 1,202.9 | 349 | 52,358 | 複合小売り |
| JOHN WOOD GROUP PLC | - | 489.88 | 293 | 43,995 | エネルギー設備・サービス |
| INTERTEK GROUP PLC | 105 | 112.73 | 546 | 81,852 | 専門サービス |
| WILLIAM HILL PLC | 724.74 | - | - | - | ホテル・レストラン・レジャー |
| BURBERRY GROUP PLC | 357.74 | 298.93 | 461 | 69,039 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| INVESTEC PLC | 506.55 | 506.55 | 305 | 45,704 | 資本市場 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 151.87 | 123.62 | 573 | 85,855 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ITV PLC | 2,472.1 | 2,472.1 | 408 | 61,201 | メディア |
| SAINSBURY (J) PLC | 1,094.1 | 1,094.1 | 267 | 40,089 | 食品・生活必需品小売り |
| RANDGOLD RESOURCES LTD NPR | 69.98 | 69.98 | 446 | 66,890 | 金属・鉱業 |
| G4S PLC | 1,222.5 | 1,222.5 | 308 | 46,111 | 商業サービス・用品 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 158.93 | 158.93 | 299 | 44,805 | 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 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 107.26 | 107.26 | 406 | 60,815 | 家庭用耐久財 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 3,241.39 | 3,194.45 | 7,288 | 1,090,888 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 2,778.39 | 2,619.72 | 6,076 | 909,521 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INMARSAT PLC | 341.27 | — | — | — | 各種電気通信サービス |
| PETROFAC LTD | 218.09 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 114.57 | — | — | — | 医薬品 |
| TUI AG-DI | 193.94 | 301.53 | 464 | 69,504 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 1,556.09 | 1,841.83 | 717 | 107,324 | 各種金融サービス |
| EXPERIAN PLC | 715.16 | 622.14 | 950 | 142,290 | 専門サービス |
| MONDI PLC | 302 | 240.61 | 431 | 64,519 | 紙製品・林産品 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 212.9 | 212.9 | 353 | 52,946 | 資本市場 |
| FRESNILLO PLC NPR | 156.39 | 156.39 | 207 | 31,121 | 金属・鉱業 |
| GLENCORE PLC | 8,990.43 | 8,654.23 | 3,309 | 495,347 | 金属・鉱業 |
| DIXONS CARPHONE PLC | 846.39 | — | — | — | 専門小売り |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | 1,126.94 | 1,126.94 | 434 | 65,060 | 保険 |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 306.16 | 306.16 | 175 | 26,212 | 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 | 134.06 | 314 | 47,034 | 飲料 |
| CONVATEC GROUP PLC | — | 1,184 | 233 | 35,018 | ヘルスケア機器・用品 |
| ROYAL MAIL PLC | 550.6 | 550.6 | 297 | 44,503 | 航空貨物・物流サービス |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC | 500.37 | 500.37 | 167 | 25,022 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WORLDPAY INC | — | 107.75 | 566 | 84,817 | 情報技術サービス |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC | — | 323.42 | 662 | 99,142 | ソフトウェア |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 763.48 | 763.48 | 277 | 41,482 | インターネットソフトウェア・サービス |
| WORLDPAY GROUP PLC | 1,122.02 | — | — | — | 情報技術サービス |
| 小計 | 株数 104銘柄 | 株数 99銘柄 | 129,978 | 19,455,168 | |
| | 金額比率 | 金額比率 | — | <6.8%> | |
| (イスラエル) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| BANK HAPOALIM BM | 784.28 | 784.28 | 1,937 | 58,758 | 銀行 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL BM | 1,242.7 | 1,030.61 | 2,172 | 65,870 | 銀行 |
| BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 1,882.3 | 1,882.3 | 986 | 29,905 | 各種電気通信サービス |
| ELBIT SYSTEMS LTD | 17.6 | 17.6 | 920 | 27,908 | 航空宇宙・防衛 |
| FRUTAROM INDUSTRIES LTD | 26 | 26 | 809 | 24,540 | 化学 |
| ISRAEL CHEMICALS LTD | 494.11 | 494.11 | 716 | 21,738 | 化学 |
| NICE LTD | 56.38 | 40.35 | 1,250 | 37,913 | ソフトウェア |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 104.44 | 104.44 | 655 | 19,867 | 銀行 |
| 小計 | 株数 8銘柄 | 株数 8銘柄 | 9,449 | 286,503 | |
| | 金額比率 | 金額比率 | — | <0.1%> | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG | 1,451.06 | 1,673.95 | 2,864 | 329,614 | 資本市場 |
| SYNGENTA AG | 68.72 | — | — | — | 化学 |
| NESTLE SA-REGISTERED | 2,323.79 | 2,197.06 | 16,987 | 1,954,431 | 食品 |
| CIE FINAN RICHEMONT | 396.74 | 374.38 | 3,144 | 361,808 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 524.76 | 496.63 | 11,054 | 1,271,875 | 医薬品 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 28.35 | 28.35 | 627 | 72,148 | 機械 |
| SIKA INHABER | 1.51 | 1.51 | 1,141 | 131,336 | 化学 |
| SGS SA-REG | 4.05 | 4.05 | 951 | 109,498 | 専門サービス |
| NOVARTIS AG-REG SHS | 1,667.25 | 1,575.58 | 12,500 | 1,438,199 | 医薬品 |
| BALOISE HOLDING AG -R | 41.27 | 41.27 | 602 | 69,274 | 保険 |
| BARRY CALLEBAUT AG | 1.44 | 1.44 | 266 | 30,649 | 食品 |
| CLARIANT AG-REG | — | 128.88 | 313 | 36,090 | 化学 |
| SWISSCOM AG-REG | 17.95 | 17.95 | 916 | 105,405 | 各種電気通信サービス |
| ABB LTD | 1,376.22 | 1,262.78 | 2,903 | 334,005 | 電気設備 |
| ADECCO GROUP AG-REG | 109.26 | 123.41 | 900 | 103,562 | 専門サービス |
| GEBERIT AG | 28.01 | 28.01 | 1,166 | 134,154 | 建設関連製品 |
| LONZA GROUP AG-REG | 43.73 | 53.89 | 1,279 | 147,251 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| LINDT & SPRUENGLI PART | 0.75 | 0.75 | 417 | 48,062 | 食品 |
| LINDT & SPRUENGLI NAMEN | 0.06 | 0.09 | 601 | 69,168 | 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 | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | |
| GIVAUDAN-REG | 6.92 | 6.92 | 1,481 | 170,454 | 化学 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 110.53 | 108.43 | 3,316 | 381,606 | 保険 |
| LAFARGEHOLCIM LTD | 209.41 | 326.76 | 1,757 | 202,179 | 建設資材 |
| ACTELION | 74.35 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| SONOVA HOLDING AG | 45.19 | 31.68 | 459 | 52,885 | ヘルスケア機器・用品 |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG | 44.53 | 36.87 | 594 | 68,442 | 海運業 |
| STRAUMANN HOLDING AG | — | 6 | 391 | 45,076 | ヘルスケア機器・用品 |
| THE SWATCH GROUP AG-B | 19.55 | 19.55 | 789 | 90,778 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | 45.92 | 45.92 | 348 | 40,151 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SCHINDLER NAMEN | 16.63 | 16.63 | 359 | 41,365 | 機械 |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 26.18 | 22.25 | 740 | 85,141 | 保険 |
| VIFOR PHARMA AG | 3.05 | 30.5 | 396 | 45,617 | 医薬品 |
| EMS-CHEMIE HOLDING | 5.53 | 5.53 | 347 | 39,986 | 化学 |
| SWISS PRIME SITE AG | 59.9 | 59.9 | 520 | 59,921 | 不動産管理・開発 |
| DUFREY GROUP | 35.66 | 23.9 | 326 | 37,574 | 専門小売り |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 14.74 | 12.72 | 865 | 99,586 | 資本市場 |
| ARYZTA AG | 71.91 | — | — | — | 食品 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 152.27 | 152.27 | 921 | 106,057 | 資本市場 |
| SWISS RE LTD | 238.38 | 206.38 | 1,958 | 225,283 | 保険 |
| UBS GROUP AG | 2,770.78 | 2,606.39 | 4,572 | 526,113 | 資本市場 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 12,036.35 37銘柄 | 11,728.58 36銘柄 | 78,789 — | 9,064,760 <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 | 86.01 | 73.3 | 5,216 | 93,158 | 飲料 |
| A P MOLLER A/S | 4.81 | 4.81 | 5,081 | 90,760 | 海運業 |
| AP MOLLER MAERSK A | 2.73 | 2.73 | 2,743 | 49,001 | 海運業 |
| DANSKE BANK A/S | 525.45 | 501.88 | 12,255 | 218,890 | 銀行 |
| GENMAB A/S | 46.33 | 38.99 | 4,189 | 74,824 | バイオテクノロジー |
| NOVOZYMES-B SHS | 159.04 | 159.04 | 4,860 | 86,804 | 化学 |
| NOVO NORDISK A/S-B | 1,421.39 | 1,317.28 | 39,959 | 713,680 | 医薬品 |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 158.08 | 158.08 | 6,797 | 121,402 | 電気設備 |
| TDC A/S | 689.39 | 689.39 | 3,395 | 60,639 | 各種電気通信サービス |
| COLOPLAST-B | 82.86 | 82.86 | 4,220 | 75,385 | ヘルスケア機器・用品 |
| DSV A/S | 156.01 | 130.4 | 6,170 | 110,205 | 陸運・鉄道 |
| WILLIAM DEMANT | 65.37 | 65.37 | 1,223 | 21,855 | ヘルスケア機器・用品 |
| H LUNDBECK A/S | — | 48.4 | 1,536 | 27,436 | 医薬品 |
| TRYG A/S | 111.07 | 111.07 | 1,583 | 28,287 | 保険 |
| PANDORA A/S | 82.51 | 82.51 | 4,972 | 88,800 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 77.08 | 77.08 | 3,915 | 69,933 | 化学 |
| ISS A/S | 111.25 | 111.25 | 2,512 | 44,864 | 商業サービス・用品 |
| ORSTED A/S | 65.75 | 116 | 4,222 | 75,412 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,845.13 17銘柄 | 3,770.44 18銘柄 | 114,856 — | 2,051,342 <0.7%> |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| MARINE HARVEST | 318.39 | 248.16 | 3,615 | 49,571 | 食品 |
| DNB ASA | 704.26 | 704.26 | 10,997 | 150,769 | 銀行 |
| NORSK HYDRO ASA | 918.79 | 918.79 | 5,176 | 70,969 | 金属・鉱業 |
| TELENOR ASA | 531.78 | 531.78 | 9,252 | 126,858 | 各種電気通信サービス |
| SCHIBSTED ASA | 91.31 | — | — | — | メディア |
| ORKLA ASA | 614.21 | 614.21 | 5,171 | 70,903 | 食品 |
| STATOIL ASA | 814.14 | 814.14 | 14,023 | 192,263 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 145.76 | 112.79 | 3,834 | 52,575 | 化学 |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 166.83 | 166.83 | 2,357 | 32,318 | 保険 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 4,305.47 9銘柄 | 4,110.96 8銘柄 | 54,429 — | 746,228 <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 | 483.77 | 16,511 | 221,743 | 機械 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------------|------------------|------------------|-----------|-------------|----------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 291.57 | 257.93 | 7,802 | 104,785 | 機械 |
| ERICSSON LM-B SHS | 2,217.48 | 2,217.48 | 11,765 | 158,016 | 通信機器 |
| GETINGE AB-B SHS | 131.53 | 131.53 | 1,327 | 17,823 | ヘルスケア機器・用品 |
| LUNDBERGS B | 26.06 | 36.91 | 2,247 | 30,188 | 各種金融サービス |
| SKF AB-B SHS | 323.06 | 248.66 | 4,214 | 56,604 | 機械 |
| SANDVIK AB | 751.99 | 767.81 | 11,171 | 150,035 | 機械 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 1,219.39 | 959.18 | 9,227 | 123,922 | 銀行 |
| SKANSKA AB-B SHS | 271.5 | 211.79 | 3,481 | 46,760 | 建設・土木 |
| SWEDBANK AB | 665.07 | 665.07 | 13,580 | 182,389 | 銀行 |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | 460.24 | - | - | - | 紙製品・林産品 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 1,189.09 | 1,083.88 | 12,388 | 166,380 | 銀行 |
| VOLVO AB-B SHS | 1,136.72 | 1,136.72 | 17,369 | 233,266 | 機械 |
| SWEDISH MATCH AB | 158.07 | 114.81 | 3,700 | 49,695 | タバコ |
| TELE2 AB-B SHS | 269.76 | 269.76 | 2,569 | 34,511 | 無線通信サービス |
| NORDEA AB | 2,294.57 | 2,186.2 | 20,497 | 275,285 | 銀行 |
| INDUSTRIVARDEN C | - | 114.03 | 2,229 | 29,939 | 各種金融サービス |
| ELECTROLUX AB-SER B | 191.91 | 191.91 | 5,064 | 68,016 | 家庭用耐久財 |
| SECURITAS AB-B SHS | 240.98 | 240.98 | 3,308 | 44,435 | 商業サービス・用品 |
| INVESTOR AB-B SHS | 334.12 | 334.12 | 12,115 | 162,707 | 各種金融サービス |
| HENNES&MAURITZ AB-B SHS | 726.17 | 664.48 | 8,970 | 120,473 | 専門小売り |
| ASSA ABLÖY AB-B | 756.7 | 686.13 | 11,804 | 158,539 | 建設関連製品 |
| TELIA CO AB | 1,849.27 | 1,849.27 | 6,871 | 92,289 | 各種電気通信サービス |
| LUNDIN PETROLEUM AB | 167.9 | 167.9 | 3,081 | 41,388 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BOLIDEN AB | 218.55 | 218.55 | 6,191 | 83,152 | 金属・鉱業 |
| ALFA LAVAL AB | 245.53 | 174.11 | 3,403 | 45,713 | 機械 |
| KINNEVIK AB-B | 183.1 | 183.1 | 5,229 | 70,229 | 各種金融サービス |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA | 53.32 | 53.32 | 2,975 | 39,957 | 無線通信サービス |
| ICA GRUPPEN AB | 59.2 | 59.2 | 1,733 | 23,287 | 食品・生活必需品小売り |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 336.92 | 336.92 | 2,881 | 38,696 | 家庭用耐久財 |
| HEXAGON AB | 167.02 | 183.6 | 8,992 | 120,772 | 電子装置・機器・部品 |
| ESSITY AB-B | - | 397.97 | 8,866 | 119,080 | 家庭用品 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 231,577 | 3,110,089 | |
| (ユーロ…イギリス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| TECHNIPFMC PLC | 177.4 | - | - | - | エネルギー設備・サービス |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | - | - | |
| (ユーロ…アイルランド) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| CRH PLC | 622.22 | 589.56 | 1,617 | 215,179 | 建設資材 |
| PADDY POWER BETFAIR PLC | 62.46 | 62.46 | 577 | 76,834 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY GROUP PLC-A | 115.76 | 115.76 | 981 | 130,617 | 食品 |
| BANK OF IRELAND | 21,986.37 | - | - | - | 銀行 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | - | 732.87 | 561 | 74,648 | 銀行 |
| AIB GROUP PLC | - | 523.22 | 285 | 37,942 | 銀行 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 4,022 | 535,222 | |
| (ユーロ…オランダ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| AIRBUS SE | 427.05 | 412.7 | 3,473 | 462,209 | 航空宇宙・防衛 |
| BOSKALIS WESTMINSTER CT | 75.63 | 75.63 | 226 | 30,079 | 建設・土木 |
| RELX NV | 708.26 | 708.26 | 1,161 | 154,555 | 専門サービス |
| KONINKLIJKE DSM NV | 122.85 | 132.16 | 1,073 | 142,862 | 化学 |
| ING GROEP NV-CVA | 2,865.93 | 2,728.8 | 4,002 | 532,513 | 銀行 |
| RANDSTAD HOLDINGS | 77.94 | 77.94 | 450 | 60,004 | 専門サービス |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 985.27 | 914.26 | 1,612 | 214,520 | 食品・生活必需品小売り |
| HEINEKEN NV | 173.73 | 173.73 | 1,460 | 194,363 | 飲料 |
| AKZO NOBEL | 182.09 | 182.09 | 1,404 | 186,853 | 化学 |
| ASML HOLDING NV | 275.66 | 274.21 | 4,187 | 557,147 | 半導体・半導体製造装置 |

