

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。
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド（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。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の株式を主要投資対象とします。
	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	海外の証券取引所に上場している株式 [※] を主要投資対象とします。 ※DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
	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・パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 [※] を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。
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。	
	実質的な組入外貨建資産については、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。 外貨建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。	
	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。	
組入制限		
分配方針		

運用報告書（全体版）

第7期<決算日2019年6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、2019年6月3日に第7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/>

■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、債券投資組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率								
3期 (2017年6月2日)	円	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
	11,121	0	7.6	77.4	2.5	12.8	—	—	—	5.9	13
4期 (2017年12月4日)	12,001	0	7.9	78.0	2.2	12.8	—	—	—	5.4	14
5期 (2018年6月4日)	11,619	0	△3.2	78.0	2.0	12.6	—	—	—	5.8	13
6期 (2018年12月3日)	11,210	0	△3.5	30.8	1.1	50.2	—	—	—	14.9	12
7期 (2019年6月3日)	10,949	0	△2.3	50.0	1.4	29.4	—	—	—	15.3	13

(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、債券投資組入比率
	騰落率								
(期首)	円	%	%	%	%	%	%	%	%
2018年12月3日	11,210	—	30.8	1.1	50.2	—	—	—	14.9
12月末	10,749	△4.1	30.2	1.2	51.0	—	—	—	14.3
2019年1月末	11,027	△1.6	32.7	1.5	48.5	—	—	—	15.1
2月末	11,257	0.4	30.2	1.6	51.1	—	—	—	14.8
3月末	11,376	1.5	60.6	2.2	19.7	—	—	—	15.7
4月末	11,637	3.8	60.3	2.1	19.7	—	—	—	15.7
5月末	11,068	△1.3	51.1	1.5	29.7	—	—	—	15.4
(期末)									
2019年6月3日	10,949	△2.3	50.0	1.4	29.4	—	—	—	15.3

(注1) 騰落率は期首比です。

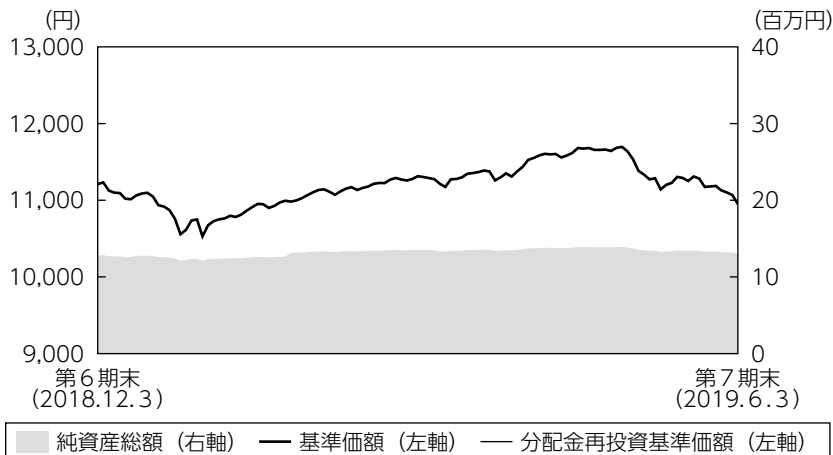
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、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12月4日から2019年6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

期初から2018年末、また2019年5月から期末にかけては、世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の激化などを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、世界的に株価が下落し、為替市場で円高が進んだことが主なマイナス要因となり、基準価額は下落しました。2019年1月から4月までは、リスク回避の動きが一時弱まり、世界的に株価が回復し円安傾向となったことで基準価額は上昇しましたが、通期で見ると下落する結果となりました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.3%
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	△10.1%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.0%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	△2.7%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4.2%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	△3.8%
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.9%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.4%
DIAMマネーマザーファンド	△0.0%

投資環境

国内債券の利回りは低下（価格は上昇）しました。世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の激化、欧米の政治リスクの高まりなどを背景に、10年国債利回りは期を通じて低下基調で推移しました。国内債券市場の好需給や、米国の利上げペース緩和観測なども、利回りの低下要因となりました。前期末に0.08%程度だった10年国債利回りは、2019年2月にマイナス圏にまで低下し、△0.10%程度で期末を迎えました。

国内株式市場は下落しました。期初から2018年12月下旬にかけては、世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の激化などを嫌気し、急落しました。2019年1月半ばにかけて大幅下落の反動から反発しましたが、その後は米中貿易問題の進展、英国のEU（欧州連合）離脱問題、世界景気の減速懸念、トルコへの信用不安などを材料として一進一退の展開となりました。5月から期末にかけては、米中貿易摩擦への警戒感の高まりや米国によるメキシコへの追加関税発表などを要因として再び下落に転じました。