| 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…オランダ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| AEGON NV | 1,443.21 | 1,204.04 | 652 | 86,769 | 保険 |
| UNILEVER NV-CVA | 1,211.12 | 1,155.3 | 5,053 | 672,466 | パーソナル用品 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 717.94 | 675.29 | 2,073 | 275,896 | ヘルスケア機器・用品 |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 205.58 | 205.58 | 814 | 108,351 | 専門サービス |
| STMICROELECTRONICS NV | 458.66 | 458.66 | 819 | 109,028 | 半導体・半導体製造装置 |
| QIAGEN N.V. | 136.42 | 136.42 | 359 | 47,776 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| VOPAK (KON.) | 53.64 | 53.64 | 183 | 24,438 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 2,765.63 | 2,289.67 | 592 | 78,816 | 各種電気通信サービス |
| HEINEKEN HOLDING NV-A | 80.14 | 80.14 | 640 | 85,200 | 飲料 |
| GEMALTO | 61.03 | - | - | - | ソフトウェア |
| FERRARI NV | 83.38 | 83.38 | 840 | 111,832 | 自動車 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 786.45 | 786.45 | 880 | 117,202 | 機械 |
| NN GROUP NV | 219.65 | 219.65 | 796 | 105,975 | 保険 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 701.1 | 767.19 | 1,357 | 180,685 | 自動車 |
| ABN AMRO GROUP NV | 193.63 | 291.29 | 715 | 95,230 | 銀行 |
| EXOR NV | 94.41 | 77.26 | 461 | 61,393 | 各種金融サービス |
| ALTICE NV-A | 385.25 | 434.03 | 342 | 45,531 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 15,491.65 27銘柄 | 14,597.77 26銘柄 | 35,635 - | 4,741,707 <1.7%> |
| (ユーロ…ベルギー) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| UMICORE | 76.6 | 153.2 | 703 | 93,668 | 化学 |
| KBC GROUPE | 183.78 | 183.78 | 1,320 | 175,675 | 銀行 |
| SOLVAY SA | 59.91 | 50.36 | 557 | 74,245 | 化学 |
| AGEAS | 129.93 | 129.93 | 529 | 70,467 | 保険 |
| UCB SA | 103.67 | 87.47 | 579 | 77,071 | 医薬品 |
| COLRUYT NV | 46.73 | 46.73 | 203 | 27,022 | 食品・生活必需品小売り |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 58.14 | 58.14 | 527 | 70,243 | 各種金融サービス |
| PROXIMUS | 134.98 | 89.22 | 227 | 30,320 | 各種電気通信サービス |
| TELENET GROUP HOLDING NV | - | 36.34 | 205 | 27,368 | メディア |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 566.44 | 536.8 | 4,487 | 597,055 | 飲料 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,360.18 9銘柄 | 1,371.97 10銘柄 | 9,342 - | 1,243,140 <0.4%> |
| (ユーロ…ルクセンブルグ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ARCELOR MITTAL (NL) | 1,307.47 | 472.45 | 1,316 | 175,139 | 金属・鉱業 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 7.94 | 7.94 | 381 | 50,754 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| TENARIS SA | 382.37 | 303.72 | 392 | 52,253 | エネルギー設備・サービス |
| SES FDR | 304.39 | 245.85 | 276 | 36,769 | メディア |
| RTL GROUP SA | 34.46 | 34.46 | 239 | 31,821 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,036.63 5銘柄 | 1,064.42 5銘柄 | 2,605 - | 346,738 <0.1%> |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| AIR LIQUIDE | 286.15 | 298.45 | 2,942 | 391,557 | 化学 |
| AXA | 1,460.95 | 1,395.5 | 3,467 | 461,427 | 保険 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 346.22 | 346.22 | 680 | 90,592 | 総合公益事業 |
| DASSAULT AVIATION SA | 1.57 | 1.57 | 205 | 27,324 | 航空宇宙・防衛 |
| DANONE | 432.2 | 436.86 | 2,807 | 373,534 | 食品 |
| SAFRAN SA | 237.31 | 220.5 | 1,902 | 253,201 | 航空宇宙・防衛 |
| ACCOR SA | 103.85 | 105.52 | 484 | 64,417 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BOUYGUES | 139.96 | 139.96 | 570 | 75,851 | 建設・土木 |
| BNP PARIBAS | 785.91 | 788.14 | 5,010 | 666,762 | 銀行 |
| THALES SA | 81.28 | 81.28 | 711 | 94,632 | 航空宇宙・防衛 |
| CAPGEMINI SA | 114.81 | 114.81 | 1,171 | 155,821 | 情報技術サービス |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 42.64 | 42.64 | 192 | 25,582 | 食品・生活必需品小売り |
| CHRISTIAN DIOR SE | 39.4 | - | - | - | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| INGENICO GROUP | 43.34 | 43.34 | 392 | 52,166 | 電子装置・機器・部品 |
| NATIXIS | 701.66 | 701.66 | 495 | 65,988 | 資本市場 |
| EIFFAGE | 47.77 | 47.77 | 430 | 57,333 | 建設・土木 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| PUBLICIS GROUPE | 150.68 | 150.68 | 939 | 124,988 | メディア |
| FAURECIA | - | 38.31 | 267 | 35,641 | 自動車部品 |
| IMERY SA | - | 22.56 | 178 | 23,714 | 建設資材 |
| L'OREAL | 188.15 | 180.67 | 3,167 | 421,420 | パーソナル用品 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 210.36 | 197.42 | 4,755 | 632,813 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| LAGARDERE S.C.A. | 96 | 96 | 232 | 30,976 | メディア |
| BOLLORE | 713.47 | 713.47 | 311 | 41,391 | 航空貨物・物流サービス |
| MICHELIN(CGDE)-B | 131.25 | 121.18 | 1,505 | 200,343 | 自動車部品 |
| PERNOD-RICARD | 161.1 | 154.01 | 2,024 | 269,374 | 飲料 |
| PEUGEOT SA | 329.06 | 422.32 | 752 | 100,109 | 自動車 |
| RENAULT SA | 143.6 | 124.42 | 1,071 | 142,541 | 自動車 |
| REMY COINTREAU | 18.6 | 18.6 | 196 | 26,110 | 飲料 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 357.06 | 357.06 | 1,543 | 205,434 | 建設関連製品 |
| SEB SA | 14.05 | 14.05 | 223 | 29,724 | 家庭用耐久財 |
| SOCIETE GENERALE-A | 562.43 | 542.09 | 2,471 | 328,915 | 銀行 |
| VINCI S.A. | 378.18 | 353.62 | 2,868 | 381,691 | 建設・土木 |
| SODEXO | 73.68 | 62.86 | 624 | 83,139 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 411.36 | 388.99 | 2,693 | 358,379 | 電気設備 |
| VIVENDI SA | 780.86 | 726.3 | 1,588 | 211,354 | メディア |
| TOTAL SA | 1,673.98 | 1,686.22 | 7,643 | 1,017,062 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VALEO | 177.31 | 177.31 | 1,055 | 140,471 | 自動車部品 |
| ZODIAC AEROSPACE | 152.82 | - | - | - | 航空宇宙・防衛 |
| ORANGE | 1,525.28 | 1,418.19 | 1,907 | 253,807 | 各種電気通信サービス |
| HERMES INTL | 18.75 | 22.85 | 993 | 132,167 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SOCIETE BIC SA | 24.78 | 24.78 | 209 | 27,927 | 商業サービス・用品 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 106.73 | 89.61 | 895 | 119,139 | ソフトウェア |
| KERING | 54.79 | 54.79 | 2,107 | 280,387 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CNP ASSURANCES | 139.87 | 139.87 | 274 | 36,477 | 保険 |
| CARREFOUR SA | 437.32 | 391.44 | 729 | 97,034 | 食品・生活必需品小売り |
| ATOS SE | 70.5 | 70.5 | 850 | 113,225 | 情報技術サービス |
| SANOFI | 864.52 | 798.78 | 5,103 | 679,059 | 医薬品 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | - | 39.3 | 264 | 35,224 | ソフトウェア |
| TELEPERFORMANCE | - | 36.07 | 414 | 55,145 | 専門サービス |
| EURAZEO | 40.63 | 24.27 | 192 | 25,608 | 各種金融サービス |
| JC DECAUX SA | 60.58 | 60.58 | 197 | 26,310 | メディア |
| ESSILOR INTL | 160.04 | 146.32 | 1,578 | 209,976 | ヘルスケア機器・用品 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 855.85 | 855.85 | 1,161 | 154,534 | 銀行 |
| WENDEL | 22.2 | 22.2 | 309 | 41,207 | 各種金融サービス |
| ILIAD SA | 21.02 | 21.02 | 412 | 54,847 | 各種電気通信サービス |
| ENGIE | 1,109.24 | 1,295.39 | 1,634 | 217,437 | 総合公益事業 |
| ALSTOM | 120.46 | 120.46 | 399 | 53,182 | 機械 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 125.42 | 125.42 | 209 | 27,869 | メディア |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 207.51 | 347.56 | 362 | 48,258 | 電力 |
| IPSEN SA | - | 24.87 | 271 | 36,136 | 医薬品 |
| ARKEMA SA | 42.41 | 37.96 | 374 | 49,893 | 化学 |
| LEGRAND SA | 199.2 | 199.2 | 1,227 | 163,274 | 電気設備 |
| ADP | 23.13 | 23.13 | 379 | 50,535 | 運送インフラ |
| SCOR SE | 138.75 | 138.75 | 489 | 65,171 | 保険 |
| REXEL SA | 232.45 | 232.45 | 335 | 44,662 | 商社・流通業 |
| BUREAU VERITAS SA | 214.8 | 214.8 | 464 | 61,764 | 専門サービス |
| GETLINK | 376.46 | 376.46 | 399 | 53,222 | 運送インフラ |
| SUEZ SA | 254.06 | 254.06 | 281 | 37,506 | 総合公益事業 |
| ENGIE | 33.18 | - | - | - | 総合公益事業 |
| EDENRED | 186.82 | 131.95 | 336 | 44,771 | 商業サービス・用品 |
| SFR GROUP SA | 87.74 | - | - | - | 各種電気通信サービス |
| AMUNDI SA | - | 38.94 | 263 | 35,088 | 資本市場 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 19,343.51 66銘柄 | 19,090.18 68銘柄 | 82,614 - | 10,992,651 <3.9%> |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-----------------------------------|----------|----------|-------|---------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ADIDAS AG | 143.02 | 135.03 | 2,390 | 318,017 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 240.55 | 227.05 | 1,998 | 265,859 | 自動車 |
| COMMERZBANK AG | 725.73 | 725.73 | 919 | 122,367 | 銀行 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 301.56 | 285.3 | 1,804 | 240,071 | 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 | 545 | 72,556 | インターネットソフトウェア・サービス |
| FUCHS PETROLUB SE PREF | 55.46 | 55.46 | 246 | 32,853 | 化学 |
| MAN SE | 33.96 | 33.96 | 319 | 42,498 | 機械 |
| HANNOVER RUECK SE | 50.5 | 36.42 | 400 | 53,354 | 保険 |
| GEA GROUP AG | 146.35 | 118.38 | 446 | 59,367 | 機械 |
| CONTINENTAL AG | 83.1 | 77.76 | 1,774 | 236,112 | 自動車部品 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 742.74 | 699.44 | 2,579 | 343,232 | 航空貨物・物流サービス |
| AXEL SPRINGER SE | 30.67 | 30.67 | 216 | 28,811 | メディア |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD | 120.66 | 105.91 | 742 | 98,759 | 自動車 |
| MERCK KGAA | 87.52 | 95.51 | 794 | 105,684 | 医薬品 |
| RWE AG | 391.83 | 391.83 | 634 | 84,383 | 総合公益事業 |
| SAP SE | 732.92 | 690.54 | 5,779 | 769,062 | ソフトウェア |
| E.ON SE | 1,426.88 | 1,640.12 | 1,328 | 176,769 | 総合公益事業 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 86.14 | 75.25 | 726 | 96,723 | 家庭用品 |
| METRO AG | 107.74 | - | - | - | 専門小売り |
| SIEMENS AG-REG | 568 | 537.06 | 5,868 | 780,928 | コングロマリット |
| BAYER AG | 614.71 | 584.37 | 5,715 | 760,534 | 医薬品 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 132.53 | 121.78 | 1,278 | 170,061 | 家庭用品 |
| DAIMLER AG | 711.39 | 680.86 | 4,875 | 648,752 | 自動車 |
| BASF SE | 679.7 | 651.28 | 5,620 | 747,869 | 化学 |
| BEIERSDORF AG | 67.8 | 67.8 | 620 | 82,618 | パーソナル用品 |
| HOCHTIEF AG | 17.07 | 17.07 | 225 | 30,049 | 建設・土木 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 110.09 | 110.09 | 912 | 121,407 | 建設資材 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 164.52 | 150.48 | 1,296 | 172,476 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE | 338 | 319.55 | 6,004 | 799,023 | 保険 |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | 176.02 | 176.02 | 534 | 71,153 | メディア |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 197.48 | 159.63 | 432 | 57,518 | 旅客航空輸送業 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 123.54 | 107.6 | 1,954 | 260,001 | 保険 |
| VOLKSWAGEN AG | 27.94 | 21.83 | 370 | 49,321 | 自動車 |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 141.31 | 131.34 | 2,181 | 290,243 | 自動車 |
| THYSSENKRUPP AG | 292.15 | 299.03 | 685 | 91,275 | 金属・鉱業 |
| TUI AG | 191.96 | - | - | - | ホテル・レストラン・レジャー |
| 1&1 DRILLISCH AG | - | 31.49 | 201 | 26,837 | 無線通信サービス |
| LINDE AG | 141.83 | - | - | - | 化学 |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 1,048.36 | 1,492.44 | 1,930 | 256,808 | 資本市場 |
| BMW VORZUG | 41.16 | 41.16 | 314 | 41,814 | 自動車 |
| K & S | 149.82 | 149.82 | 317 | 42,282 | 化学 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 2,420.88 | 2,328.97 | 3,043 | 405,029 | 各種電気通信サービス |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 817.74 | 817.74 | 1,789 | 238,072 | 半導体・半導体製造装置 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | - | 138.44 | 1,448 | 192,681 | 資本市場 |
| FRAPORT AG | 31.49 | 31.49 | 273 | 36,378 | 運送インフラ |
| WIRECARD AG | - | 79.9 | 753 | 100,254 | 情報技術サービス |
| LANXESS AG | 68.56 | 68.56 | 458 | 60,975 | 化学 |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG | - | 31.34 | 418 | 55,712 | 航空宇宙・防衛 |
| DEUTSCHE WOHNEN | 267.14 | 267.14 | 894 | 119,077 | 不動産管理・開発 |
| SYMRISE AG | 79.26 | 79.26 | 518 | 69,036 | 化学 |
| BRENNTAG AG | 123.31 | 96 | 487 | 64,839 | 商社・流通業 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 115.75 | 115.75 | 345 | 45,989 | 化学 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 615.41 | 615.41 | 241 | 32,197 | 各種電気通信サービス |
| HUGO BOSS AG -ORD | 52.18 | 52.18 | 379 | 50,545 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OSRAM LICHT AG | 70.17 | 70.17 | 471 | 62,762 | 電気設備 |
| KION GROUP AG | - | 46.86 | 320 | 42,586 | 機械 |
| VONOVIA SE | 352.71 | 353.08 | 1,297 | 172,607 | 不動産管理・開発 |

| 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…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| METRO AG | — | 107.74 | 193 | 25,804 | 食品・生活必需品小売り |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 138.44 | — | — | — | 資本市場 |
| INNOGY SE | 97.69 | 97.69 | 306 | 40,841 | 総合公益事業 |
| LINDE AG-TENDER | — | 133.75 | 2,523 | 335,825 | 化学 |
| ZALANDO SE | 66.74 | 66.74 | 310 | 41,276 | インターネット販売・通信販売 |
| COVESTRO AG | 59.66 | 105 | 914 | 121,745 | 化学 |
| SCHAEFFLER AG | 126.44 | 126.44 | 165 | 22,056 | 自動車部品 |
| UNIPER SE | 160.58 | 138.97 | 335 | 44,582 | 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> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 82,882 | 11,028,348 | |
| (ユーロ…スイス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| LAFARGEHOLCIM LTD | 141.05 | — | — | — | 建設資材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | — | — | <-%> |
| (ユーロ…ポルトガル) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| JERONIMO MARTINS | 195.17 | 195.17 | 337 | 44,900 | 食品・生活必需品小売り |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 1,910.94 | 1,523.74 | 418 | 55,735 | 電力 |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 379.21 | 379.21 | 550 | 73,315 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,307 | 173,951 | <0.1%> |
| (ユーロ…スペイン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA | 418.29 | 385.21 | 747 | 99,487 | 運送インフラ |
| IBERDROLA SA | 4,242.73 | 4,168.18 | 2,516 | 334,878 | 電力 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | — | 144.26 | 179 | 23,917 | 電気設備 |
| REPSOL SA | 801.53 | 826.64 | 1,142 | 152,064 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TELEFONICA S.A | 3,478.56 | 3,227.15 | 2,411 | 320,936 | 各種電気通信サービス |
| ENDESA S.A. | 210.37 | 210.37 | 356 | 47,390 | 電力 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 115.55 | 150.49 | 426 | 56,808 | 建設・土木 |
| BANKINTER S.A. | 579.6 | 579.6 | 510 | 67,944 | 銀行 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 4,815.07 | 4,643.5 | 3,235 | 430,527 | 銀行 |
| GAS NATURAL SDG SA | 290.1 | 290.1 | 536 | 71,353 | ガス |
| BANCO SANTANDER SA | 10,780.26 | 11,456.9 | 6,294 | 837,535 | 銀行 |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 345.96 | 345.96 | 558 | 74,320 | 電力 |
| BANCO POPULAR ESPANOL | 2,777.68 | — | — | — | 銀行 |
| BANCO SABADELL | 4,280.14 | 3,677.53 | 662 | 88,177 | 銀行 |
| INDITEX | 837.55 | 756.58 | 1,987 | 264,461 | 専門小売り |
| MAPFRE SA | 844.74 | 844.74 | 228 | 30,460 | 保険 |
| ENAGAS | 180.95 | 180.95 | 373 | 49,743 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GRIFOLS SA | 253.09 | 188 | 438 | 58,385 | バイオテクノロジー |
| FERROVIAL SA | 356.1 | 369.97 | 629 | 83,712 | 建設・土木 |
| CAIXABANK | 2,292.31 | 2,623.72 | 1,047 | 139,330 | 銀行 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 330.99 | 301.69 | 1,766 | 235,076 | 情報技術サービス |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA | 684.48 | 447.47 | 303 | 40,332 | 旅客航空輸送業 |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA | 483.05 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| BANKIA SA | 3,706.38 | 631.97 | 242 | 32,240 | 銀行 |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERV-RTS | — | 150 | 6 | 818 | 建設・土木 |
| AENA SME SA | 52.56 | 52.56 | 870 | 115,849 | 運送インフラ |
| ACS ACTIVIDADES DE CONS Y SERVICIOS-RTS | 114.92 | — | — | — | 建設・土木 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 27,474 | 3,655,755 | <1.3%> |
| (ユーロ…イタリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 859.95 | 859.95 | 1,320 | 175,756 | 保険 |
| INTESA SANPAOLO | 9,349.15 | 9,349.15 | 2,899 | 385,763 | 銀行 |
| INTESA SANPAOLO-RNC | 1,124.65 | 511.78 | 165 | 22,009 | 銀行 |
| UNICREDIT SPA | 378.24 | 1,426.64 | 2,527 | 336,338 | 銀行 |
| ENI SPA | 1,889.83 | 1,772.97 | 2,382 | 317,017 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MEDIOBANCA SPA | 424.04 | 424.04 | 412 | 54,831 | 銀行 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-------------------------------|------------------|-----------------------|-----------------------|-------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 期末 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…イタリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| SAIPEM | 4,657.51 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 116.02 | 116.02 | 573 | 76,339 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ENEL SPA | 5,817.47 | 5,792.18 | 2,768 | 368,398 | 電力 |
| LEONARDO SPA | 344.31 | 262.69 | 231 | 30,766 | 航空宇宙・防衛 |
| UNIPOLSAI SPA | 919.92 | 919.92 | 181 | 24,150 | 保険 |
| SNAM SPA | 1,861.29 | 1,584.19 | 583 | 77,698 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TELECOM ITALIA SPA | 6,728.96 | 7,921.63 | 545 | 72,518 | 各種電気通信サービス |
| TELECOM ITALIA-RNC | 4,975.96 | 4,975.96 | 295 | 39,328 | 各種電気通信サービス |
| ATLANTIA SPA | 279.2 | 349.69 | 881 | 117,254 | 運送インフラ |
| TERNA SPA | 1,171.08 | 819.15 | 375 | 49,898 | 電力 |
| RECORDATI SPA | — | 68.59 | 213 | 28,356 | 医薬品 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | — | 355.83 | 219 | 29,236 | 飲料 |
| PRYSMIAN SPA | 149.25 | 149.25 | 389 | 51,772 | 電気設備 |
| UNICREDIT SPA-RTS | 378.24 | — | — | — | 銀行 |
| POSTE ITALIANE SPA | 400.15 | 400.15 | 261 | 34,757 | 保険 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 41,825.22 19銘柄 | 38,059.78 19銘柄 | 17,226 — | 2,292,193 <0.8%> |
| (ユーロ…フィンランド) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| WARTSILA OYJ | 116.45 | 116.45 | 666 | 88,630 | 機械 |
| NOKIA RENKAAT OYJ | 93.99 | 93.99 | 344 | 45,773 | 自動車部品 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 418.26 | 369.17 | 996 | 132,530 | 紙製品・林産品 |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 423.03 | 423.03 | 581 | 77,312 | 紙製品・林産品 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 330.59 | 288.97 | 1,344 | 178,909 | 保険 |
| FORTUM OYJ | 371.32 | 297.39 | 520 | 69,248 | 電力 |
| NOKIA OYJ | 4,427.2 | 4,172.48 | 1,887 | 251,112 | 通信機器 |
| ELISA OYJ | 95.17 | 95.17 | 329 | 43,789 | 各種電気通信サービス |
| METSO OYJ | 85.85 | 85.85 | 219 | 29,197 | 機械 |
| NESTE OYJ | 106.92 | 88.39 | 504 | 67,156 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KONE OYJ | 237.17 | 237.17 | 1,035 | 137,781 | 機械 |
| ORION OYJ | 80.51 | 80.51 | 209 | 27,852 | 医薬品 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 6,786.46 12銘柄 | 6,348.57 12銘柄 | 8,637 — | 1,149,295 <0.4%> |
| (ユーロ…オーストリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| OMV AG | 97.66 | 97.66 | 453 | 60,373 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VOEST-ALPINE AG | 98.75 | 98.75 | 468 | 62,282 | 金属・鉱業 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 233.24 | 207.54 | 821 | 109,356 | 銀行 |
| ANDRITZ AG | 62.65 | 62.65 | 294 | 39,130 | 機械 |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL | 96.41 | 96.41 | 306 | 40,819 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 588.71 5銘柄 | 563.01 5銘柄 | 2,344 — | 311,961 <0.1%> |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 870,827.48 1,249銘柄 | 808,041.16 1,249銘柄 | — — | 272,128,639 <95.7%> |

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

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

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘 | 柄 | 期 | | | | |
|---------------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|-------------|----------------|----------|
| | | 首(前期末) | 当 | 末 | | |
| | | □ 数 | □ 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| 不動産ファンド (アメリカ) | | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 5.587 | 7.304 | 876 | 93,707 | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 11.168 | 11.168 | 1,289 | 137,791 | 0.0 |
| SL GREEN | | 7.722 | 5.382 | 504 | 53,940 | 0.0 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | | 77.528 | 77.528 | 804 | 85,994 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | | 38.966 | 38.966 | 2,359 | 252,082 | 0.1 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 10.191 | 9.642 | 1,532 | 163,742 | 0.1 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 6.285 | 6.285 | 508 | 54,326 | 0.0 |
| EQUINIX INC | | 5.241 | 5.448 | 2,374 | 253,728 | 0.1 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | | 10.544 | 10.544 | 390 | 41,756 | 0.0 |
| DUKE REALTY TRUST | | 24.47 | 24.47 | 624 | 66,757 | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | | 25.117 | 28.166 | 2,967 | 317,114 | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 5.283 | 4.524 | 1,016 | 108,656 | 0.0 |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 27.07 | 27.07 | 1,534 | 163,929 | 0.1 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | | 5.741 | 4.144 | 459 | 49,074 | 0.0 |
| GGP INC | | 43.463 | 43.463 | 945 | 101,063 | 0.0 |
| HCP INC | | 34.13 | 34.13 | 743 | 79,398 | 0.0 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | | 9.156 | 8.169 | 1,327 | 141,905 | 0.0 |
| WELLTOWER INC | | 26.516 | 26.516 | 1,435 | 153,434 | 0.1 |
| KIMCO REALTY | | 32.98 | 32.98 | 470 | 50,255 | 0.0 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | | 11.649 | 11.649 | 458 | 48,983 | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC | | 19.265 | 19.265 | 639 | 68,326 | 0.0 |
| THE MACERICH COMPANY | | 9.014 | 9.014 | 554 | 59,296 | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | | 58.146 | 51.147 | 1,004 | 107,343 | 0.0 |
| MID AMERICA | | 8.123 | 8.123 | 713 | 76,255 | 0.0 |
| REALTY INCOME CORP | | 20.047 | 18.985 | 913 | 97,582 | 0.0 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 7.365 | 11.294 | 651 | 69,588 | 0.0 |
| UDR INC | | 21.797 | 17.458 | 589 | 63,037 | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 23.516 | 21.825 | 3,363 | 359,371 | 0.1 |
| PUBLIC STORAGE | | 11.151 | 11.151 | 2,082 | 222,566 | 0.1 |
| VENTAS INC | | 27.031 | 25.041 | 1,242 | 132,777 | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 12.211 | 12.211 | 806 | 86,225 | 0.0 |
| WEYERHAEUSER CO | | 57.008 | 51.939 | 1,815 | 194,035 | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | | 9.98 | 8.141 | 660 | 70,587 | 0.0 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 11.787 | 15.118 | 1,591 | 170,064 | 0.1 |
| AGNC INVESTMENT CORP | | 25.741 | 25.741 | 485 | 51,905 | 0.0 |
| VEREIT INC | | 59.654 | 72.429 | 501 | 53,636 | 0.0 |
| AMERICAN TOWER CORP | | 31.665 | 30.693 | 4,158 | 444,354 | 0.2 |
| INVITATION HOMES INC | | - | 22.567 | 481 | 51,413 | 0.0 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | | 21.975 | 21.975 | 329 | 35,247 | 0.0 |
| COLONY NORTHSTAR INC | | 39.311 | 39.311 | 326 | 34,866 | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘 柄 | 893.594 39銘柄<2.0%> | 910.976 40銘柄<1.7%> | 45,537 - | 4,866,126 - | - 1.7 |
| (カナダ) | | 千□ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千円 | % |
| SMARTCENTRES REIT | | 2.582 | 2.582 | 75 | 6,433 | 0.0 |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | | 10.748 | 10.748 | 216 | 18,475 | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | | 9.675 | 9.675 | 228 | 19,567 | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘 柄 | 23.005 3銘柄<0.0%> | 23.005 3銘柄<0.0%> | 520 - | 44,476 - | - 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | |
|------------------------------|------------|------------|-------------|-------------|-------------|-----|
| | □ 数 | □ 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| (オーストラリア) | 千□ | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | % |
| MIRVAC GROUP | 295.783 | 295.783 | 621 | 52,579 | | 0.0 |
| GPT GROUP | 144.955 | 144.955 | 687 | 58,161 | | 0.0 |
| LENLEASE GROUP | 37.363 | 37.363 | 592 | 50,193 | | 0.0 |
| STOCKLAND | 193.279 | 126.459 | 503 | 42,604 | | 0.0 |
| WESTFIELD CORP | 140.035 | 140.035 | 1,191 | 100,877 | | 0.0 |
| DEXUS | 63.819 | 63.819 | 589 | 49,863 | | 0.0 |
| GOODMAN GROUP | 143.627 | 121.619 | 976 | 82,669 | | 0.0 |
| VICINITY CENTRES | 270.443 | 270.443 | 692 | 58,606 | | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | 383.688 | 383.688 | 1,442 | 122,121 | | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘柄 | □ 数 銘柄 | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 比率 |
| | 1,672.992 | 1,584.164 | 7,296 | 617,677 | - | - |
| | 9銘柄<0.3%> | 9銘柄<0.2%> | - | - | - | 0.2 |
| (香港) | 千□ | 千□ | 千香港・ドル | 千円 | | % |
| LINK REIT | 163.5 | 163.5 | 10,701 | 146,176 | | 0.1 |
| 小計 | □ 数 銘柄 | □ 数 銘柄 | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 比率 |
| | 163.5 | 163.5 | 10,701 | 146,176 | - | - |
| | 1銘柄<0.0%> | 1銘柄<0.1%> | - | - | - | 0.1 |
| (シンガポール) | 千□ | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千円 | | % |
| CAPITALAND MALL TRUST | 199 | 199 | 390 | 31,698 | | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV | 200.806 | 200.806 | 516 | 41,941 | | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 211 | - | - | - | | - |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 192.1 | 192.1 | 366 | 29,818 | | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘柄 | □ 数 銘柄 | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 比率 |
| | 802.906 | 591.906 | 1,273 | 103,458 | - | - |
| | 4銘柄<0.0%> | 3銘柄<0.0%> | - | - | - | 0.0 |
| (イギリス) | 千□ | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千円 | | % |
| BRITISH LAND CO PLC | 71.871 | 71.871 | 456 | 68,354 | | 0.0 |
| HAMMERSON PLC | 58.616 | 58.616 | 269 | 40,341 | | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 63.231 | 37.974 | 353 | 52,900 | | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC | 74.712 | - | - | - | | - |
| SEGRO PLC | 50.928 | 61.113 | 338 | 50,639 | | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘柄 | □ 数 銘柄 | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 比率 |
| | 319.358 | 229.574 | 1,417 | 212,235 | - | - |
| | 5銘柄<0.1%> | 4銘柄<0.1%> | - | - | - | 0.1 |
| (フランス) | 千□ | 千□ | 千ユーロ | 千円 | | % |
| GECINA SA | 3.212 | 3.67 | 545 | 72,565 | | 0.0 |
| ICADE | 2.234 | 2.234 | 182 | 24,315 | | 0.0 |
| KLEPIERRE | 17.042 | 17.042 | 569 | 75,715 | | 0.0 |
| FONCIERE DES REGIONS | 2.343 | 2.343 | 202 | 26,904 | | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 7.221 | 7.221 | 1,352 | 179,962 | | 0.1 |
| 小計 | □ 数 銘柄 | □ 数 銘柄 | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 比率 |
| | 32.052 | 32.51 | 2,851 | 379,464 | - | - |
| | 5銘柄<0.1%> | 5銘柄<0.1%> | - | - | - | 0.1 |
| 合計 | □ 数 銘柄 | □ 数 銘柄 | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 金額 数<比率> | 比率 |
| | 3,907.407 | 3,535.635 | - | 6,369.615 | - | - |
| | 66銘柄<2.6%> | 65銘柄<2.2%> | - | - | - | 2.2 |

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

(注2) 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 | | 末 |
|--------|--------------------------|---|--------------|-------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 外 国 | S & P 500 EMINI FUT | | 百万円 4,164 | | 百万円 - |
| | S & P / TSE 60 IX FUT | | 231 | | - |
| | S P I 200 FUTURES | | 159 | | - |
| | FTSE 100 INDEX FUTURE | | 439 | | - |
| | D J E U R O S T O X X 50 | | 1,145 | | - |

(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2月15日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|---------------|-------------------|-----|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 | 率 |
| 株 式 | 千円 272,128,639 | | % 95.3 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 6,369,615 | | 2.2 |
| コール・ローン等、その他 | 7,097,867 | | 2.5 |
| 投資信託財産総額 | 285,596,122 | | 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、284,523,453千円、99.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.86円、1カナダ・ドル=85.48円、1オーストラリア・ドル=84.65円、1香港・ドル=13.66円、1シンガポール・ドル=81.27円、1ニュージーランド・ドル=78.78円、1イギリス・ポンド=149.68円、1イスラエル・シェケル=30.32円、1スイス・フラン=115.05円、1デンマーク・クローネ=17.86円、1ノルウェー・クローネ=13.71円、1スウェーデン・クローナ=13.43円、1ユーロ=133.06円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年2月15日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 286,028,819,817円 |
| コ ー ル ・ コ ー ス 等 | 4,727,724,506 |
| 株 式(評価額) | 272,128,639,179 |
| 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 721,135,816 |
| 投 資 資 産 証 券(評価額) | 5,648,480,066 |
| 未 収 入 金 | 489,540,222 |
| 差 入 取 委 配 託 当 金 | 325,468,315 |
| (B) 負 債 | 1,580,686,821 |
| 未 払 金 | 602,788,821 |
| 未 払 金 | 977,898,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 284,448,132,996 |
| 元 本 | 85,414,197,806 |
| 次 期 繰 越 損 益 | 199,033,935,190 |
| (D) 受 取 益 権 総 額 | 85,414,197,806円 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 33,302円 |

(注1) 期首元本額 92,157,246,137円
 追加設定元本額 19,792,184,569円
 一部解約元本額 26,535,232,900円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| D I A M 外国株式パッシブ・ファンド | 1,840,400,842円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 3,104,022円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 7,276,226円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 19,381,505円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 15,460,782円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立的) | 11,993,292円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 13,629,779円 |
| たわらノーロード 先進国株式 | 5,750,450,189円 |
| たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け> | 424,744円 |
| たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり> | 521,036,149円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 10,313,910円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 304,310円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 3,836,957円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 10,061,976円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) | 14,227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) | 473,016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) | 1,050,304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) | 1,017,242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) | 2,185,065円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 6,182円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 33,486円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 312,197円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 316,613円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 1,046,842円 |
| D I A M 外国株式インデックスファンド<DC年金> | 37,141,820,020円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1安定型 | 155,272,827円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型 | 854,160,900円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3成長型 | 1,042,632,432円 |
| D I A M DC バランス30インデックスファンド | 128,651,065円 |
| D I A M DC バランス50インデックスファンド | 385,326,790円 |
| D I A M DC バランス70インデックスファンド | 330,441,705円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 32,623,606円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 811,105,505円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリユーション | 186,981,108円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 30,483,954円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 76,050,865円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 149,320,860円 |
| 投資のソムリエ | 525,467,955円 |
| クルーズコントロール | 81,781,664円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 36,100,432円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> | 115,601,513円 |
| D I A M DC バランス・F (成長型) | 76,218,862円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 30,467円 |

| | |
|---|-----------------|
| D I A M コア資産設計ファンド (堅実型) | 402,135円 |
| D I A M コア資産設計ファンド (積極型) | 1,245,127円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 17,872,394円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 624,194円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 271,612,111円 |
| ワールドアセットバランス (基本コース) | 621,453,988円 |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 2,129,164,124円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) | 646,857円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) | 539,416円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 83,122円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) | 1,105,218円 |
| D I A M 外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用) | 94,680,639円 |
| D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 2,951,910,645円 |
| D I A M 先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定) | 161,173,877円 |
| 外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定) | 208,770,312円 |
| D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 23,652,082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) | 104,000,380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) | 229,337,941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) | 12,671,338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) | 82,511,736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) | 7,737,512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) | 12,881,312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) | 24,714,283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) | 67,799,257円 |
| D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 559,209,316円 |
| D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 694,323,847円 |
| D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 2,176,759,188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) | 788,664,451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) | 228,926,627円 |
| D I A M アガ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 931,210,759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) | 438,615,672円 |
| D I A M グローバルβ私募ファンド (適格機関投資家限定) | 2,754,975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) | 135,785,141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) | 366,032,274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) | 7,841,422,538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) | 423,028,871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) | 1,347,116,256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) | 5,122,879,137円 |
| D I A M バランス30VA (適格機関投資家限定) | 2,032,372円 |
| D I A M バランス50VA (適格機関投資家限定) | 28,378,177円 |
| D I A M バランス70VA (適格機関投資家限定) | 10,651,080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) | 6,836,511,901円 |
| D I A M バランス20VA (適格機関投資家限定) | 42,301,326円 |
| D I A M バランス40VA (適格機関投資家限定) | 36,544,094円 |
| D I A M バランス60VA (適格機関投資家限定) | 257,372円 |
| 期末元本合計 | 85,414,197,806円 |

■損益の状況

当期 自2017年2月16日 至2018年2月15日

| 項 | 目 | 当 | 期 | | | | | | |
|-------|---|---|---|------------------|----------------|------|---|-----------------|-----------------|
| (A) 配 | 当 | 等 | 収 | 益 | 6,101,718,094円 | | | | |
| 受 | 取 | 配 | 当 | 金 | 6,065,033,408 | | | | |
| 受 | 取 | 取 | 利 | 息 | 1,109 | | | | |
| そ | の | 他 | 収 | 益 | 37,163,795 | | | | |
| 支 | の | 払 | 利 | 息 | △480,218 | | | | |
| (B) 有 | 価 | 証 | 券 | 売 | 買 | 損 | 益 | 20,582,782,877 | |
| 売 | | | 買 | | | | 益 | 44,193,771,824 | |
| 売 | | | 買 | | | | 損 | △23,610,988,947 | |
| (C) 先 | 物 | 取 | 引 | 等 | 取 | 引 | 損 | 益 | 623,965,667 |
| 取 | | | 引 | | | | 益 | 1,012,172,923 | |
| 取 | | | 引 | | | | 損 | △388,207,256 | |
| (D) そ | の | 他 | | 費 | | | 用 | | △76,168,056 |
| (E) 当 | 期 | 損 | 益 | 金(A + B + C + D) | | | | | 27,232,298,582 |
| (F) 前 | 期 | 繰 | 越 | 損 | 益 | 金 | | | 186,805,969,026 |
| (G) 解 | 約 | 差 | 損 | 益 | 金 | | | | △59,316,553,849 |
| (H) 追 | 加 | 信 | 託 | 差 | 損 | 益 | 金 | | 44,312,221,431 |
| (I) 合 | 計 | | | 計(E + F + G + H) | | | | | 199,033,935,190 |
| 次 | 期 | 繰 | 越 | 損 | 益 | 金(I) | | | 199,033,935,190 |

(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)

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 債券組入率 | 債券先物率 | 純資産総額 |
|------------------|--------|------|--|------|-------|-------|---------------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | | |
| 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) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

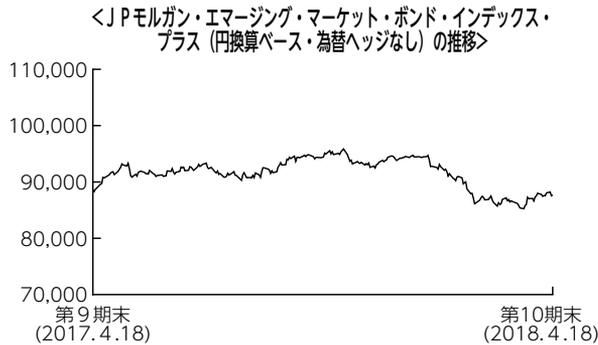
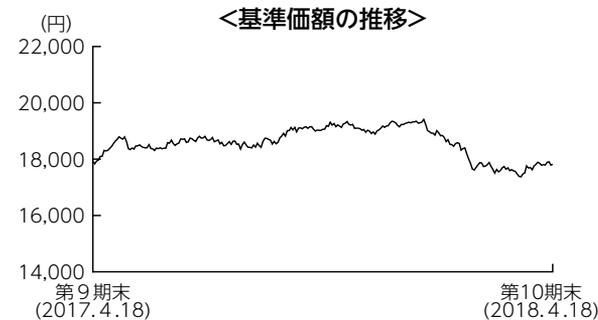
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | JPモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 債券組入 比 | 債券先物 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--|--------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 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）



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。

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

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・エマーゼン・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・エマーゼン・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8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 |
|----|------|------|----------|--------------------|
| | | | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル |
| 外国 | 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 |
| | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| ア メ リ カ | 949,163 | 1,003,633 | 107,589,494 | 96.4 | 26.7 | 72.6 | 18.1 | 5.7 |
| 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 | | | |
| | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | | |
| UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 | 国債証券 | 6.0500 | 11,900 | 13,557 | 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) | | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 | 国 | 債 | 証 | 4.1250 | 10,000 | 10,157 | 1,088,884 | 2026/01/21 | |
| INDONESIA 5.875 01/15/24 | 国 | 債 | 証 | 5.8750 | 8,800 | 9,695 | 1,039,318 | 2024/01/15 | |
| INDONESIA 4.75 01/08/26 | 国 | 債 | 証 | 4.7500 | 7,000 | 7,330 | 785,878 | 2026/01/08 | |
| PHILIPPINES 6.5 01/20/20 | 国 | 債 | 証 | 6.5000 | 2,800 | 2,974 | 318,889 | 2020/01/20 | |
| PHILIPPINES 4.2 01/21/24 | 国 | 債 | 証 | 4.2000 | 5,000 | 5,211 | 558,624 | 2024/01/21 | |
| PANAMA 5.2 01/30/20 | 国 | 債 | 証 | 5.2000 | 6,800 | 7,109 | 762,127 | 2020/01/30 | |
| HUNGARY 6.25 01/29/20 | 国 | 債 | 証 | 6.2500 | 8,500 | 8,979 | 962,655 | 2020/01/29 | |
| BRAZIL 2.625 01/05/23 | 国 | 債 | 証 | 2.6250 | 9,200 | 8,740 | 936,928 | 2023/01/05 | |
| UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21 | 国 | 債 | 証 | 3.5000 | 6,200 | 6,289 | 674,277 | 2021/01/21 | |
| BRAZIL 8.75 02/04/25 | 国 | 債 | 証 | 8.7500 | 3,000 | 3,791 | 406,438 | 2025/02/04 | |
| PHILIPPINES 3.7 02/02/42 | 国 | 債 | 証 | 3.7000 | 5,000 | 4,729 | 506,980 | 2042/02/02 | |
| TURKEY 7.375 02/05/25 | 国 | 債 | 証 | 7.3750 | 11,300 | 12,446 | 1,334,313 | 2025/02/05 | |
| TURKEY 6.625 02/17/45 | 国 | 債 | 証 | 6.6250 | 10,700 | 10,490 | 1,124,535 | 2045/02/17 | |
| PHILIPPINES 9.5 02/02/30 | 国 | 債 | 証 | 9.5000 | 6,600 | 9,887 | 1,059,971 | 2030/02/02 | |
| COLOMBIA 5.625 02/26/44 | 国 | 債 | 証 | 5.6250 | 10,200 | 11,204 | 1,201,143 | 2044/02/26 | |
| ROMANIA 6.75 02/07/22 | 国 | 債 | 証 | 6.7500 | 8,300 | 9,220 | 988,461 | 2022/02/07 | |
| BRAZIL 5.625 02/21/47 | 国 | 債 | 証 | 5.6250 | 11,400 | 10,981 | 1,177,168 | 2047/02/21 | |
| COLOMBIA 4.0 02/26/24 | 国 | 債 | 証 | 4.0000 | 8,100 | 8,191 | 878,088 | 2024/02/26 | |
| HUNGARY 5.375 02/21/23 | 国 | 債 | 証 | 5.3750 | 8,100 | 8,752 | 938,315 | 2023/02/21 | |
| PANAMA 3.875 03/17/28 | 国 | 債 | 証 | 3.8750 | 6,200 | 6,215 | 666,301 | 2028/03/17 | |
| RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 | 国 | 債 | 証 | 7.5000 | 15,263 | 17,110 | 1,834,216 | 2030/03/31 | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 | 国 | 債 | 証 | 4.7500 | 16,000 | 15,648 | 1,677,465 | 2044/03/08 | |
| TURKEY 5.625 03/30/21 | 国 | 債 | 証 | 5.6250 | 6,700 | 6,926 | 742,530 | 2021/03/30 | |
| PHILIPPINES 5.5 03/30/26 | 国 | 債 | 証 | 5.5000 | 3,800 | 4,294 | 460,386 | 2026/03/30 | |
| PERU 6.55 03/14/37 | 国 | 債 | 証 | 6.5500 | 6,200 | 7,943 | 851,536 | 2037/03/14 | |
| HUNGARY 7.625 03/29/41 | 国 | 債 | 証 | 7.6250 | 3,800 | 5,509 | 590,643 | 2041/03/29 | |
| PHILIPPINES 3.7 03/01/41 | 国 | 債 | 証 | 3.7000 | 7,400 | 7,025 | 753,100 | 2041/03/01 | |
| TURKEY 5.125 03/25/22 | 国 | 債 | 証 | 5.1250 | 5,300 | 5,370 | 575,682 | 2022/03/25 | |
| TURKEY 5.75 03/22/24 | 国 | 債 | 証 | 5.7500 | 9,300 | 9,500 | 1,018,444 | 2024/03/22 | |
| HUNGARY 5.375 03/25/24 | 国 | 債 | 証 | 5.3750 | 5,800 | 6,322 | 677,811 | 2024/03/25 | |
| PANAMA 3.75 03/16/25 | 国 | 債 | 証 | 3.7500 | 6,000 | 6,030 | 646,416 | 2025/03/16 | |
| UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 | 国 | 債 | 証 | 3.6250 | 8,900 | 9,016 | 966,597 | 2022/03/15 | |
| HUNGARY 6.375 03/29/21 | 国 | 債 | 証 | 6.3750 | 8,600 | 9,345 | 1,001,878 | 2021/03/29 | |
| CROATIA 6.375 03/24/21 | 国 | 債 | 証 | 6.3750 | 4,500 | 4,862 | 521,257 | 2021/03/24 | |
| COLOMBIA 2.625 03/15/23 | 国 | 債 | 証 | 2.6250 | 4,300 | 4,110 | 440,617 | 2023/03/15 | |
| TURKEY 3.25 03/23/23 | 国 | 債 | 証 | 3.2500 | 5,100 | 4,712 | 505,180 | 2023/03/23 | |
| SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20 | 国 | 債 | 証 | 5.5000 | 6,000 | 6,236 | 668,522 | 2020/03/09 | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 | 国 | 債 | 証 | 4.1500 | 10,600 | 10,711 | 1,148,251 | 2027/03/28 | |
| TURKEY 6.0 03/25/27 | 国 | 債 | 証 | 6.0000 | 10,400 | 10,426 | 1,117,711 | 2027/03/25 | |
| PANAMA 9.375 04/01/29 | 国 | 債 | 証 | 9.3750 | 4,900 | 7,105 | 761,656 | 2029/04/01 | |
| RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 | 国 | 債 | 証 | 5.6250 | 11,200 | 11,702 | 1,254,476 | 2042/04/04 | |
| TURKEY 4.25 04/14/26 | 国 | 債 | 証 | 4.2500 | 6,000 | 5,435 | 582,719 | 2026/04/14 | |
| TURKEY 4.875 04/16/43 | 国 | 債 | 証 | 4.8750 | 10,100 | 8,098 | 868,124 | 2043/04/16 | |
| INDONESIA 4.625 04/15/43 | 国 | 債 | 証 | 4.6250 | 4,000 | 3,936 | 422,024 | 2043/04/15 | |
| RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 | 国 | 債 | 証 | 4.5000 | 9,000 | 9,108 | 976,474 | 2022/04/04 | |
| INDONESIA 3.75 04/25/22 | 国 | 債 | 証 | 3.7500 | 9,000 | 9,043 | 969,488 | 2022/04/25 | |
| RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 | 国 | 債 | 証 | 5.0000 | 15,200 | 15,530 | 1,664,896 | 2020/04/29 | |
| COLOMBIA 3.875 04/25/27 | 国 | 債 | 証 | 3.8750 | 9,400 | 9,241 | 990,700 | 2027/04/25 | |
| CROATIA 5.5 04/04/23 | 国 | 債 | 証 | 5.5000 | 5,800 | 6,231 | 668,012 | 2023/04/04 | |
| INDONESIA 3.375 04/15/23 | 国 | 債 | 証 | 3.3750 | 4,500 | 4,416 | 473,427 | 2023/04/15 | |
| BRAZIL 6.0 04/07/26 | 国 | 債 | 証 | 6.0000 | 8,200 | 9,007 | 965,625 | 2026/04/07 | |
| SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26 | 国 | 債 | 証 | 4.8750 | 4,600 | 4,604 | 493,627 | 2026/04/14 | |
| COLOMBIA 8.125 05/21/24 | 国 | 債 | 証 | 8.1250 | 4,300 | 5,278 | 565,851 | 2024/05/21 | |
| SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22 | 国 | 債 | 証 | 5.8750 | 4,200 | 4,523 | 484,872 | 2022/05/30 | |
| TURKEY 6.75 05/30/40 | 国 | 債 | 証 | 6.7500 | 6,700 | 6,784 | 727,253 | 2040/05/30 | |
| SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19 | 国 | 債 | 証 | 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 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 30,468,731円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 104,407,098円 |
| DIAM DC 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クスファンド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) | 有 価 証 券 売 買 損 益 | △5,545,889,985 | |
| | 売 買 益 | 642,531,914 | |
| | 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 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|---|-------|--------|--------|-------------------------------|--------|
| | 期中騰落率 | 期中騰落率 | (円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | 期中騰落率 | | | | |
| 6期(2014年4月18日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | % | 百万円 |
| | 9,335 | 8.4 | 203,185.39 | 8.7 | 97.3 | 1.7 | 1.0 | 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)。