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

先進国株式市場は上昇しました。米国市場は、2018年末にかけて下落しましたが、年明け以降はパウエルFRB議長が金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから2019年4月下旬にかけて堅調に推移しました。期末にかけては、米中貿易摩擦への懸念などから下落に転じる局面もありましたが、前期末比では上昇しました。欧州株式市場も年明け以降は堅調に推移し、期末にかけて下落したものの、一部を除き前期末比で上昇しました。

新興国債券の利回りは低下しました。ベースとなる米国の長期金利は、世界的な景気減速懸念や、米国における利下げ観測が強まったことなどを背景に低下しました。対米国債スプレッド（利回り格差）は、原油安などを背景に産油国を中心に拡大する局面もありましたが、原油価格が上昇すると縮小しました。その後は世界的な景気減速懸念などから対米スプレッドは拡大傾向となり、期を通じてみると小幅に拡大しました。

新興国株式市場は下落しました。期初は、世界景気の先行きや米中貿易摩擦への懸念などから軟調に推移しましたが、年明け後はパウエルFRB議長が利上げに慎重な姿勢を示したことなどから世界景気の先行きに対する懸念が和らぎ、堅調な推移となりました。期末にかけてはトランプ米大統領が新たな対中制裁を発表したことを受けて軟調に推移し、前期末比で下落しました。

国内リート市場は、世界的にリスク性資産全般で下落基調が強まったことから、2018年末にかけて急落する局面もありましたが、その後は内需ディフェンシブ株の一角として株式投資家からの資金流入等を支えに底堅い展開が続きました。積極的な資産入れ替え方針などによる投資主価値の向上への期待も国内リート市場を支えました。用途別では、東京都心を中心に賃料上昇の加速が好感されたオフィスリートや住宅リートが強い展開となりました。

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は、2018年12月に米国長期金利の上昇が嫌気されて下落しましたが、その後はリーートの底堅い業績などを背景に堅調に推移し、前期末比では上昇しました。欧州リート市場は、低金利環境の長期化期待などから主要市場で上昇しました。豪州リート市場は、長期金利の低下や豪州経済への期待などから上昇しました。

為替相場では主要通貨に対して円高が進みました。米ドル/円相場は、投資家のリスク回避姿勢が強まった局面を中心に円が買われ、円高・ドル安が進みました。FRBが利上げを休止し、市場では今後の利下げ観測が強まったことも円高・ドル安要因となりました。ユーロは、欧州景気の減速懸念等を背景に、対米ドル・対円ともに下落しました。

国内短期金融市場では、日米欧の中央銀行が米中の貿易問題などの影響を見極めるため金融政策を据え置いている、3ヵ月物国庫短期証券利回りは△0.3%台～△0.1%台で推移するなど、レンジ内の推移となりました。

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】

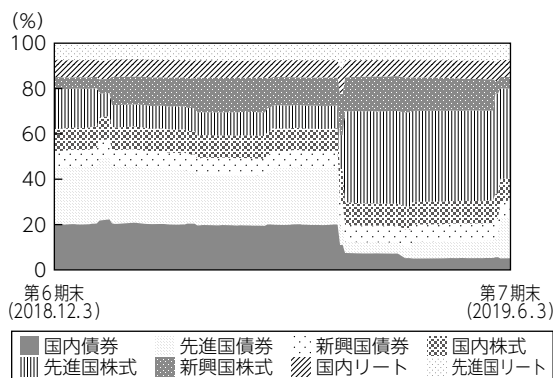
8資産への配分比率を月次で決定し、リバランスを行いました。配分比率は、主として統計的手法を活用し、リスクを一定程度に抑えつつ収益を獲得することをめざして、過去の騰落率の動き（トレンド）等に基づき決定しました。当期中は、先進国株式・新興国株式・国内債券・先進国債券の間で配分比率の変更を行いました。先進国株式は期中に配分比率を大幅に増やし、国内債券は大幅に減らす動きとなりました。

【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。当期は、基準価額が期中に比較的大きく上下しましたが、基準価額と下値サポートラインとの距離には比較的余裕がある状況であったため、合計資産比率は期を通して概ね高水準を維持しました。