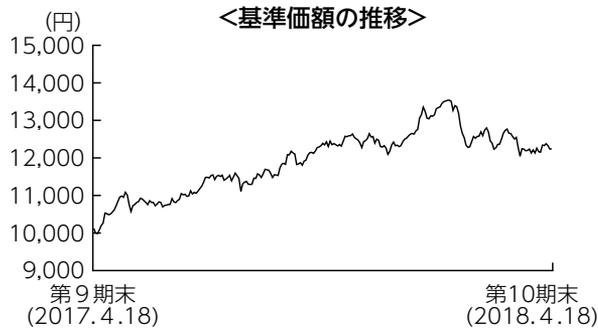
■当期中の基準価額と市況の推移

| 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）

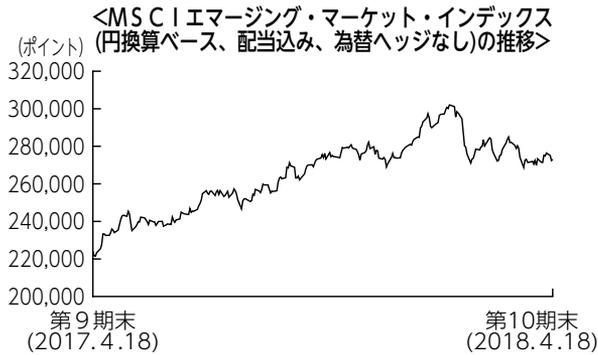


基準価額の推移

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8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 | 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 | | |
| 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 銘柄数 | 金額 銘柄数 | 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 | | 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 | コンピュータ・周辺機器 |
| 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 | コンピュータ・周辺機器 |
| 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 | コングロマリット |
| 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 |
| TAIAMED BIOLOGICS 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 TELEvisa 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> | 株数・金 銘柄数<比率> | 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> | 株数・金 銘柄数<比率> | 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> | 株数・金 銘柄数<比率> | 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 | |
| | 8,218.21 | 10,650.8 | - | <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 | |
| | 2,038.15 | 2,753.98 | - | <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・ソフトウェア/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 | コンピュータリット |
| 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 INFRA TEL 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 | | | |
| (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 | | | |
| | | 5銘柄 | — | <0.1%> | | | |
| (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 | 送配インフラ | | |
| 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 | | |
| | | 31銘柄 | 29銘柄 | — | <1.9%> | | |
| (アラブ首長国連邦) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | | | |
| DUBAI ISLAMIC BANK PJSC | 1,012.2 | 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 | | |
| | | 8銘柄 | 10銘柄 | — | <0.5%> | | |
| (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 ELETRICA 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 | 千ブラジル・レアル | 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・金額 銘柄数<比率> | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 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 | 千チェコ・コルナ | 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・金額 銘柄数<比率> | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 606.79 4銘柄 | 880.13 4銘柄 | 22,889 — | 120,171 <0.2%> | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 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 | 7,752 | 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 | | 業種等 |
|------------------------------------|------------------|----------|--------------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (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 | 56,843 | 1,566,604 | |
| | 43銘柄 | 46銘柄 | - | <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・イヤー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・イヤー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・イヤー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 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 | 買 益 | 11,067,084,761 | |
| 売 | 買 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) 合 | 計(E + F + G + H) | 12,165,560,917 | |
| 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)

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2018年6月6日）

（計算期間 2017年6月7日～2018年6月6日）

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 東証R E I T指数 | | 投資証券 組入比率 | 不動産 投信先物 指数比率 | 純資産 総額 |
|----------------|------------------|-------------|--------------------|------------------|--------------|---------------------|-----------|
| | 期 騰 落 率 | 中 落 率 | (配当込み) （ベンチマーク） | 期 騰 落 率 | | | |
| | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 8期（2014年6月6日） | 14,064 | 25.3 | 2,619.15 | 25.7 | 99.0 | — | 27,010 |
| 9期（2015年6月8日） | 17,124 | 21.8 | 3,194.43 | 22.0 | 98.9 | — | 29,321 |
| 10期（2016年6月6日） | 18,293 | 6.8 | 3,414.59 | 6.9 | 99.1 | — | 23,383 |
| 11期（2017年6月6日） | 17,626 | △3.6 | 3,285.51 | △3.8 | 98.3 | 1.5 | 29,280 |
| 12期（2018年6月6日） | 18,181 | 3.1 | 3,386.35 | 3.1 | 97.8 | 1.7 | 35,462 |

（注1）不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

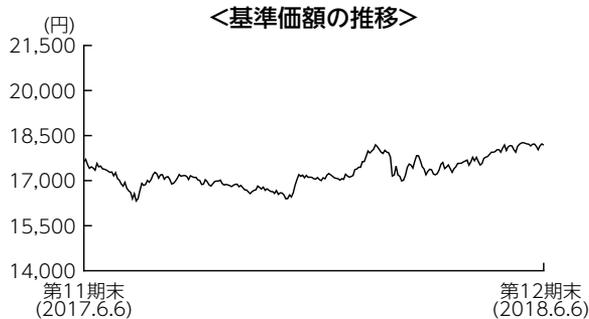
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東 証 R E I T 指 数 (配当込み) (ベンチマーク) | | 投 資 証 券 組 入 比 率 | 不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率 |
|-------------------------|-------------|--------|---------------------------------------|--------|--------------------|-----------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2017 年 6 月 6 日 | 円 17,626 | % - | ポイント 3,285.51 | % - | % 98.3 | % 1.5 |
| 6 月 末 | 17,065 | △3.2 | 3,180.48 | △3.2 | 98.1 | 1.5 |
| 7 月 末 | 17,277 | △2.0 | 3,220.02 | △2.0 | 98.0 | 1.5 |
| 8 月 末 | 17,108 | △2.9 | 3,188.63 | △2.9 | 97.8 | 1.6 |
| 9 月 末 | 16,848 | △4.4 | 3,139.87 | △4.4 | 98.2 | 1.3 |
| 10 月 末 | 16,634 | △5.6 | 3,099.44 | △5.7 | 98.3 | 1.3 |
| 11 月 末 | 17,117 | △2.9 | 3,189.89 | △2.9 | 98.4 | 1.2 |
| 12 月 末 | 17,114 | △2.9 | 3,189.59 | △2.9 | 98.3 | 1.3 |
| 2018 年 1 月 末 | 18,010 | 2.2 | 3,357.09 | 2.2 | 98.2 | 1.2 |
| 2 月 末 | 17,661 | 0.2 | 3,291.44 | 0.2 | 97.4 | 2.0 |
| 3 月 末 | 17,573 | △0.3 | 3,274.92 | △0.3 | 97.6 | 1.9 |
| 4 月 末 | 18,026 | 2.3 | 3,358.59 | 2.2 | 97.8 | 1.9 |
| 5 月 末 | 18,144 | 2.9 | 3,379.45 | 2.9 | 97.8 | 1.7 |
| (期 末) 2018 年 6 月 6 日 | 18,181 | 3.1 | 3,386.35 | 3.1 | 97.8 | 1.7 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年6月7日から2018年6月6日まで）



基準価額の推移

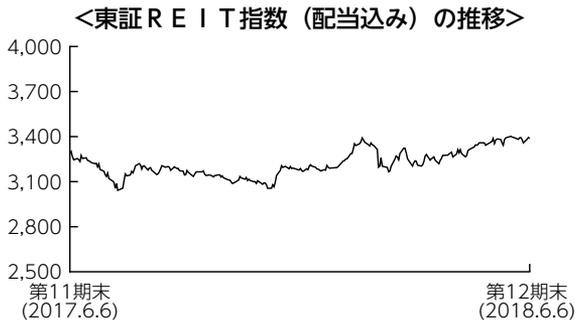
当ファンドの基準価額は18,181円となり、前期末比で3.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

配当利回りの高さを評価した押し目買いや、国内金利の上昇が限定的なものに止まるとの見方を受けてJ-R E I T市場が上昇したことから、基準価額も上昇しました。

投資環境

J-R E I T市場は世界的に金利上昇懸念が強まる中で、投資信託からとみられる解約売りが出ました。このため、東証R E I T指数（配当込み）は2017年7月14日に3,041.74ポイントの安値を付けました。その後は投資信託からの解約売りが細る中で配当利回りの高さからの押し目買いも入り値を戻しました。国内金利の上昇が限定的なものに止まるとの見方が強まったことも上昇に寄与しました。東証R E I T指数（配当込み）は3,386.35ポイントで期末を迎えました。



ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で3.1%上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.1%上回りました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させましたので、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------------------|-----------|-------------------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 (先物・オプション) | 0円 (0) | 0.002% (0.001) |
| (投資証券) | (0) | (0.001) |
| 合 計 | 0 | 0.002 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(17,285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8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6月7日から2018年6月6日まで)

(1) 投資証券

| | 買 | | 売 | |
|-------------------------|--------------------|----------------------|--------------|----------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 国内 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 1.099 (-) | 507,245 (-) | 0.903 (-) | 417,945 (-) |
| MCUBS MidCity投資法人 | 2.372 (3.416) | 284,558 (-) | 1.783 (-) | 207,783 (-) |
| 森ヒルズリート投資法人 | 3.552 (-) | 487,856 (-) | 2.921 (-) | 397,705 (-) |
| 産業ファンド投資法人 | 2.309 (3.597) | 476,522 (-) | 1.961 (-) | 356,851 (-) |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 3.064 (-) | 844,583 (-) | 2.52 (-) | 684,463 (-) |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 1.005 (1.033) | 232,549 (29,160) | 0.706 (-) | 188,392 (-) |
| アクティブピア・プロパティーズ投資法人 | 1.545 (-) | 731,632 (-) | 1.205 (-) | 564,556 (-) |
| GLP投資法人 | 7.245 (-) | 854,059 (-) | 4.832 (-) | 580,473 (-) |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 1.288 (-) | 308,152 (-) | 1.012 (-) | 238,203 (-) |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 4.777 (-) | 1,134,440 (-) | 3.396 (-) | 805,577 (-) |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 0.615 (-) | 342,881 (-) | 0.399 (-) | 221,951 (-) |
| Oneリート投資法人 | 0.361 (-) | 83,622 (-) | 0.297 (-) | 71,022 (-) |
| イオンリート投資法人 | 3.365 (-) | 392,651 (-) | 2.542 (-) | 296,173 (-) |
| ヒューリックリート投資法人 | 2.361 (-) | 390,349 (-) | 1.823 (-) | 301,974 (-) |
| 日本リート投資法人 | 0.888 (-) | 284,984 (-) | 0.73 (-) | 232,248 (-) |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 11.891 (14.21) | 295,490 (-) | 3.085 (-) | 175,490 (-) |
| 日本ヘルスケア投資法人 | 0.16 (-) | 26,850 (-) | 0.132 (-) | 22,034 (-) |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 3.109 (7.37505) | 331,913 (352,965) | 2.125 (-) | 255,150 (-) |
| トーセイ・リート投資法人 | 0.634 (-) | 68,857 (-) | 0.411 (-) | 44,313 (-) |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 1.202 (-) | 284,595 (-) | 0.988 (-) | 232,231 (-) |

| | 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
|---------------------|---|----------|---|-----------|---|-------|---|-----------|
| | □ | 数 | 金 | 額 | □ | 数 | 金 | 額 |
| | | 千□ | | 千円 | | 千□ | | 千円 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | | 0.407 | | 41,562 | | 0.335 | | 34,618 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | | 0.576 | | 51,689 | | 0.474 | | 42,482 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ジャパン・シニアリビング投資法人 | | 0.131 | | 19,154 | | 0.131 | | 19,960 |
| | | (△0.202) | | (△29,160) | | (-) | | (-) |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | 9.858 | | 1,453,636 | | 7.787 | | 1,132,882 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| いちごホテルリート投資法人 | | 0.522 | | 61,827 | | 0.436 | | 51,718 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ラサールロジポート投資法人 | | 2.495 | | 278,378 | | 2.052 | | 230,794 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| スターアジア不動産投資法人 | | 0.842 | | 89,384 | | 0.605 | | 63,527 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| マリモ地方創生リート投資法人 | | 0.324 | | 35,679 | | 0.188 | | 20,044 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | | 0.694 | | 240,612 | | 0.482 | | 165,136 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 大江戸温泉リート投資法人 | | 0.652 | | 57,596 | | 0.404 | | 34,944 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| さくら総合リート投資法人 | | 0.796 | | 72,751 | | 0.654 | | 60,919 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 投資法人みらい | | 0.504 | | 89,779 | | 0.35 | | 62,400 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | | 0.717 | | 104,213 | | 0.59 | | 85,798 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | 0.586 | | 159,885 | | 0.192 | | 52,298 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | | 0.448 | | 50,790 | | 0.022 | | 2,527 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ザイマックス・リート投資法人 | | 0.412 | | 46,714 | | 0.02 | | 2,289 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本ビルファンド投資法人 | | 3.203 | | 1,846,803 | | 2.634 | | 1,503,968 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | | 3.347 | | 1,851,404 | | 2.58 | | 1,415,315 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本リテールファンド投資法人 | | 6.34 | | 1,299,317 | | 5.36 | | 1,096,646 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| オリックス不動産投資法人 | | 6.63 | | 1,079,664 | | 5.263 | | 853,937 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | | 2.088 | | 799,298 | | 1.717 | | 646,784 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| プレミア投資法人 | | 2.988 | | 324,484 | | 2.457 | | 267,667 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 東急リアル・エステート投資法人 | | 2.216 | | 308,452 | | 1.822 | | 249,502 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | | 0.824 | | 210,223 | | 0.571 | | 175,875 |
| | | (1.86) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | | 7.296 | | 1,211,715 | | 6 | | 985,649 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 森トラスト総合リート投資法人 | | 2.365 | | 395,608 | | 1.944 | | 318,264 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| インヴェンシブル投資法人 | | 10.55 | | 501,052 | | 7.057 | | 340,529 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| フロンティア不動産投資法人 | | 1.124 | | 510,404 | | 0.924 | | 414,679 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 平和不動産リート投資法人 | | 2.062 | | 196,820 | | 1.696 | | 162,226 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------|-------------------|-----------------------|--------------|----------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 2.298 (-) | 494,685 (-) | 1.793 (-) | 377,688 (-) |
| 福岡リート投資法人 | 1.742 (-) | 293,283 (-) | 1.322 (-) | 225,475 (-) |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 1.036 (-) | 667,103 (-) | 0.795 (-) | 513,897 (-) |
| 積水ハウス・レジデンシャル投資法人 | 2.088 (△2.977) | 240,775 (△352,965) | 1.891 (-) | 217,999 (-) |
| いちごオフィスリート投資法人 | 2.562 (-) | 197,977 (-) | 2.107 (-) | 162,751 (-) |
| 大和証券オフィス投資法人 | 0.71 (-) | 416,779 (-) | 0.584 (-) | 345,528 (-) |
| 阪急リート投資法人 | 1.481 (-) | 199,437 (-) | 1.126 (-) | 149,204 (-) |
| スターツプロシード投資法人 | 0.523 (-) | 82,758 (-) | 0.431 (-) | 68,821 (-) |
| 大和ハウスリート投資法人 | 4.002 (-) | 1,053,370 (-) | 2.823 (-) | 737,622 (-) |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 10.175 (-) | 785,743 (-) | 7.853 (-) | 613,064 (-) |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 3.72 (-) | 307,148 (-) | 3.059 (-) | 251,869 (-) |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 2.963 (-) | 401,019 (-) | 2.436 (-) | 327,306 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|----------------|--------------|--------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国内 不動産投信指数先物取引 | 百万円 2,182 | 百万円 2,040 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2017年6月7日から2018年6月6日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 金 銭 信 託 | 百万円 311 | 百万円 311 | % 100.0 | 百万円 - | 百万円 - | % - |

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 | 期 |
|---------|---|--------------|
| | 買 | 付 額 |
| 投 資 証 券 | | 百万円 1,266 |

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、資産管理サービス信託銀行、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|-------------------------|---|---------|----------|-----------|---|---|-----|
| | | □ 数 | □ 数 | 評 価 | 額 | 比 | 率 |
| 不動産ファンド | | 千□ | 千□ | 千円 | | | % |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | | 1.218 | 1.414 | 697,102 | | | 2.0 |
| MCUBS MidCity投資法人 | | 0.742 | 4.747 | 395,899 | | | 1.1 |
| 森ヒルズリート投資法人 | | 3.939 | 4.57 | 632,945 | | | 1.8 |
| 産業ファンド投資法人 | | 0.996 | 4.941 | 595,884 | | | 1.7 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | | 3.395 | 3.939 | 1,121,433 | | | 3.2 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | | 0.832 | 2.164 | 346,456 | | | 1.0 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | | 1.585 | 1.925 | 934,587 | | | 2.6 |
| GLP投資法人 | | 6.419 | 8.832 | 1,069,555 | | | 3.0 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | 1.337 | 1.613 | 422,444 | | | 1.2 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | | 4.289 | 5.67 | 1,297,296 | | | 3.7 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | | 0.456 | 0.672 | 374,304 | | | 1.1 |
| Oneリート投資法人 | | 0.401 | 0.465 | 116,482 | | | 0.3 |
| イオンリート投資法人 | | 3.217 | 4.04 | 495,708 | | | 1.4 |
| ヒューリックリート投資法人 | | 2.351 | 2.889 | 484,774 | | | 1.4 |
| 日本リート投資法人 | | 0.985 | 1.143 | 375,475 | | | 1.1 |
| インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | | 2.051 | 25.067 | 364,724 | | | 1.0 |
| 日本ヘルスケア投資法人 | | 0.178 | 0.206 | 35,638 | | | 0.1 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | 2.3 | 10.65905 | 757,858 | | | 2.1 |
| トーセイ・リート投資法人 | | 0.461 | 0.684 | 77,018 | | | 0.2 |
| ケネディクス商業リート投資法人 | | 1.333 | 1.547 | 377,003 | | | 1.1 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | | 0.452 | 0.524 | 56,749 | | | 0.2 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | | 0.637 | 0.739 | 70,796 | | | 0.2 |
| ジャパン・シニアリビング投資法人 | | 0.202 | - | - | | | - |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | 10.519 | 12.59 | 1,927,529 | | | 5.4 |
| いちごホテルリート投資法人 | | 0.58 | 0.666 | 88,844 | | | 0.3 |
| ラサールロジポート投資法人 | | 2.766 | 3.209 | 355,878 | | | 1.0 |
| スターアジア不動産投資法人 | | 0.761 | 0.998 | 106,287 | | | 0.3 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | | 0.205 | 0.341 | 39,862 | | | 0.1 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | | 0.593 | 0.805 | 275,712 | | | 0.8 |
| 大江戸温泉リート投資法人 | | 0.466 | 0.714 | 61,832 | | | 0.2 |
| さくら総合リート投資法人 | | 0.881 | 1.023 | 94,525 | | | 0.3 |
| 投資法人みらい | | 0.467 | 0.621 | 115,071 | | | 0.3 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | | 0.794 | 0.921 | 134,005 | | | 0.4 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | - | 0.394 | 104,961 | | | 0.3 |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | | - | 0.426 | 48,777 | | | 0.1 |

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) 当 期 末 | | | |
|---------|----------------------------|---------------|-------------|------------|------|
| | | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| 不動産ファンド | | 千□ | 千□ | 千円 | % |
| | ザイマックス・リート投資法人 | — | 0.392 | 44,570 | 0.1 |
| | 日本ビルファンド投資法人 | 3.551 | 4.12 | 2,554,400 | 7.2 |
| | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 3.466 | 4.233 | 2,400,111 | 6.8 |
| | 日本リテールファンド投資法人 | 7.053 | 8.033 | 1,596,960 | 4.5 |
| | オリックス不動産投資法人 | 7.074 | 8.441 | 1,455,228 | 4.1 |
| | 日本プライムリアルティ投資法人 | 2.315 | 2.686 | 1,074,400 | 3.0 |
| | プレミア投資法人 | 3.312 | 3.843 | 404,667 | 1.1 |
| | 東急リアル・エステート投資法人 | 2.458 | 2.852 | 424,377 | 1.2 |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 0.589 | 2.702 | 297,220 | 0.8 |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 8.087 | 9.383 | 1,596,986 | 4.5 |
| | 森トラスト総合リート投資法人 | 2.62 | 3.041 | 487,168 | 1.4 |
| | インヴィンシブル投資法人 | 8.175 | 11.668 | 586,900 | 1.7 |
| | フロンティア不動産投資法人 | 1.247 | 1.447 | 654,044 | 1.8 |
| | 平和不動産リート投資法人 | 2.283 | 2.649 | 276,025 | 0.8 |
| | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 2.329 | 2.834 | 635,099 | 1.8 |
| | 福岡リート投資法人 | 1.78 | 2.2 | 379,500 | 1.1 |
| | ケネディクス・オフィス投資法人 | 1.072 | 1.313 | 879,710 | 2.5 |
| | 積水ハウス・レジデンシャル投資法人 | 2.78 | — | — | — |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 2.839 | 3.294 | 277,684 | 0.8 |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 0.791 | 0.917 | 583,212 | 1.6 |
| | 阪急リート投資法人 | 1.502 | 1.857 | 255,708 | 0.7 |
| | スターツプロシード投資法人 | 0.578 | 0.67 | 109,277 | 0.3 |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 3.771 | 4.95 | 1,284,030 | 3.6 |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 9.957 | 12.279 | 1,008,105 | 2.8 |
| | 日本賃貸住宅投資法人 | 4.124 | 4.785 | 414,859 | 1.2 |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 3.283 | 3.81 | 547,497 | 1.5 |
| 合 計 | □ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 144,844 | 215,55705 | 34,681,169 | — |
| | | 58銘柄<98.3%> | 59銘柄<97.8%> | — | 97.8 |

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | 当 期 | | 末 |
|-----|-------------|------------|-------|----------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 国内 | 東 証 R E I T | 百万円 602 | | 百万円 - |

■投資信託財産の構成

2018年6月6日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|------------------|---|-----------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 投 資 証 券 | 千円 34,681,169 | | % 96.4 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,290,170 | | 3.6 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 35,971,340 | | 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

(2018年6月6日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 35,971,340,086円 |
| コ ー ル ・ 口 ー ン 等 | 1,050,557,425 |
| 投 資 証 券(評価額) | 34,681,169,205 |
| 未 収 入 金 | 1,576,692 |
| 未 収 配 当 金 | 230,700,864 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 7,335,900 |
| (B) 負 債 | 508,660,237 |
| 未 払 金 | 191,407,137 |
| 未 払 解 約 金 | 317,253,100 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 35,462,679,849 |
| 元 本 | 19,505,563,952 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 15,957,115,897 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 19,505,563,952口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 18,181円 |

(注1) 期首元本額 16,612,010,958円
 追加設定元本額 17,202,970,498円
 一部解約元本額 14,309,417,504円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|---------------------------------|----------------|
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 325,732円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 878,816円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 2,224,282円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 1,990,694円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 2,854,169円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 2,583,491円 |
| たわらノーロード 国内リート | 1,259,077,394円 |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ向け> | 348,709,195円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 42,193,744円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 518,340円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 10,225,050円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 22,756,916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) | 5,224,392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) | 12,918,501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) | 8,464,061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) | 18,060,461円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 114,227円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 844,635円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 827,622円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 2,258,059円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 14,493,488円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 368,359,319円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション | 3,505,986円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) | 20,047,747円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) | 66,986,206円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) | 145,477,778円 |
| 投資のソムリエ | 2,768,966,809円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 205,160,003円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> | 75,439,086円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 82,317,337円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 180,418円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 1,491,123,366円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 529,834円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 344,126円 |

| | |
|---|-----------------|
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 386,092円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 857,110円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 107,407,664円 |
| Jリートインデックスファンド (DC) | 7,714,922円 |
| D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定) | 92,432,299円 |
| D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定) | 834,968,535円 |
| D I A M J - R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け) | 9,218,123,494円 |
| D I A Mグローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 14,402,370円 |
| D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 1,265,035,544円 |
| D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII (適格機関投資家限定) | 978,254,638円 |
| 期末元本合計 | 19,505,563,952円 |

■損益の状況

当期 自2017年6月7日 至2018年6月6日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 1,264,127,194円 | |
| | 受取配当金 | 1,263,967,545 | |
| | 受取利息 | 212 | |
| | その他の収益 | 679,889 | |
| | 支払利息 | △520,452 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | △207,450,418 | |
| | 売買益 | 1,002,666,019 | |
| | 売買損 | △1,210,116,437 | |
| (C) | 先物取引等取引損益 | 16,919,674 | |
| | 取引益 | 41,782,480 | |
| | 取引損 | △24,862,806 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 1,073,596,450 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 12,668,365,265 | |
| (F) | 解約差損益金 | △10,343,772,310 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 12,558,926,492 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 15,957,115,897 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 15,957,115,897 | |

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

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

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

《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)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第11期（決算日 2018年6月22日）

（対象期間 2017年6月23日～2018年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 | 純資産額 総 |
|-----------------|--------|------|---|------|-------------------------------|---------------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | |
| 7期(2014年6月23日) | 9,091 | 23.1 | 88,864.68 | 23.7 | 99.6 | 百万円 28,301 |
| 8期(2015年6月22日) | 11,550 | 27.0 | 113,473.63 | 27.7 | 99.5 | 26,943 |
| 9期(2016年6月22日) | 10,906 | △5.6 | 108,051.29 | △4.8 | 99.6 | 32,918 |
| 10期(2017年6月22日) | 11,770 | 7.9 | 117,262.55 | 8.5 | 99.7 | 43,023 |
| 11期(2018年6月22日) | 11,979 | 1.8 | 120,101.82 | 2.4 | 99.3 | 53,148 |

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

（注2）S & P 先進国 REIT インデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスズLLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

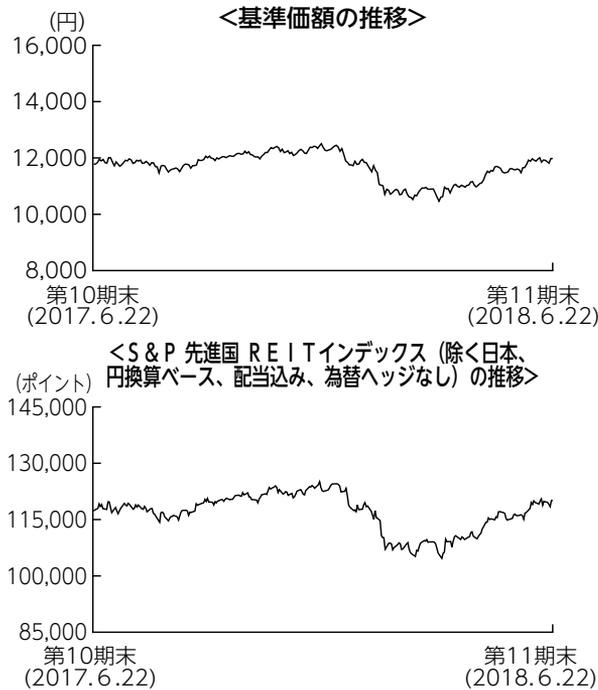
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) | | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 |
|-------------------------|-------------|--------|--|-----------|-------------------------------|
| | | 騰 落 率 | (ベンチマーク) | 期 騰 落 中 率 | |
| (期 首) 2017年 6 月 22 日 | 円 11,770 | % - | ポイント 117,262.55 | % - | % 99.7 |
| 6 月 末 | 11,832 | 0.5 | 117,909.44 | 0.6 | 98.8 |
| 7 月 末 | 11,810 | 0.3 | 117,819.86 | 0.5 | 99.4 |
| 8 月 末 | 11,733 | △0.3 | 117,041.92 | △0.2 | 99.6 |
| 9 月 末 | 12,009 | 2.0 | 119,881.05 | 2.2 | 99.8 |
| 10 月 末 | 11,965 | 1.7 | 119,478.59 | 1.9 | 99.5 |
| 11 月 末 | 12,180 | 3.5 | 121,716.79 | 3.8 | 99.5 |
| 12 月 末 | 12,451 | 5.8 | 124,486.71 | 6.2 | 99.1 |
| 2018年 1 月 末 | 11,509 | △2.2 | 115,087.33 | △1.9 | 99.5 |
| 2 月 末 | 10,715 | △9.0 | 107,183.44 | △8.6 | 105.5 |
| 3 月 末 | 10,900 | △7.4 | 109,095.48 | △7.0 | 97.5 |
| 4 月 末 | 11,228 | △4.6 | 112,432.61 | △4.1 | 97.0 |
| 5 月 末 | 11,656 | △1.0 | 116,731.34 | △0.5 | 99.5 |
| (期 末) 2018年 6 月 22 日 | 11,979 | 1.8 | 120,101.82 | 2.4 | 99.3 |

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2017年6月23日から2018年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は11,979円となり、前期末に比べ1.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米ドルや豪ドルなどの通貨が対円で下落したものの、多くの外国リート市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

米国リート市場は税制改革に伴う財政赤字拡大や好調な雇用統計による利上げ観測の高まりを受け大きく下落する局面もありましたが、期末にかけては持ち直しました。欧州リート市場は米長期金利の急上昇に伴うリスク回避の動きから下落する局面もあったものの、期末にかけては欧州域内の政治的不透明感の後退などから反発しました。豪州リート市場は期半ばに長期金利の上昇により調整しましたが、商品市況の上昇による恩恵期待などから上昇に転じました。こうした市場動向の結果、外国リート市場は前期末比で上昇しました。

米ドルはムニューシン米財務長官による米ドル安を容認する発言や、米国の通商政策を巡る不透明感など

から2018年3月にかけて米ドル安が進みましたが、その後は原油高に伴うインフレ期待の高まりや米国国債需給の悪化懸念による米国金利の上昇を受けて、米ドル安の修正が進みました。ユーロはECB（欧州中央銀行）による金融政策の正常化観測などからユーロ高となりました。豪ドルについては豪ドル高で推移していましたが、期の後半に豪ドル安へと転じました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.4%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.6%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、概ねベンチマークに連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------------------------------|----------------------|------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券) | 3円 (1) (2) | 0.024% (0.005) (0.019) |
| (b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券) | 5 (0) (5) | 0.044 (0.002) (0.042) |
| (c) その他費用 (保管費用) (その他) | 8 (6) (3) | 0.071 (0.047) (0.024) |
| 合 計 | 16 | 0.139 |

(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(11,685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8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6月23日から2018年6月22日まで)

投資信託受益証券、投資証券

| | 買 | | 売 | |
|--------------------------------|----------------|---------------|---------------|--------------|
| | □ 数 | 金 付 額 | □ 数 | 金 付 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 | 35.568 (-) | 4,390 (-) | 23.082 (-) | 2,829 (-) |
| ALEXANDER'S INC. | 1.315 (-) | 520 (-) | 0.929 (-) | 342 (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | 48.246 (-) | 5,900 (-) | 35.714 (-) | 4,275 (-) |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 14.876 (-) | 71 (-) | 6.755 (-) | 31 (-) |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 2.1 (-) | 23 (-) | 21.54 (-) | 240 (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 60.744 (-) | 1,757 (-) | 43.308 (-) | 1,185 (-) |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 48.621 (-) | 2,038 (-) | 35.197 (-) | 1,452 (-) |
| AGREE REALTY CORP | 9.73 (-) | 474 (-) | 5.673 (-) | 268 (-) |
| SL GREEN | 31.168 (-) | 3,094 (-) | 28.52 (-) | 2,763 (-) |
| EPR PROPERTIES | 20.013 (-) | 1,258 (-) | 14.423 (-) | 866 (-) |
| PROLOGIS INC | 165.308 (-) | 10,354 (-) | 121.41 (-) | 7,613 (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 43.627 (-) | 7,526 (-) | 32.387 (-) | 5,447 (-) |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 63.299 (-) | 573 (-) | 46.286 (-) | 408 (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 31.241 (-) | 2,715 (-) | 21.935 (-) | 1,866 (-) |
| CBL & ASSOCIATES | 40.727 (-) | 254 (-) | 28.048 (-) | 156 (-) |
| MACK CALI | 27.595 (-) | 575 (-) | 19.639 (-) | 393 (-) |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 47.065 (-) | 1,885 (-) | 32.786 (-) | 1,283 (-) |
| COUSINS PROPERTIES INC | 132.374 (-) | 1,186 (-) | 97.362 (-) | 857 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|------------------------------|-----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | | 千アメリカ・ドル | | 千アメリカ・ドル |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 35.456 | 1,032 | 27.718 | 817 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 6.189 | 120 | 4.067 | 75 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DDR CORP | 83.402 | 738 | 62.964 | 504 |
| | (△61.545) | (-) | (-) | (-) |
| ISTAR INC | 17.531 | 194 | 12.866 | 134 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DUKE REALTY TRUST | 116.046 | 3,157 | 86.42 | 2,311 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 23.641 | 150 | 9.894 | 60 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 21.011 | 5,090 | 15.576 | 3,655 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | 116.119 | 7,296 | 86.195 | 5,303 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 24.222 | 2,952 | 17.899 | 2,116 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 38.704 | 1,173 | 26.083 | 782 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GGP INC | 215.503 | 4,672 | 147.743 | 3,181 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FELCOR LODGING TR INC | 4.23 | 31 | - | - |
| | (△47.1) | (-) | (-) | (-) |
| HCP INC | 150.101 | 3,837 | 112.127 | 2,746 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY COMMONWEALTH | 38.809 | 1,179 | 30.137 | 901 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 41.956 | 1,266 | 28.694 | 837 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 31.438 | 1,510 | 22.265 | 1,038 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 50.068 | 1,389 | 36.338 | 996 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WELLTOWER INC | 116.976 | 7,288 | 85.049 | 5,055 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EAST GROUP | 11.267 | 972 | 8.006 | 681 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIMCO REALTY | 136.14 | 2,303 | 100.97 | 1,610 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KILROY REALTY CORP | 30.471 | 2,182 | 22.236 | 1,549 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LTC PROPERTIES INC | 12.384 | 535 | 8.839 | 361 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SENIOR HOUSING PPTYS TRUST | 71.223 | 1,269 | 51.351 | 871 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 21.192 | 328 | 12.67 | 199 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 45.476 | 1,885 | 32.979 | 1,352 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 51.818 | 872 | 37.507 | 629 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | 100.888 | 3,593 | 65.736 | 2,267 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE MACERICH COMPANY | 35.031 | 2,044 | 29.753 | 1,738 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 29.798 | 2,597 | 20.166 | 1,730 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ACADIA REALTY TRUST | 23.844 | 627 | 18.904 | 472 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 236.436 | 4,576 | 176.532 | 3,472 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MID AMERICA | 36.516 | 3,533 | 27.405 | 2,569 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 10.002 | 182 | 8.814 | 159 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 12.461 | 908 | 8.846 | 618 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 24.056 | 136 | 16.165 | 86 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 2.413 | 56 | 1.54 | 34 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 16.168 | 174 | 9.952 | 101 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GETTY REALTY CORP | 9.201 | 239 | 4.925 | 124 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PS BUSINESS PARKS | 5.75 | 706 | 4.064 | 483 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 20.975 | 267 | 13.732 | 170 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REALTY INCOME CORP | 91.773 | 4,934 | 65.189 | 3,398 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REGENCY CENTERS CORP | 48.632 | 2,990 | 36.227 | 2,178 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UDR INC | 86.682 | 3,190 | 64.418 | 2,321 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 31.819 | 924 | 22.611 | 624 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORECIVIC INC | 34.891 | 808 | 24.997 | 549 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAUL CENTERS INC | 2.873 | 157 | 1.901 | 97 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 97.015 | 15,456 | 72.899 | 11,528 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LIFE STORAGE INC | 13.899 | 1,148 | 10.076 | 823 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PUBLIC STORAGE | 46.827 | 9,543 | 34.659 | 6,812 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 28.022 | 2,520 | 18.37 | 1,631 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TAUBMAN CENTERS INC | 18.58 | 1,069 | 13.445 | 756 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TANGER FACTORY OUTLET | 28.446 | 676 | 21.603 | 512 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UMH PROPERTIES INC | 8.919 | 128 | 3.367 | 42 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 6.313 | 125 | 2.312 | 41 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 2.773 | 182 | 1.834 | 111 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VENTAS INC | 112.512 | 6,524 | 83.438 | 4,630 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 55.048 | 4,063 | 40.774 | 2,874 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WASHINGTON REIT | 23.747 | 702 | 16.294 | 465 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GEO GROUP INC | 37.161 | 910 | 27.563 | 626 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WEINGARTEN REALTY INVST | 37.299 | 1,117 | 26.943 | 780 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------------------|----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | | 千アメリカ・ドル | | 千アメリカ・ドル |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 42.94 | 1,772 | 30.887 | 1,199 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 23.768 | 413 | 17.226 | 281 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 40.361 | 3,405 | 29.938 | 2,496 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 24.965 | 239 | 17.549 | 164 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 66.983 | 1,070 | 46.71 | 754 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CUBESMART | 55.111 | 1,496 | 39.235 | 1,059 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 61.867 | 6,763 | 45.653 | 4,943 |
| | (16.082) | (-) | (-) | (-) |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 22.596 | 789 | 15.525 | 513 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 57.89 | 646 | 40.329 | 456 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 108.235 | 1,411 | 77.981 | 998 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DOUGLAS EMMETT INC | 50.774 | 1,940 | 33.384 | 1,248 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 28.505 | 1,647 | 20.08 | 1,151 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC | 4.648 | 287 | 1.57 | 99 |
| | (△29.51) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 33.479 | 618 | 23.601 | 424 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 37.258 | 720 | 32.643 | 610 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 31.202 | 475 | 22.551 | 340 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TERRENO REALTY CORP | 17.497 | 618 | 11.145 | 390 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 12.214 | 446 | 8.665 | 302 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RLJ LODGING TRUST | 50.154 | 1,067 | 36.019 | 776 |
| | (17.05) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 22.282 | 423 | 2.292 | 48 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORESITE REALTY CORP | 10.136 | 1,068 | 7.217 | 757 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VEREIT INC | 309.897 | 2,335 | 233.005 | 1,685 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 19.176 | 526 | 14.536 | 394 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 19.567 | 702 | 14.083 | 513 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST | 39.855 | 671 | 22.283 | 361 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 9.6 | 163 | 3.676 | 54 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHATHAM LODGING TRUST | 12.884 | 268 | 6.647 | 135 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 54.269 | 1,065 | 34.909 | 637 |
| | (33.6) | (-) | (-) | (-) |
| WHITESTONE REIT | 6.771 | 85 | 2.849 | 34 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 44.323 | 1,468 | 31.803 | 1,003 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 30.512 | 793 | 19.604 | 489 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SELECT INCOME REIT | 17.116 | 369 | 11.794 | 249 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 62.86 | 786 | 51.797 | 628 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CYRUSONE INC | 34.229 | 1,929 | 19.132 | 1,076 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WP CAREY INC | 33.193 | 2,172 | 24.015 | 1,540 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 39.987 | 1,381 | 18.939 | 497 |
| | (7.694) | (213) | (-) | (-) |
| GLADSTONE LAND CORP | 6.522 | 85 | 0.996 | 11 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 66.838 | 1,882 | 45.082 | 1,219 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 16.074 | 1,131 | 11.828 | 849 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WHEELER REIT INC | - | - | 0.529 | 2 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 9.738 | 135 | 5.811 | 77 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GRAMERCY PROPERTY TRSUT | 50.351 | 1,347 | 34.113 | 862 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 137.042 | 1,100 | 122.264 | 993 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 59.94 | 1,023 | 35.753 | 577 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 26.252 | 768 | 14.554 | 420 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 85.043 | 1,781 | 55.045 | 1,121 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 28.487 | 280 | 11.76 | 107 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| JBG SMITH PROPERTIES | 28.557 | 966 | 20.845 | 695 |
| | (31.91) | (-) | (-) | (-) |
| MANULIFE US REAL ESTATE-RTS | - | - | 108.24 | 22 |
| | (108.24) | (-) | (-) | (-) |
| INVITATION HOMES INC | 69.605 | 1,557 | 57.488 | 1,262 |
| | (82.512) | (-) | (-) | (-) |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 8.96 | 101 | 3.207 | 34 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FOREST CITY REALTY TRUST INC | 97.419 | 2,269 | 59.084 | 1,326 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PARKWAY INC | 1.4 | 31 | 16.17 | 308 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| QTS REALTY TRUST INC | 14.765 | 680 | 9.839 | 460 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPIRIT MTA REIT | - | - | - | - |
| | (17.097) | (-) | (-) | (-) |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 40.914 | 768 | 27.422 | 508 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 8.484 | 176 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 33.568 | 726 | 26.038 | 556 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 65.197 | 2,321 | 46.922 | 1,666 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 104.435 | 1,814 | 66.086 | 1,059 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------------|-----------|------------|--------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | | 千アメリカ・ドル | | 千アメリカ・ドル |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 5.448 | 52 | 2.446 | 21 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STARWOOD WAYPOINT HOMES | 23 | 815 | 5.107 | 182 |
| | (△51.123) | (-) | (-) | (-) |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC | 4.918 | 51 | 3.502 | 29 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FARMLAND PARTNERS INC | 8.304 | 72 | 3.831 | 28 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CITY OFFICE REIT INC | 10.099 | 123 | 3.736 | 40 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 44.785 | 330 | 30.203 | 205 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CARETRUST REIT INC | 16.96 | 283 | 8.924 | 137 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC | 7.684 | 84 | 65.13 | 778 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 15.187 | 130 | 9.009 | 66 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STORE CAPITAL CORP | 50.443 | 1,251 | 36.114 | 871 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PARAMOUNT GROUP INC | 125.554 | 1,959 | 38.957 | 572 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 8.725 | 80 | 0.447 | 3 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 32.789 | 760 | 22.073 | 491 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INFREAREIT INC | 20.285 | 446 | 4.153 | 78 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 14.977 | 303 | 4.283 | 84 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 31 | 651 | 21.602 | 458 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 3.289 | 79 | 1.427 | 34 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 12.181 | 310 | 5.942 | 143 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 4.283 | 107 | 1.679 | 42 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 79.852 | 1,482 | 42.304 | 784 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLOBAL NET LEASE INC | 18.304 | 365 | 9.533 | 175 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TIER REIT INC | 11.234 | 220 | 7.446 | 141 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 3.36 | 88 | 1.78 | 44 |
| | (△29.92) | (-) | (-) | (-) |
| QUALITY CARE PROPERTIES INC | 25.2 | 409 | 17.593 | 272 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CLIPPER REALTY INC | 5.515 | 61 | 0.346 | 2 |
| | (-) | (△0.24553) | (-) | (-) |
| MANULIFE US REIT | 496.4 | 454 | 190.9 | 176 |
| | (-) | (△8) | (-) | (-) |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 70.737 | 1,957 | 34.638 | 982 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 10.586 | 130 | 7.773 | 92 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 6.495 | 266 | 3.721 | 146 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 16.007 | 379 | 10.781 | 247 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| COLONY NORTHSTAR INC | 171.797 (-) | 1,687 (-) | 150.141 (-) | 1,314 (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | 21.793 (-) | 653 (-) | 15.449 (-) | 454 (-) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 24.262 (-) | 877 (-) | 17.065 (-) | 612 (-) |
| MORGUARD REAL ESTATE INV TR | 8.498 (-) | 117 (-) | 7.302 (-) | 99 (-) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 46.171 (-) | 967 (-) | 33.815 (-) | 698 (-) |
| CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST | 10.604 (△13.699) | 492 (△642) | 8.995 (-) | 406 (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 50.951 (-) | 1,220 (-) | 39.609 (-) | 943 (-) |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 17.319 (-) | 706 (-) | 11.791 (-) | 476 (-) |
| COMINAR REAL ESTATE INV TR | 29.698 (-) | 395 (-) | 21.082 (-) | 286 (-) |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | 14.289 (-) | 306 (-) | 18.536 (-) | 405 (-) |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 5.882 (-) | 138 (-) | 3.836 (-) | 90 (-) |
| ONEREIT | 7.232 (-) | 26 (-) | 17.06 (-) | 71 (-) |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 7.884 (-) | 342 (-) | 6.02 (-) | 260 (-) |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 17.993 (-) | 244 (-) | 13.972 (-) | 190 (-) |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 10.548 (-) | 142 (-) | 6.579 (-) | 86 (-) |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 13 (-) | 124 (-) | 6.586 (-) | 65 (-) |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST | 35.323 (-) | 247 (-) | 80.153 (-) | 641 (-) |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES | - (-) | - (-) | 4.63 (-) | 150 (-) |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 14.546 (-) | 161 (-) | 8.249 (-) | 91 (-) |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 4.016 (-) | 57 (-) | 2.69 (-) | 37 (-) |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28.834 (-) | 357 (-) | 15.739 (-) | 203 (-) |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 12.677 (-) | 120 (-) | 7.559 (-) | 75 (-) |
| AGELLAN COMMERCIAL REIT | 2.13 (-) | 25 (-) | - (-) | - (-) |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 17.406 (-) | 134 (-) | - (-) | - (-) |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7.45 (-) | 377 (-) | 5.313 (-) | 265 (-) |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 50.105 (28.72) | 602 (266) | 36.799 (-) | 433 (-) |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7.046 (-) | 97 (-) | 5.599 (-) | 75 (-) |
| PLAZA RETAIL REIT | - (-) | - (-) | 19.36 (-) | 82 (-) |
| SLATE RETAIL REIT | 4.87 (-) | 60 (-) | 5.021 (-) | 61 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|----------------------------------|-----------|-------------|-----------|-------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SLATE OFFICE REIT | 5.277 | 40 | 4.22 | 31 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KILLAM APARTMENT REIT | 9.773 | 134 | 7.686 | 105 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| BWP TRUST | 149.024 | 452 | 106.871 | 320 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MIRVAC GROUP | 1,127.404 | 2,514 | 821.762 | 1,772 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVESTA OFFICE FUND | 157.303 | 714 | 158.635 | 709 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 469.495 | 484 | 229.645 | 229 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 94.772 | 383 | 65.971 | 257 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASPEN GROUP | - | - | 31.613 | 32 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GPT GROUP | 567.751 | 2,815 | 421.279 | 2,070 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 104.214 | 384 | 64.474 | 233 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 41.666 | 116 | 22.721 | 60 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALE PROPERTY GROUP | 6.83 | 31 | 67.33 | 307 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STOCKLAND | 784.313 | 3,342 | 569.694 | 2,365 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WESTFIELD CORP | 522.039 | 4,388 | 1,173.799 | 10,266 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 34.6 | 93 | 22.733 | 60 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DEXUS | 335.477 | 3,238 | 235.182 | 2,225 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN GROUP | 496.993 | 4,196 | 361.583 | 2,960 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 4.76 | 30 | 22.26 | 152 |
| | (-) | (△7) | (-) | (-) |
| 360 CAPITAL GROUP LTD | - | - | 62.283 | 59 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VICINITY CENTRES | 1,004.506 | 2,625 | 750.089 | 1,967 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL GROUP | 131.84 | 766 | 91.573 | 522 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 45.893 | 146 | 25.998 | 81 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GENERATION HEALTHCARE REIT | - | - | 49.49 | 113 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 219.066 | 502 | 156.174 | 353 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARENA REIT | 57.515 | 128 | 28.969 | 65 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PROPERTYLINK GROUP | 110.27 | 108 | 168.228 | 161 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 31.088 | 130 | 18.627 | 71 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDUSTRIA REIT | 26.972 | 66 | 28.223 | 66 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL STORAGE REIT | 116.261 | 176 | 64.51 | 94 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|---------------------|----------------|------------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 37.167 (-) | 116 (-) | 21.077 (-) | 64 (-) |
| GDI PROPERTY GROUP | 101.652 (-) | 123 (-) | 66.156 (-) | 79 (-) |
| RURAL FUNDS GROUP | 123.27 (-) | 271 (-) | 18.376 (-) | 37 (-) |
| SCENTRE GROUP | 1,641.206 (-) | 6,596 (-) | 1,192.262 (-) | 4,805 (-) |
| VIVA ENERGY REIT | 129.189 (-) | 274 (-) | 86.022 (-) | 175 (-) |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| LINK REIT | 674 (-) | 45,145 (-) | 516 (-) | 34,528 (-) |
| PROSPERITY REIT | 321 (-) | 1,065 (-) | 217 (-) | 714 (-) |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 326 (-) | 1,682 (-) | 196 (-) | 1,007 (-) |
| CHAMPION REIT | 545 (-) | 3,001 (-) | 397 (-) | 2,221 (-) |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 289 (-) | 1,534 (-) | 228 (-) | 1,219 (-) |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 70 (-) | 165 (-) | 331 (-) | 770 (-) |
| FORTUNE REAL ESTATE (HK) | 435 (-) | 4,118 (-) | 323 (-) | 3,040 (-) |
| SPRING REIT | 96 (-) | 332 (-) | 51 (-) | 172 (-) |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND MALL TRUST | 826.7 (-) | 1,695 (-) | 608.9 (-) | 1,237 (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 784 (-) | 2,091 (△9) | 591.7 (-) | 1,576 (-) |
| CACHE LOGISTICS TRUST NEW | 37 (-) | 30 (-) | - (-) | - (-) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST NEW | 84.3 (△84.3) | 139 (-) | - (-) | - (-) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 1,003.969 (84.3) | 1,759 (-) | 688.6 (-) | 1,205 (-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 705.5 (-) | 1,356 (△11) | 622.3 (-) | 1,190 (-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 804.5 (-) | 1,000 (△5) | 443.3 (-) | 559 (-) |
| STARHILL GLOBAL REIT | 317.6 (-) | 240 (△1) | 242.6 (-) | 182 (-) |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 511.2 (-) | 601 (△12) | 369.2 (-) | 434 (-) |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 163.1 (-) | 232 (△4) | 97.7 (-) | 139 (-) |
| KEPPEL REIT | 552.5 (-) | 660 (△1) | 406.8 (-) | 486 (-) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 225.7 (-) | 495 (-) | 171.1 (-) | 377 (-) |
| ESR REIT | 300.63 (-) | 172 (-) | 117.2 (-) | 66 (-) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 254.9 (-) | 421 (△1) | 167.6 (-) | 282 (-) |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 129.9 (-) | 211 (△15) | 134.4 (-) | 215 (-) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 132.4 (-) | 179 (△8) | 82.8 (-) | 113 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|-----------|--------------|---------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT | 186.9 | 261 | 151.9 | 209 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| PARKWAY LIFE REIT | 111.8 | 310 | 73.6 | 206 |
| | (-) | (△3) | (-) | (-) |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 501.2 | 210 | 349.9 | 147 |
| | (-) | (△9) | (-) | (-) |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 379 | 743 | 256.8 | 507 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 653.7 | 1,034 | 441.9 | 701 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CACHE LOGISTICS TRUST | 383.48 | 322 | 290.7 | 243 |
| | (-) | (△0.28574) | (-) | (-) |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 192.3 | 81 | 171 | 69 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 763.5 | 896 | 473.9 | 561 |
| | (-) | (△15) | (-) | (-) |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 219.1 | 183 | 169.9 | 144 |
| | (-) | (△3) | (-) | (-) |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 193 | 136 | 106.4 | 76 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPH REIT | 187.9 | 190 | 196.5 | 197 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OUE HOSPITALITY TRUST | 305.6 | 250 | 211 | 175 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 177.4 | 123 | 137.3 | 92 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST-RTS | - | - | 140.769 | 39 |
| | (140.769) | (-) | (-) | (-) |
| CACHE LOGISTICS TRUST-RTS | - | - | 55.08 | 9 |
| | (55.08) | (-) | (-) | (-) |
| OUE COMMERCIAL REIT | 38.5 | 27 | 234 | 162 |
| | (-) | (△0.702) | (-) | (-) |
| KEPPEL DC REIT | 332.1 | 459 | 196.9 | 269 |
| | (-) | (△0.7104) | (-) | (-) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS-RTS | - | - | 45.4 | 13 |
| | (45.4) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST | 528.55 | 563 | 308.8 | 335 |
| | (-) | (△9) | (-) | (-) |
| ニュージーランド | 千□ | 千ニュージーランド・ドル | 千□ | 千ニュージーランド・ドル |
| PRECINCT PROPERTIES | 355.733 | 458 | 270.777 | 348 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 56.66 | 123 | 42.217 | 88 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 328.247 | 436 | 222.799 | 296 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 458.562 | 624 | 303.609 | 408 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 19.42 | 32 | 171.89 | 278 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 294.439 | 308 | 218.071 | 228 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVESTORE PROPERTY LTD | 35.938 | 49 | 12.181 | 17 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STRIDE STAPLED GROUP | 81.044 | 139 | 51.213 | 87 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 322.608 | 2,064 | 252.896 | 1,619 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 181.045 | 99 | 101.074 | 55 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---|---------------------|-----------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| DERWENT LONDON PLC | 34.42 (-) | 1,000 (-) | 25.713 (-) | 738 (-) |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 43.129 (-) | 361 (-) | 31.544 (-) | 262 (-) |
| HAMMERSON PLC | 247.617 (-) | 1,297 (-) | 184.754 (-) | 938 (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 243.79 (△19.106) | 2,355 (△183) | 177.686 (-) | 1,702 (-) |
| WORKSPACE GROUP PLC | 33.075 (-) | 324 (-) | 22.574 (-) | 222 (-) |
| MCKAY SECURITIES PLC | 8.22 (-) | 18 (-) | 37.28 (-) | 76 (-) |
| MUCKLOW (A & J) GROUP PLC | 2.657 (-) | 13 (-) | 23.12 (-) | 110 (-) |
| INTU PROPERTIES PLC | 283.823 (-) | 640 (-) | 220.269 (-) | 476 (-) |
| UNITE GROUP PLC | 85.375 (-) | 644 (-) | 50.555 (-) | 385 (-) |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 236.878 (-) | 274 (-) | 122.778 (-) | 138 (-) |
| SHAFTESBURY PLC | 85.904 (-) | 851 (-) | 78.012 (-) | 757 (-) |
| SEGRO PLC | 327.879 (-) | 1,882 (-) | 240.125 (-) | 1,374 (-) |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 95.455 (△17.674) | 612 (△124) | 68.182 (-) | 432 (-) |
| ASSURA PLC | 836.837 (-) | 516 (-) | 383.531 (-) | 224 (-) |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | 107.887 (-) | 68 (-) | 57.613 (-) | 35 (-) |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 164.542 (-) | 214 (△57) | 248.879 (-) | 340 (-) |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 62.206 (-) | 296 (-) | 42.918 (-) | 202 (-) |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 186.525 (-) | 332 (-) | 132.499 (-) | 231 (-) |
| RDI REIT PLC | 319.207 (-) | 117 (-) | 238.186 (-) | 85 (-) |
| NEWRIVER REIT PLC | 123.322 (-) | 398 (-) | 73.415 (-) | 218 (-) |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 34.053 (-) | 37 (-) | 25.381 (-) | 27 (-) |
| AEW UK LONG LEASE REIT PLC | 37.06 (-) | 37 (-) | - (-) | - (-) |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 457.502 (-) | 671 (-) | 297.438 (-) | 432 (-) |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 144.289 (-) | 143 (-) | 84.219 (-) | 76 (-) |
| LXI REIT PLC | 64.029 (-) | 66 (-) | 35.069 (-) | 36 (-) |
| REGIONAL REIT LTD | 80.788 (-) | 83 (-) | 43.457 (-) | 43 (-) |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 9.53 (-) | 10 (-) | 58.01 (-) | 57 (-) |
| イスラエル | 千□ | 千イスラエル・シケル | 千□ | 千イスラエル・シケル |
| REIT 1 LTD | 42.547 (-) | 618 (-) | 28.26 (-) | 411 (-) |
| ユーロ (アイルランド) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GREEN REIT PLC | 225.198 (-) | 345 (-) | 164.209 (-) | 249 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|-----------|-------|---------|-------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| ユーロ (アイルランド) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HIBERNIA REIT PLC | 215.595 | 319 | 146.345 | 218 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 73.969 | 106 | 58.083 | 82 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (オランダ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 14.709 | 518 | 10.348 | 365 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VASTNED RETAIL | 6.201 | 242 | 5.667 | 222 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WERELDHAVE NV | 12.278 | 440 | 9.382 | 326 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NSI NV | 4.101 | 138 | 2.583 | 86 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | - | - | - | - |
| | (57.184) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (ベルギー) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| BEFIMMO | 7.34 | 389 | 5.25 | 278 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COFINIMMO SA | 6.576 | 702 | 5.371 | 568 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL ESTATES | 2.398 | 175 | 1.246 | 89 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WERELDHAVE BELGIUM | - | - | 0.78 | 72 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 5.027 | 113 | 2.644 | 59 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WAREHOUSES DE PAUW | 5.023 | 494 | 3.546 | 347 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONTEA SCA | - | - | 2.231 | 98 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AEDIFICA | 5.485 | 426 | 3.848 | 292 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COFINIMMO SA-RTS | - | - | - | - |
| | (8.342) | (-) | (-) | (-) |
| MONTEA SCA-RTS | - | - | 2.231 | 1 |
| | (2.231) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL ESTATES NV-RTS | - | - | 2.623 | 2 |
| | (2.623) | (-) | (-) | (-) |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | - | - | 2.014 | 78 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GECINA SA | 17.827 | 2,533 | 11.246 | 1,637 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ICADE | 13.263 | 1,041 | 9.788 | 782 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALTAREA | 1.265 | 256 | 0.649 | 130 |
| | (-) | (△14) | (-) | (-) |
| KLEPIERRE | 66.513 | 2,277 | 49.646 | 1,688 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COVIVIO | 15.504 | 1,359 | 10.931 | 950 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MERCIALYS | 14.557 | 249 | 11.07 | 189 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 46.03 | 9,123 | 22.756 | 4,523 |
| | (△57.184) | (-) | (-) | (-) |
| GECINA SA-RTS | - | - | 15.11 | 39 |
| | (15.11) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (ドイツ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HAMBORNER REIT AG | 18.169 | 169 | 12.916 | 121 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----------------------|----------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| ユーロ (ドイツ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 57.559 (-) | 715 (△29) | 31.031 (-) | 387 (-) |
| ユーロ (スペイン) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 193.071 (-) | 1,642 (-) | 56.091 (-) | 499 (-) |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 24.223 (-) | 213 (△11) | 14.499 (-) | 132 (-) |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA | 32.598 (-) | 524 (-) | 23.633 (-) | 380 (-) |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 118.664 (-) | 1,373 (△32) | 137.88 (-) | 1,604 (-) |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | 9.903 (-) | 168 (-) | 32.103 (-) | 582 (-) |
| ユーロ (イタリア) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| BENI STABILI SPA | 346.934 (-) | 245 (-) | 252.972 (-) | 180 (-) |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 55.539 (△117.492) | 99 (-) | 30.127 (-) | 26 (-) |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE SIIQ SPA-RTS | - (14.759) | - (-) | 14.759 (-) | 15 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■利害関係人との取引状況等 (2017年6月23日から2018年6月22日まで)

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 |
| 区 分 | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 金 銭 信 託 | 172 | 172 | 100.0 | 172 | 172 | 100.0 |

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、資産管理サービス信託銀行です。

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | |
|--------------------------------|---------|--------|----|---------|----------|-----------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| 不動産ファンド (アメリカ) | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| MANULIFE US REIT | | 206 | | 511.5 | 439 | 48,409 | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 30.95 | | 43.436 | 5,490 | 604,256 | 1.1 |
| ALEXANDER'S INC. | | 1.22 | | 1.606 | 618 | 68,043 | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 52.56 | | 65.092 | 7,965 | 876,582 | 1.6 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | | 25.41 | | 33.531 | 157 | 17,343 | 0.0 |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | | 19.44 | | — | — | — | — |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | | 66.79 | | 84.226 | 2,676 | 294,571 | 0.6 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | | 53.3 | | 66.724 | 2,805 | 308,698 | 0.6 |
| AGREE REALTY CORP | | 9.11 | | 13.167 | 706 | 77,769 | 0.1 |
| SL GREEN | | 34.6 | | 37.248 | 3,732 | 410,734 | 0.8 |
| EPR PROPERTIES | | 21.84 | | 27.43 | 1,794 | 197,451 | 0.4 |
| PROLOGIS INC | | 181.05 | | 224.948 | 14,385 | 1,583,115 | 3.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 47.05 | | 58.29 | 9,904 | 1,089,941 | 2.1 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | | 74.96 | | 91.973 | 814 | 89,677 | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 29.76 | | 39.066 | 3,581 | 394,108 | 0.7 |
| CBL & ASSOCIATES | | 59.39 | | 72.069 | 434 | 47,825 | 0.1 |
| MACK CALI | | 30.33 | | 38.286 | 784 | 86,289 | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | | 50.99 | | 65.269 | 2,811 | 309,437 | 0.6 |
| COUSINS PROPERTIES INC | | 143.17 | | 178.182 | 1,689 | 185,892 | 0.3 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | | 38.72 | | 46.458 | 1,616 | 177,922 | 0.3 |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | | 10.31 | | 12.432 | 279 | 30,769 | 0.1 |
| DDR CORP | | 106.09 | | 64.983 | 1,161 | 127,866 | 0.2 |
| ISTAR INC | | 23.73 | | 28.395 | 315 | 34,748 | 0.1 |
| DUKE REALTY TRUST | | 120.81 | | 150.436 | 4,322 | 475,638 | 0.9 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | | 25.98 | | 39.727 | 281 | 30,953 | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 22.41 | | 27.845 | 6,532 | 718,925 | 1.4 |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 125.37 | | 155.294 | 9,761 | 1,074,283 | 2.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | | 24.54 | | 30.863 | 3,817 | 420,109 | 0.8 |
| FIRST INDUSTRIAL RT | | 40.15 | | 52.771 | 1,745 | 192,110 | 0.4 |
| GGP INC | | 199.09 | | 266.85 | 5,537 | 609,361 | 1.1 |
| FELCOR LODGING TR INC | | 42.87 | | — | — | — | — |
| HCP INC | | 160.11 | | 198.084 | 4,876 | 536,694 | 1.0 |
| EQUITY COMMONWEALTH | | 42.44 | | 51.112 | 1,603 | 176,508 | 0.3 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | | 39.731 | | 52.993 | 1,510 | 166,208 | 0.3 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | | 34.637 | | 43.81 | 2,186 | 240,582 | 0.5 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | | 55.985 | | 69.715 | 1,969 | 216,737 | 0.4 |
| WELLTOWER INC | | 125.02 | | 156.947 | 9,228 | 1,015,594 | 1.9 |
| EAST GROUP | | 11.48 | | 14.741 | 1,383 | 152,231 | 0.3 |
| KIMCO REALTY | | 144.51 | | 179.68 | 3,126 | 344,063 | 0.6 |
| KILROY REALTY CORP | | 33.37 | | 41.605 | 3,127 | 344,221 | 0.6 |
| LTC PROPERTIES INC | | 13.29 | | 16.835 | 711 | 78,350 | 0.1 |
| SENIOR HOUSING PPTY TRUST | | 80.937 | | 100.809 | 1,804 | 198,583 | 0.4 |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | | 24.51 | | 33.032 | 521 | 57,363 | 0.1 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | | 50.04 | | 62.537 | 2,749 | 302,541 | 0.6 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | | 60.02 | | 74.331 | 1,226 | 134,972 | 0.3 |
| IRON MOUNTAIN INC | | 83.42 | | 118.572 | 4,114 | 452,795 | 0.9 |
| THE MACERICH COMPANY | | 40.72 | | 45.998 | 2,631 | 289,550 | 0.5 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | | 27.71 | | 37.342 | 3,403 | 374,579 | 0.7 |
| ACADIA REALTY TRUST | | 29.32 | | 34.26 | 960 | 105,757 | 0.2 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | | 252.82 | | 312.724 | 6,764 | 744,402 | 1.4 |
| MID AMERICA | | 38.83 | | 47.941 | 4,738 | 521,417 | 1.0 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | | 14.45 | | 15.638 | 333 | 36,742 | 0.1 |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | | 14.01 | | 17.625 | 1,313 | 144,502 | 0.3 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | | 42.12 | | 50.011 | 297 | 32,692 | 0.1 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | | 5.68 | | 6.553 | 174 | 19,247 | 0.0 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | | 23.2 | | 29.416 | 339 | 37,390 | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | |
|----------------------------------|---------|--------|----|---------|----------|-----------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (アメリカ) | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| GETTY REALTY CORP | | 9.05 | | 13,326 | 362 | 39,918 | 0.1 |
| PS BUSINESS PARKS | | 6.76 | | 8,446 | 1,066 | 117,347 | 0.2 |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | | 26.53 | | 33,773 | 432 | 47,648 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | | 93.31 | | 119,894 | 6,416 | 706,160 | 1.3 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 49.68 | | 62,085 | 3,805 | 418,761 | 0.8 |
| UDR INC | | 90.85 | | 113,114 | 4,167 | 458,591 | 0.9 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | | 33.78 | | 42,988 | 1,205 | 132,652 | 0.2 |
| CORECIVIC INC | | 40.28 | | 50,174 | 1,130 | 124,402 | 0.2 |
| SAUL CENTERS INC | | 4.07 | | 5,042 | 260 | 28,697 | 0.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 106.55 | | 130,666 | 22,145 | 2,437,087 | 4.6 |
| LIFE STORAGE INC | | 15.91 | | 19,733 | 1,890 | 208,084 | 0.4 |
| PUBLIC STORAGE | | 51.04 | | 63,208 | 14,022 | 1,543,128 | 2.9 |
| SUN COMMUNITIES INC | | 24.074 | | 33,726 | 3,251 | 357,830 | 0.7 |
| TAUBMAN CENTERS INC | | 20.71 | | 25,845 | 1,535 | 168,947 | 0.3 |
| TANGER FACTORY OUTLET | | 33.3 | | 40,143 | 933 | 102,756 | 0.2 |
| UMH PROPERTIES INC | | 9.33 | | 14,882 | 218 | 24,058 | 0.0 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | | 8.67 | | 12,671 | 238 | 26,285 | 0.0 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | | 4.32 | | 5,259 | 351 | 38,637 | 0.1 |
| VENTAS INC | | 121.18 | | 150,254 | 8,271 | 910,276 | 1.7 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 58.86 | | 73,134 | 5,348 | 588,579 | 1.1 |
| WASHINGTON REIT | | 25.86 | | 33,313 | 984 | 108,296 | 0.2 |
| GEO GROUP INC | | 42.04 | | 51,638 | 1,345 | 148,092 | 0.3 |
| WEINGARTEN REALTY INVST | | 40.33 | | 50,686 | 1,583 | 174,312 | 0.3 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | | 45.84 | | 57,893 | 2,479 | 272,875 | 0.5 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | | 28.99 | | 35,532 | 618 | 68,039 | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | | 42.77 | | 53,193 | 5,302 | 583,574 | 1.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | | 37.34 | | 44,756 | 371 | 40,880 | 0.1 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | | 75.33 | | 95,603 | 1,613 | 177,596 | 0.3 |
| CUBESMART | | 61.435 | | 77,311 | 2,466 | 271,407 | 0.5 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 54.58 | | 86,876 | 9,318 | 1,025,481 | 1.9 |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | | 25.09 | | 32,161 | 1,299 | 143,023 | 0.3 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | | 67.56 | | 85,121 | 1,051 | 115,689 | 0.2 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | | 124.44 | | 154,694 | 2,178 | 239,698 | 0.5 |
| DOUGLAS EMMETT INC | | 50.21 | | 67.6 | 2,707 | 297,947 | 0.6 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | | 31.317 | | 39,742 | 2,593 | 285,421 | 0.5 |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC | | 26.432 | | — | — | — | — |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | | 37.86 | | 47,738 | 926 | 101,971 | 0.2 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | | 49.79 | | 54,405 | 1,066 | 117,410 | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | | 35.63 | | 44,281 | 638 | 70,221 | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP | | 17.2 | | 23,552 | 879 | 96,781 | 0.2 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | | 14.067 | | 17,616 | 670 | 73,745 | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | | 42.95 | | 74,135 | 1,676 | 184,546 | 0.3 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | | — | | 19.99 | 444 | 48,947 | 0.1 |
| CORESITE REALTY CORP | | 11.61 | | 14,529 | 1,605 | 176,680 | 0.3 |
| VEREIT INC | | 330.79 | | 407,682 | 3,008 | 331,106 | 0.6 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | | 20.88 | | 25.52 | 818 | 90,067 | 0.2 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | | 23.78 | | 29,264 | 1,158 | 127,531 | 0.2 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRU | | 24.56 | | 42,132 | 618 | 68,065 | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES | | 10.21 | | 16,134 | 249 | 27,485 | 0.1 |
| CHATHAM LODGING TRUST | | 13.28 | | 19,517 | 400 | 44,073 | 0.1 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | | 22.66 | | 75.62 | 1,614 | 177,674 | 0.3 |
| WHITESTONE REIT | | 13.92 | | 17,842 | 219 | 24,190 | 0.0 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | | 53.35 | | 65.87 | 2,295 | 252,627 | 0.5 |
| STAG INDUSTRIAL INC | | 29.95 | | 40,858 | 1,102 | 121,358 | 0.2 |
| SELECT INCOME REIT | | 22.03 | | 27,352 | 598 | 65,890 | 0.1 |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | | 81.21 | | 92,273 | 1,200 | 132,111 | 0.2 |
| CYRUSONE INC | | 26.659 | | 41,756 | 2,423 | 266,662 | 0.5 |
| WP CAREY INC | | 36.16 | | 45,338 | 2,981 | 328,106 | 0.6 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | | — | | 28,742 | 617 | 67,942 | 0.1 |
| GLADSTONE LAND CORP | | — | | 5,526 | 69 | 7,595 | 0.0 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|----------------------------------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----|------|
| | □ 数 | □ 数 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 率 | 率 |
| (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | | % |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 65.147 | 86.903 | 2,288 | 251,811 | | 0.5 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 17.47 | 21,716 | 1,797 | 197,783 | | 0.4 |
| WHEELER REIT INC | 3.49 | 2,961 | 11 | 1,215 | | 0.0 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 15.26 | 19,187 | 290 | 31,989 | | 0.1 |
| GRAMERCY PROPERTY TRSUT | 51.92 | 68,158 | 1,883 | 207,246 | | 0.4 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 165.52 | 180,298 | 1,498 | 164,885 | | 0.3 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 51.88 | 76,067 | 1,219 | 134,189 | | 0.3 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 22.37 | 34,068 | 1,064 | 117,124 | | 0.2 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 80.34 | 110,338 | 2,408 | 265,075 | | 0.5 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 19.27 | 35,997 | 371 | 40,921 | | 0.1 |
| JBG SMITH PROPERTIES | — | 39,622 | 1,484 | 163,340 | | 0.3 |
| INVITATION HOMES INC | 26.32 | 120,949 | 2,734 | 300,948 | | 0.6 |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 7.39 | 13,143 | 139 | 15,331 | | 0.0 |
| FOREST CITY REALTY TRUST INC | 74.8 | 113,135 | 2,607 | 286,984 | | 0.5 |
| PARKWAY INC | 14.77 | — | — | — | | — |
| QTS REALTY TRUST INC | 16.55 | 21,476 | 846 | 93,119 | | 0.2 |
| SPIRIT MTA REIT | — | 17,097 | 178 | 19,643 | | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 42.45 | 55,942 | 956 | 105,274 | | 0.2 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | — | 8,484 | 192 | 21,175 | | 0.0 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 42.2 | 49,73 | 1,119 | 123,247 | | 0.2 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | 66.43 | 84,705 | 2,980 | 328,033 | | 0.6 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 89.202 | 127,551 | 2,247 | 247,331 | | 0.5 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 10.9 | 13,902 | 148 | 16,324 | | 0.0 |
| STARWOOD WAYPOINT HOMES | 33.23 | — | — | — | | — |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT | 7.5 | 8,916 | 81 | 8,958 | | 0.0 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 10.05 | 14,523 | 131 | 14,496 | | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | 8.1 | 14,463 | 182 | 20,038 | | 0.0 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 64.37 | 78,952 | 648 | 71,333 | | 0.1 |
| CARETRUST REIT INC | 24.33 | 32,366 | 542 | 59,732 | | 0.1 |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC | 57.446 | — | — | — | | — |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 28.4 | 34,578 | 261 | 28,730 | | 0.1 |
| STORE CAPITAL CORP | 58.22 | 72,549 | 1,970 | 216,845 | | 0.4 |
| PARAMOUNT GROUP INC | — | 86,597 | 1,336 | 147,047 | | 0.3 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | — | 8,278 | 76 | 8,381 | | 0.0 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 34.22 | 44,936 | 1,022 | 112,552 | | 0.2 |
| INFRAREIT INC | — | 16,132 | 347 | 38,240 | | 0.1 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I | 8 | 18,694 | 363 | 40,013 | | 0.1 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 35.9 | 45,298 | 1,132 | 124,626 | | 0.2 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 5.9 | 7,762 | 210 | 23,200 | | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS | 15.13 | 21,369 | 634 | 69,797 | | 0.1 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 4.37 | 6,974 | 203 | 22,402 | | 0.0 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 53.59 | 91,138 | 1,676 | 184,446 | | 0.3 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 19.85 | 28,621 | 566 | 62,333 | | 0.1 |
| TIER REIT INC | 16.54 | 20,328 | 487 | 53,667 | | 0.1 |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 28.34 | — | — | — | | — |
| QUALITY CARE PROPERTIES INC | 32.229 | 39,836 | 874 | 96,183 | | 0.2 |
| CLIPPER REALTY INC | — | 5,169 | 44 | 4,863 | | 0.0 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 49.2 | 85,299 | 2,670 | 293,911 | | 0.6 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 18.7 | 21,513 | 313 | 34,541 | | 0.1 |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 8.23 | 11,004 | 475 | 52,375 | | 0.1 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 20.78 | 26,006 | 611 | 67,256 | | 0.1 |
| COLONY NORTHSTAR INC | 186.96 | 208,616 | 1,339 | 147,391 | | 0.3 |
| 小 計 | □ 数 | □ 数 | 金額 | 金額 | | 率 |
| | 7,585,978 | 9,953,908 | 344,188 | 37,877,928 | | 71.3 |
| (カナダ) | □ 数 | □ 数 | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| SMARTCENTRES REIT | 21.51 | 27,854 | 845 | 69,937 | | 0.1 |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 22.39 | 29,587 | 1,275 | 105,497 | | 0.2 |
| MORGUARD REAL ESTATE INVT TR | 8.82 | 10,016 | 133 | 11,037 | | 0.0 |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 48.3 | 60,656 | 1,237 | 102,368 | | 0.2 |
| CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST | 12.09 | — | — | — | | — |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|----------------------------------|------------|------------|-------------|-----------|---|-----|
| | □ 数 | 金額 | □ 数 | 金額 | 比 | 率 |
| (カナダ) | 千口 | 千口 | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 54 | 65,342 | 1,585 | 131,197 | | 0.2 |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 13.99 | 19,518 | 827 | 68,464 | | 0.1 |
| COMINAR REAL ESTATE INVNT TR | 29.93 | 38,546 | 492 | 40,722 | | 0.1 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | 16.71 | 12,463 | 296 | 24,508 | | 0.0 |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 8.05 | 10,096 | 262 | 21,691 | | 0.0 |
| ONEREIT | 9.828 | — | — | — | | — |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 7.917 | 9,781 | 450 | 37,230 | | 0.1 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 26.12 | 30,141 | 402 | 33,314 | | 0.1 |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 14.08 | 18,049 | 235 | 19,501 | | 0.0 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 13.7 | 20,114 | 219 | 18,121 | | 0.0 |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUS | 44.83 | — | — | — | | — |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERT | 4.63 | — | — | — | | — |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 14.84 | 21,137 | 239 | 19,829 | | 0.0 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT | 6.12 | 7,446 | 113 | 9,418 | | 0.0 |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM | 24.14 | 37,235 | 541 | 44,820 | | 0.1 |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 8.77 | 13,888 | 143 | 11,845 | | 0.0 |
| AGELLAN COMMERCIAL REIT | 4.9 | 7,03 | 93 | 7,775 | | 0.0 |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | — | 17,406 | 150 | 12,484 | | 0.0 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | 7.78 | 9,917 | 535 | 44,262 | | 0.1 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 16.32 | 58,346 | 707 | 58,502 | | 0.1 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11.277 | 12,724 | 165 | 13,695 | | 0.0 |
| PLAZA RETAIL REIT | 19.36 | — | — | — | | — |
| SLATE RETAIL REIT | 7.89 | 7,739 | 100 | 8,323 | | 0.0 |
| SLATE OFFICE REIT | 11.022 | 12,079 | 92 | 7,634 | | 0.0 |
| KILLAM APARTMENT REIT | 13.28 | 15,367 | 230 | 19,069 | | 0.0 |
| 小 計 | 502,594 | 572,477 | 11,377 | 941,254 | | — |
| 小 計 | 29銘柄<1.8%> | 25銘柄<1.8%> | — | — | | 1.8 |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | % |
| BWP TRUST | 163.73 | 205,883 | 681 | 55,417 | | 0.1 |
| MIRVAC GROUP | 1,256.98 | 1,562,622 | 3,500 | 284,642 | | 0.5 |
| INVESTA OFFICE FUND | 212.77 | 211,438 | 1,103 | 89,753 | | 0.2 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 434.98 | 674.83 | 755 | 61,462 | | 0.1 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 111.64 | 140,441 | 610 | 49,679 | | 0.1 |
| ASPEN GROUP | 31.613 | — | — | — | | — |
| GPT GROUP | 614.9 | 761,372 | 3,966 | 322,575 | | 0.6 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 97.7 | 137.44 | 540 | 43,924 | | 0.1 |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 69.61 | 88,555 | 239 | 19,515 | | 0.0 |
| ALE PROPERTY GROUP | 60.5 | — | — | — | | — |
| STOCKLAND | 816.67 | 1,031,289 | 4,310 | 350,553 | | 0.7 |
| WESTFIELD CORP | 651.76 | — | — | — | | — |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 73.368 | 85,235 | 231 | 18,853 | | 0.0 |
| DEXUS | 328.88 | 429,175 | 4,308 | 350,401 | | 0.7 |
| GOODMAN GROUP | 540.98 | 676.39 | 6,703 | 545,089 | | 1.0 |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 17.5 | — | — | — | | — |
| 360 CAPITAL GROUP LTD | 62.283 | — | — | — | | — |
| VICINITY CENTRES | 1,108.8 | 1,363,217 | 3,680 | 299,313 | | 0.6 |
| CHARTER HALL GROUP | 156.43 | 196,697 | 1,298 | 105,569 | | 0.2 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 84.27 | 104,165 | 380 | 30,918 | | 0.1 |
| GENERATION HEALTHCARE REIT | 49.49 | — | — | — | | — |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 244.21 | 307,102 | 773 | 62,933 | | 0.1 |
| ARENA REIT | 80.13 | 108,676 | 240 | 19,530 | | 0.0 |
| PROPERTYLINK GROUP | 209.18 | 151,222 | 161 | 13,158 | | 0.0 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 60.04 | 72,501 | 321 | 26,118 | | 0.0 |
| INDUSTRIA REIT | 43.83 | 42,579 | 110 | 8,967 | | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 172.15 | 223,901 | 364 | 29,678 | | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 46.56 | 62.65 | 208 | 16,965 | | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP | 173.07 | 208,566 | 272 | 22,133 | | 0.0 |
| RURAL FUNDS GROUP | — | 104,894 | 222 | 18,083 | | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | 1,810.29 | 2,259,234 | 9,850 | 801,023 | | 1.5 |
| VIVA ENERGY REIT | 140.57 | 183,737 | 400 | 32,572 | | 0.1 |
| 小 計 | 9,924,884 | 11,393,811 | 45,238 | 3,678,834 | | — |
| 小 計 | 31銘柄<8.1%> | 26銘柄<6.9%> | — | — | | 6.9 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------|------------|------------|--------------|-----------|-----|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (香港) | 千口 | 千円 | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | % |
| LINK REIT | 752.52 | | 910.52 | 63,235 | 887,195 | 1.7 |
| PROSPERITY REIT | 418 | | 522 | 1,680 | 23,582 | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | 362 | | 492 | 2,646 | 37,136 | 0.1 |
| CHAMPION REIT | 723.07 | | 871.07 | 4,703 | 65,994 | 0.1 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | 342 | | 403 | 2,188 | 30,701 | 0.1 |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 261 | | — | — | — | — |
| FORTUNE REAL ESTATE (HK) | 476 | | 588 | 5,468 | 76,721 | 0.1 |
| SPRING REIT | 306 | | 351 | 1,168 | 16,398 | 0.0 |
| 小計 | 3,640.59 | 4,137.59 | 4,137.59 | 81,092 | 1,137,730 | — |
| | 8銘柄<2.0%> | | 7銘柄<2.1%> | | | 2.1 |
| (シンガポール) | 千口 | 千円 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| CAPITALAND MALL TRUST | 918.96 | | 1,136.76 | 2,318 | 188,000 | 0.4 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 822.06 | | 1,014.36 | 2,647 | 214,631 | 0.4 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 733.01 | | 1,132.679 | 1,857 | 150,595 | 0.3 |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 869.59 | | 952.79 | 1,600 | 129,767 | 0.2 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 515.02 | | 876.22 | 1,068 | 86,662 | 0.2 |
| STARHILL GLOBAL REIT | 475.5 | | 550.5 | 357 | 29,008 | 0.1 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 406.015 | | 548.015 | 597 | 48,426 | 0.1 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 205.48 | | 270.88 | 368 | 29,865 | 0.1 |
| KEPPEL REIT | 624 | | 769.7 | 846 | 68,639 | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 193 | | 247.6 | 542 | 43,959 | 0.1 |
| ESR REIT | 356 | | 539.43 | 261 | 21,209 | 0.0 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 227 | | 314.3 | 509 | 41,278 | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 239.08 | | 234.58 | 344 | 27,955 | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 187 | | 236.6 | 319 | 25,894 | 0.0 |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT | 200.095 | | 235.095 | 326 | 26,492 | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REIT | 129.5 | | 167.5 | 434 | 35,212 | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU | 647 | | 798.3 | 251 | 20,386 | 0.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 402.02 | | 524.22 | 996 | 80,747 | 0.2 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 600 | | 811.8 | 1,250 | 101,351 | 0.2 |
| CACHE LOGISTICS TRUST | 306 | | 435.78 | 326 | 26,496 | 0.0 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 335.9 | | 357.2 | 155 | 12,596 | 0.0 |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 623 | | 912.6 | 1,040 | 84,342 | 0.2 |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 268 | | 317.2 | 242 | 19,672 | 0.0 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 273 | | 359.6 | 230 | 18,657 | 0.0 |
| SPH REIT | 274 | | 265.4 | 264 | 21,408 | 0.0 |
| OUE HOSPITALITY TRUST | 394.02 | | 488.62 | 383 | 31,095 | 0.1 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 236 | | 276.1 | 178 | 14,437 | 0.0 |
| OUE COMMERCIAL REIT | 195.5 | | — | — | — | — |
| KEPPEL DC REIT | 267 | | 402.2 | 538 | 43,692 | 0.1 |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL T | 353 | | 572.75 | 595 | 48,290 | 0.1 |
| 小計 | 12,275.75 | 15,748.979 | 15,748.979 | 20,855 | 1,690,774 | — |
| | 30銘柄<3.1%> | | 29銘柄<3.2%> | | | 3.2 |
| (ニュージーランド) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | % |
| PRECINCT PROPERTIES | 338.74 | | 423.696 | 561 | 42,486 | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 115.5 | | 129.943 | 264 | 20,012 | 0.0 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 336 | | 441.448 | 635 | 48,108 | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 452 | | 606.953 | 819 | 62,011 | 0.1 |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 152.47 | | — | — | — | — |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 280.51 | | 356.878 | 387 | 29,304 | 0.1 |
| INVESTORE PROPERTY LTD | 65.12 | | 88.877 | 131 | 9,954 | 0.0 |
| STRIDE STAPLED GROUP | 119.27 | | 149.101 | 275 | 20,875 | 0.0 |
| 小計 | 1,859.61 | 2,196.896 | 2,196.896 | 3,075 | 232,753 | — |
| | 8銘柄<0.5%> | | 7銘柄<0.4%> | | | 0.4 |
| (イギリス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| BRITISH LAND CO PLC | 349.88 | | 419.592 | 2,848 | 415,607 | 0.8 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 149.76 | | 229.731 | 119 | 17,398 | 0.0 |
| DERWENT LONDON PLC | 37.83 | | 46.537 | 1,423 | 207,658 | 0.4 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 51.7 | | 63.285 | 586 | 85,511 | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | 270.65 | | 333.513 | 1,770 | 258,417 | 0.5 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|-------------------------|-------------------------|------------|-----------|----|-----|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| (イギリス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | % |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 270.14 | 317,138 | 2,991 | 436,482 | 0.8 | | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 40.31 | 50,811 | 556 | 81,187 | 0.2 | | |
| MCKAY SECURITIES PLC | 29.06 | — | — | — | — | | |
| MUCKLOW (A & J) GROUP PLC | 20.463 | — | — | — | — | | |
| INTU PROPERTIES PLC | 308.69 | 372,244 | 707 | 103,203 | 0.2 | | |
| UNITE GROUP PLC | 77.1 | 111.92 | 931 | 135,958 | 0.3 | | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 198.84 | 312.94 | 357 | 52,148 | 0.1 | | |
| SHAFTESBURY PLC | 95.12 | 103,012 | 960 | 140,168 | 0.3 | | |
| SEGRO PLC | 337.27 | 425,024 | 2,805 | 409,328 | 0.8 | | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 110.3 | 119,899 | 853 | 124,586 | 0.2 | | |
| ASSURA PLC | 560.02 | 1,013,326 | 585 | 85,465 | 0.2 | | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT | 171.09 | 221,364 | 137 | 20,026 | 0.0 | | |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 251.91 | 167,573 | 177 | 25,968 | 0.0 | | |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 70.06 | 89,348 | 469 | 68,447 | 0.1 | | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 241.3 | 295,326 | 549 | 80,154 | 0.2 | | |
| RDI REIT PLC | 447.86 | 528,881 | 183 | 26,779 | 0.1 | | |
| NEWRIVER REIT PLC | 81.127 | 131,034 | 354 | 51,720 | 0.1 | | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 72.808 | 81.48 | 83 | 12,186 | 0.0 | | |
| AEW UK LONG LEASE REIT PLC | — | 37.06 | 33 | 4,953 | 0.0 | | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 466.886 | 626.95 | 955 | 139,422 | 0.3 | | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 168.53 | 228.6 | 200 | 29,221 | 0.1 | | |
| LXI REIT PLC | 44.44 | 73.4 | 81 | 11,888 | 0.0 | | |
| REGIONAL REIT LTD | 80.97 | 118,301 | 111 | 16,330 | 0.0 | | |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 48.48 | — | — | — | — | | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 5,052,594 28銘柄<5.4%> | 6,518,289 26銘柄<5.7%> | 20,834 | 3,040,225 | — | 5.7 |
| (イスラエル) | 千口 | 千円 | 千口 | 千イスラエル・シケル | 千円 | | % |
| REIT 1 LTD | 56 | 70,287 | 991 | 30,098 | 0.1 | | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 56 1銘柄<0.1%> | 70,287 1銘柄<0.1%> | 991 | 30,098 | — | 0.1 |
| (ユーロ…アイルランド) | 千口 | 千円 | 千ユーロ | 千円 | | | % |
| GREEN REIT PLC | 232.64 | 293,629 | 444 | 56,787 | 0.1 | | |
| HIBERNIA REIT PLC | 230.28 | 299,53 | 461 | 58,923 | 0.1 | | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI | 122.99 | 138,876 | 191 | 24,410 | 0.0 | | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 585.91 3銘柄<0.2%> | 732,035 3銘柄<0.3%> | 1,096 | 140,121 | — | 0.3 |
| (ユーロ…オランダ) | 千口 | 千円 | 千ユーロ | 千円 | | | % |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 16.763 | 21,124 | 765 | 97,789 | 0.2 | | |
| VASTNED RETAIL | 6.26 | 6,794 | 276 | 35,365 | 0.1 | | |
| WERELDHAVE NV | 13.92 | 16,816 | 558 | 71,294 | 0.1 | | |
| NSI NV | 6.107 | 7,625 | 271 | 34,626 | 0.1 | | |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | — | 57,184 | 10,796 | 1,379,124 | 2.6 | | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 43.05 4銘柄<0.5%> | 109,543 5銘柄<3.0%> | 12,667 | 1,618,200 | — | 3.0 |
| (ユーロ…ベルギー) | 千口 | 千円 | 千ユーロ | 千円 | | | % |
| BEFIMMO | 7.71 | 9.8 | 507 | 64,845 | 0.1 | | |
| COFINIMMO SA | 7 | 8,205 | 849 | 108,479 | 0.2 | | |
| RETAIL ESTATES | 2.08 | 3,232 | 245 | 31,377 | 0.1 | | |
| WERELDHAVE BELGIUM | 0.78 | — | — | — | — | | |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 4.49 | 6,873 | 150 | 19,183 | 0.0 | | |
| WAREHOUSES DE PAUW | 5.56 | 7,037 | 757 | 96,722 | 0.2 | | |
| MONTEA SCA | 2.231 | — | — | — | — | | |
| AEDIFICA | 6.01 | 7,647 | 596 | 76,192 | 0.1 | | |
| COFINIMMO SA-RTS | — | 8,342 | 5 | 745 | 0.0 | | |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 2.014 | — | — | — | — | | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 37.875 9銘柄<0.8%> | 51,136 7銘柄<0.7%> | 3,112 | 397,546 | — | 0.7 |
| (ユーロ…フランス) | 千口 | 千円 | 千ユーロ | 千円 | | | % |
| GECINA SA | 13.68 | 20,261 | 2,917 | 372,692 | 0.7 | | |
| ICADE | 15.46 | 18,935 | 1,529 | 195,314 | 0.4 | | |

| 銘柄 | 柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------|-------|------------|------|
| | | □数 | 金額 | □数 | 外貨建金額 | □数 | 比率 |
| (ユーロ…フランス) | | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| ALTEA | | 0.902 | 1,518 | 303 | 303 | 38,781 | 0.1 |
| KLEPIERRE | | 70.45 | 87,317 | 2,861 | 2,861 | 365,512 | 0.7 |
| COVIVIO | | 18.09 | 22,663 | 2,010 | 2,010 | 256,783 | 0.5 |
| MERCIALYS | | 19.06 | 22,547 | 337 | 337 | 43,058 | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | | 33.91 | — | — | — | — | — |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 171,552 | 173,241 | 9,958 | — | 1,272,143 | — |
| | | 7銘柄<4.5%> | 6銘柄<2.4%> | — | — | — | 2.4 |
| (ユーロ…ドイツ) | | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| HAMBORNER REIT AG | | 27.89 | 33,143 | 302 | 302 | 38,653 | 0.1 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | | 34.83 | 61,358 | 789 | 789 | 100,873 | 0.2 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 62.72 | 94,501 | 1,092 | — | 139,526 | — |
| | | 2銘柄<0.2%> | 2銘柄<0.3%> | — | — | — | 0.3 |
| (ユーロ…スペイン) | | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | | — | 136.98 | 1,292 | 1,292 | 165,091 | 0.3 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | | 30 | 39,724 | 373 | 373 | 47,698 | 0.1 |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS S | | 37.214 | 46,179 | 815 | 815 | 104,233 | 0.2 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 159.33 | 140,114 | 1,742 | 1,742 | 222,563 | 0.4 |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | | 22.2 | — | — | — | — | — |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 248,744 | 362,997 | 4,224 | — | 539,588 | — |
| | | 4銘柄<0.8%> | 4銘柄<1.0%> | — | — | — | 1.0 |
| (ユーロ…イタリア) | | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| BENI STABILI SPA | | 343.798 | 437.76 | 327 | 327 | 41,827 | 0.1 |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | | 112.11 | 20.03 | 138 | 138 | 17,662 | 0.0 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 455,908 | 457.79 | 465 | — | 59,489 | — |
| | | 2銘柄<0.1%> | 2銘柄<0.1%> | — | — | — | 0.1 |
| 合計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 42,503.759 | 52,573.48 | — | — | 52,796,215 | — |
| | | 324銘柄<99.7%> | 311銘柄<99.3%> | — | — | — | 99.3 |

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

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

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

■投資信託財産の構成

2018年6月22日現在

| 項目 | 当期 | | 末 |
|---------------|------------|----|-------|
| | 評価額 | 比率 | 率 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 千円 | | % |
| | 52,796,215 | | 98.9 |
| コール・ローン等、その他 | 589,533 | | 1.1 |
| 投資信託財産総額 | 53,385,749 | | 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、53,059,037千円、99.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.05円、1カナダ・ドル=82.73円、1オーストラリア・ドル=81.32円、1香港・ドル=14.03円、1シンガポール・ドル=81.07円、1ニュージーランド・ドル=75.68円、1イギリス・ポンド=145.92円、1イスラエル・シケル=30.37円、1ユーロ=127.74円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年6月22日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 53,466,516,162円 |
| コ ー ル ・ オ ー ン 等 | 379,841,373 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 5,388,679,098 |
| 投 資 証 券(評価額) | 47,407,536,710 |
| 未 収 入 金 | 169,047,927 |
| 未 収 配 当 金 | 121,411,054 |
| (B) 負 債 | 318,147,369 |
| 未 払 金 | 251,515,859 |
| 未 払 解 約 金 | 66,631,000 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 510 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 53,148,368,793 |
| 元 本 | 44,369,434,317 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 8,778,934,476 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 44,369,434,317口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 11,979円 |

(注1) 期首元本額 36,552,926,130円
 追加設定元本額 37,479,419,659円
 一部解約元本額 29,662,911,472円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 先進REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ) | 245,527,822円 |
| 先進REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ) | 91,474,091円 |
| MITOラップ型ファンド(安定型) | 5,130,167円 |
| MITOラップ型ファンド(中立型) | 21,023,866円 |
| MITOラップ型ファンド(積極型) | 39,112,610円 |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 32,207,993円 |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 46,451,021円 |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 40,574,657円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 2,249,741,895円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> | 527,252,879円 |
| たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> | 136,977,197円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 72,728,227円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 431,494円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 8,548,879円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 35,028,585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) | 3,112,712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) | 16,632,656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) | 13,804,156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) | 41,020,013円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型) | 81,563円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型) | 935,693円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型) | 1,071,075円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型) | 3,601,721円 |
| マネックス資産設計ファンド(隔月分配型) | 23,851,883円 |
| マネックス資産設計ファンド(育成型) | 605,308,573円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 64,548,816円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10) | 32,336,199円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20) | 105,134,229円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30) | 226,501,981円 |
| 投資のソムリエ | 6,010,068,047円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 447,339,832円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 119,857,868円 |

| | |
|---|-----------------|
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 208,844,575円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 282,304円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 3,975,491,712円 |
| ワールドアセットバランス(基本コース) | 1,383,436,091円 |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース) | 5,622,314,658円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045) | 1,662,810円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055) | 1,086,741円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC) | 1,012,144円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035) | 2,411,427円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 134,661,724円 |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド | 1,192,999,535円 |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金> | 26,726,865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) | 1,406,624,195円 |
| DIAMグローバルβ私募ファンド(適格機関投資家向け) | 11,580,328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) | 11,102,663,617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) | 2,154,006,440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) | 1,669,544,120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) | 3,647,231,593円 |
| DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定) | 559,435,038円 |
| 期末元本合計 | 44,369,434,317円 |

■損益の状況

当期 自2017年6月23日 至2018年6月22日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 2,019,083,051 | 円 |
| | 受取配当 | 2,018,183,517 | |
| | 受取利息 | 1,117,924 | |
| | その他の収益 | 1,415 | |
| | 支払利息 | △219,805 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | △1,304,484,815 | |
| | 売買益 | 2,874,742,828 | |
| | 売買損 | △4,179,227,643 | |
| (C) | その他の費用 | △34,678,818 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 679,919,418 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 6,470,248,917 | |
| (F) | 解約差損益金 | △4,324,322,200 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 5,953,088,341 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 8,778,934,476 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 8,778,934,476 | |

(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》

■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)

DIAMマネーマザーファンド

運用報告書

第9期（決算日 2018年4月5日）

（計算期間 2017年4月6日～2018年4月5日）

DIAMマネーマザーファンドの第9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 | 2009年10月29日から無期限です。 |
| 運用方針 | 安定した収益の確保をめざします。 |
| 主要投資対象 | 国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建て資産への投資は行いません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 債券 組入比率 | 新株予約権 付社債 (転換社債) | 債券 先物比率 | 純資産 総額 |
|---------------|--------|----------|------------|------------------------|------------|---------------|
| | 円 | 騰落 中率 | | | | |
| 5期(2014年4月7日) | 10,080 | 0.1 | 93.9 | — | — | 百万円 10,998 |
| 6期(2015年4月6日) | 10,090 | 0.1 | 82.8 | — | — | 9,524 |
| 7期(2016年4月5日) | 10,098 | 0.1 | 80.6 | — | — | 3,158 |
| 8期(2017年4月5日) | 10,104 | 0.1 | 71.2 | — | — | 1,045 |
| 9期(2018年4月5日) | 10,099 | △0.0 | 71.1 | — | — | 1,030 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 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、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

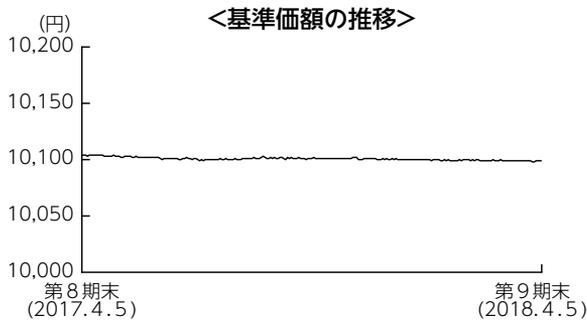
■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 債 組 入 比 | 券 率 | 新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 比 率 | 債 先 物 比 | 券 率 |
|------------------------|---------|--------|---------|-----|---|---------|--------|
| | 円 | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) 2017年 4 月 5 日 | 10,104 | % - | 71.2 | % | - | - | % - |
| 4 月 末 | 10,104 | 0.0 | 71.2 | - | - | - | - |
| 5 月 末 | 10,102 | △0.0 | 80.2 | - | - | - | - |
| 6 月 末 | 10,100 | △0.0 | 77.9 | - | - | - | - |
| 7 月 末 | 10,100 | △0.0 | 76.1 | - | - | - | - |
| 8 月 末 | 10,102 | △0.0 | 56.9 | - | - | - | - |
| 9 月 末 | 10,101 | △0.0 | 65.2 | - | - | - | - |
| 10 月 末 | 10,101 | △0.0 | 77.6 | - | - | - | - |
| 11 月 末 | 10,100 | △0.0 | 77.6 | - | - | - | - |
| 12 月 末 | 10,100 | △0.0 | 70.1 | - | - | - | - |
| 2018年 1 月 末 | 10,100 | △0.0 | 70.1 | - | - | - | - |
| 2 月 末 | 10,099 | △0.0 | 79.5 | - | - | - | - |
| 3 月 末 | 10,098 | △0.1 | 71.1 | - | - | - | - |
| (期 末) 2018年 4 月 5 日 | 10,099 | △0.0 | 71.1 | - | - | - | - |

(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（2017年4月6日から2018年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,099円となり、前期末比で0.05%下落しました。

基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策の影響により残存期間の短い政府保証債等の利回りが上昇（価格は下落）したことから、基準価額は下落しました。

投資環境

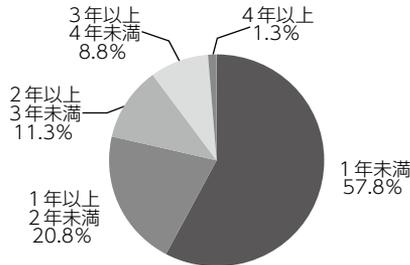
国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは△0.25%～△0.09%で推移しました。2017年8月から11月末の間には需給要因から利回りが上下する局面もありましたが、概ね△0.15%を中心としたレンジで推移しました。

ポートフォリオについて

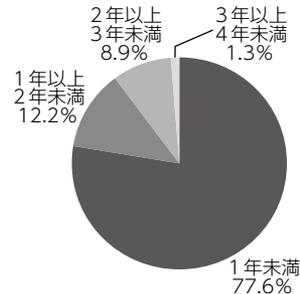
残存期間の短い政府保証債を中心とした運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比 期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

日銀の金融政策の物価目標2%までは依然として距離があるため、当面は政策の据え置きが予想されます。マイナス金利政策が継続されると考えられるため、政府保証債や地方債などを中心に運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況（2017年4月6日から2018年4月5日まで）

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|-----------|---------|----------------------|
| 国 内 | | 千円 | 千円 |
| | 国 債 証 券 | 300,097 | 100,016 (200,000) |
| | 地 方 債 証 券 | 17,719 | — (68,770) |
| | 特 殊 債 券 | 405,052 | — (360,000) |

(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6日から2018年4月5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

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 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 地 方 債 証 券 | 130,780 | 131,175 | 12.7 | — | — | 2.8 | 10.0 |
| 特 殊 債 券 | 595,000 | 601,037 | 58.3 | — | — | 4.5 | 53.8 |
| 合 計 | 725,780 | 732,213 | 71.1 | — | — | 7.3 | 63.8 |

(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 |
| (地方債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 25年度6回 静岡県公募債 | 0.3420 | 13,250 | 13,265 | 2018/08/23 |
| 25年度 京都府京都みらい債 | 0.3000 | 6,000 | 5,999 | 2018/09/03 |
| 25年度1回 ぐんま県民債 | 0.2600 | 4,000 | 3,998 | 2018/10/30 |
| 2回 東京都公募債（東京グローバル都債（円貨）） | 0.1200 | 5,000 | 4,996 | 2018/12/07 |
| 25年度8回 福岡県公募債 | 0.2700 | 6,700 | 6,696 | 2018/12/25 |
| 26年度4回 静岡県公募債 | 0.2090 | 14,810 | 14,842 | 2019/06/24 |
| 26年度1回 大阪市みおつくし債 | 0.2200 | 6,000 | 5,992 | 2019/06/27 |
| 21年度6回 愛知県公募債 | 1.4400 | 10,000 | 10,185 | 2019/07/30 |
| 26年度 京都府京都みらい債 | 0.1600 | 9,200 | 9,179 | 2019/09/02 |
| 331回 大阪府公募債 | 1.4100 | 10,000 | 10,216 | 2019/10/29 |
| 26年度7回 福岡県公募債 | 0.2000 | 6,500 | 6,486 | 2019/12/25 |
| 43回 川崎市公募債 5年 | 0.1370 | 10,850 | 10,872 | 2020/03/19 |
| 27年度2回 千葉県公募債 | 0.1770 | 14,670 | 14,715 | 2020/05/25 |
| 27年度 京都府京都みらい債 | 0.1000 | 13,800 | 13,726 | 2020/09/02 |
| 小 計 | — | 130,780 | 131,175 | — |
| (特殊債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 194回 政保中小企業債券 | 1.5000 | 100,000 | 100,695 | 2018/09/18 |
| 1回 政保地方公営企業金融機構債券 | 1.6000 | 100,000 | 100,865 | 2018/10/16 |
| 199回 政保預金保険機構債券 | 0.1000 | 100,000 | 100,068 | 2018/10/16 |
| 71回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.4000 | 100,000 | 101,033 | 2018/12/25 |
| 15回 政保東日本高速道路債券 | 1.3000 | 100,000 | 101,187 | 2019/02/25 |
| 55回 政保関西国際空港債 | 1.3000 | 29,000 | 29,373 | 2019/03/25 |

| 銘 | 柄 | 当 | | 期 | | 末 |
|--------|-------------------|--------|---------|---------|----|------------|
| | | 利 | 額 | 評 | 額 | 償 |
| | | 率 | 面 | 価 | 額 | 還 |
| | | % | 金 | 額 | 額 | 年月日 |
| | | | 額 | | | |
| (特殊債券) | | | 千円 | | 千円 | |
| 89回 | 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.3000 | 4,000 | 4,079 | | 2019/09/30 |
| 93回 | 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.4000 | 8,000 | 8,189 | | 2019/11/29 |
| 100回 | 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.4000 | 9,000 | 9,244 | | 2020/02/28 |
| 112回 | 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.1000 | 30,000 | 30,786 | | 2020/07/31 |
| 117回 | 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.0000 | 6,000 | 6,153 | | 2020/09/30 |
| 133回 | 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.3000 | 5,000 | 5,203 | | 2021/04/30 |
| 137回 | 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.2000 | 4,000 | 4,158 | | 2021/06/30 |
| 小 | 計 | — | 595,000 | 601,037 | | — |
| 合 | 計 | — | 725,780 | 732,213 | | — |

■投資信託財産の構成

2018年4月5日現在

| 項 | 目 | 当 | | 期 | | 末 |
|---|---|---|-----------|----|---|-------|
| | | 評 | 価 | 額 | 比 | 率 |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | 千円 | | % |
| 公 | 社 | | 732,213 | | | 71.1 |
| コ | ー | | 298,257 | | | 28.9 |
| ル | ・ | | | | | |
| ロ | ー | | | | | |
| ン | 等 | | | | | |
| | 、 | | | | | |
| | そ | | | | | |
| | の | | | | | |
| | 他 | | | | | |
| 投 | 資 | | 1,030,471 | | | 100.0 |
| 信 | 託 | | | | | |
| 財 | 産 | | | | | |
| 総 | 額 | | | | | |

(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

(2018年4月5日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,030,471,057円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 296,878,113 |
| 公 社 債(評価額) | 732,213,335 |
| 未 収 利 息 | 1,083,993 |
| 前 払 費 用 | 295,616 |
| (B) 負 債 | - |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 1,030,471,057 |
| 元 本 | 1,020,388,428 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 10,082,629 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,020,388,428口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,099円 |

■損益の状況

当期 自2017年4月6日 至2018年4月5日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 6,427,083円 |
| 受 取 利 息 | 6,637,040 |
| 支 払 利 息 | △209,957 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △6,932,206 |
| 売 買 益 | 21,813 |
| 売 買 損 | △6,954,019 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | △505,123 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 10,735,046 |
| (E) 解 約 差 損 益 金 | △201,483 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 54,189 |
| (G) 合 計(C+D+E+F) | 10,082,629 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 10,082,629 |

(注1) 期首元本額 1,034,991,821円
追加設定元本額 5,445,811円
一部解約元本額 20,049,204円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|---|----------------|
| クルーズコントロール | 990,000,991円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 98,711円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース> | 870,000円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース> | 530,000円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース> | 70,000円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルレアルコース> | 10,530,000円 |
| 世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ (毎月分配型) <円コース> | 1,281,836円 |
| 世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ (毎月分配型) <豪ドルコース> | 246,797円 |
| 世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ (毎月分配型) <ブラジルレアルコース> | 1,689,581円 |
| 世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ (毎月分配型) <中国元コース> | 654,944円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース> | 149,716円 |
| ネット証券専用ファンドシリーズ 新興市場日本株 レアル型 | 103,986円 |
| DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド 資源国通貨バスケットコース | 4,486,988円 |
| DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド ブラジルレアルコース | 4,586,699円 |
| DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド 円コース | 997,109円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース> | 5,972円 |
| DIAM 米国リート・インカムプラス | 994,728円 |
| USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり) | 993,740円 |
| USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし) | 1,987,479円 |
| DIAM-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金> | 9,935円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 円コース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 米ドルコース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 豪ドルコース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) メキシコペソコース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) トルコリラコース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) ブラジルレアルコース | 9,925円 |
| USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジあり | 9,924円 |
| USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジなし | 9,924円 |
| 米国株式リスクコントロール戦略ファンド<為替ヘッジあり> | 9,909円 |
| 米国株式リスクコントロール戦略ファンド<為替ヘッジなし> | 9,909円 |
| 期末元本合計 | 1,020,388,428円 |

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

《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)