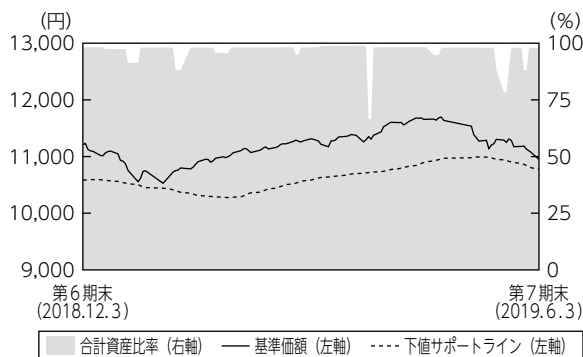
【運用状況】

<戦略的資産配分比率の推移>



- ※1 比率は各マザーファンド（「D I A Mマナーマザーファンド」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

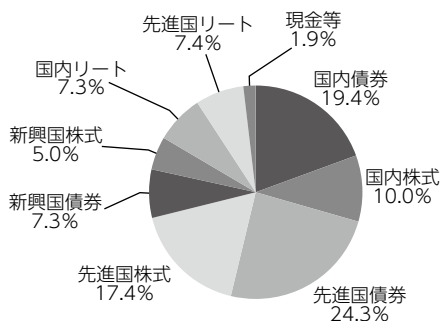
<基準価額と合計資産比率の推移>



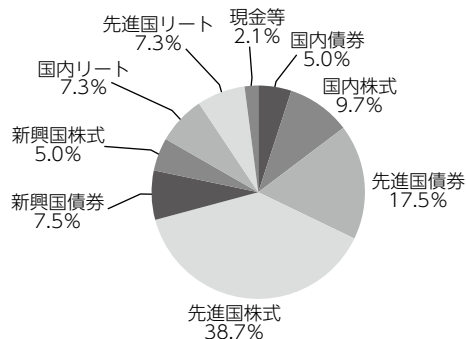
- ※ 比率は純資産総額に対する各マザーファンド（「D I A Mマナーマザーファンド」を除く）評価額の合計の割合です。

<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

残存期間の短い国債や政府保証債、地方債などで運用を行いました。

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12月4日 ～2019年6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	2,012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-REIT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。

●DIAM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。今後もマイナス金利政策が継続されると考えられるため、国債を中心に政府保証債や地方債などを組入れた運用を行っていきます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	(2018年12月4日 ～2019年6月3日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	99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11,195円です。
(投信会社)	(48)	(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)	(48)	(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	1	0.006	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.004)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	1	0.008	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.006)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(d) その他費用	11	0.097	(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)	(0.011)	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)	(10)	(0.085)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	112	1.000	

(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12月4日から2019年6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	422	550	1,855	2,429
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	225	539	180	432
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,429	2,601	1,891	3,457
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,487	5,250	647	2,211
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	187	351	190	356
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,950	2,116	1,919	2,115
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	186	382	208	426
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	293	368	296	373
D I A Mマネーマザーファンド	-	-	-	-

■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	59,405,171千円	61,226,252千円	32,309,478千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	262,633,128千円	331,908,259千円	49,214,414千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.22	0.18	0.65

(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12月4日から2019年6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】

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 60,425	百万円 9,531	% 15.8	百万円 125,936	百万円 13,707	% 10.9

平均保有割合 0.0%

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

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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 29,506	百万円 -	% -	百万円 29,899	百万円 5,556	% 18.6

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 263	百万円 299	百万円 2,406

【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 20,839	百万円 52	% 0.3	百万円 21,390	百万円 -	% -

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 642

【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等はありません。

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

■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	1,929	496	653
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	492	538	1,260
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,711	1,249	2,273
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	633	1,474	5,036
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	516	513	971
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	572	603	653
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	483	461	955
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	751	748	952
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

2019年6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	653	5.0
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	1,260	9.6
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,273	17.3
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,036	38.3
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	971	7.4
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	653	5.0
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	955	7.3
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	952	7.2
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	285	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	13,140	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2019年6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183,329,579千円、99.5%、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは347,259,680千円、99.8%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは108,637,468千円、92.2%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは55,220,267千円、98.6%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは47,281,145千円、97.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年6月3日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.34円、1カナダ・ドル=80.19円、1オーストラリア・ドル=75.23円、1香港・ドル=13.82円、1シンガポール・ドル=78.88円、1ニュージーランド・ドル=70.91円、1台湾・ドル=3.43円、1イギリス・ポンド=137.00円、1イスラエル・シェケル=29.88円、1スイス・フラン=108.44円、1トルコ・リラ=18.52円、1デンマーク・クローネ=16.22円、1ノルウェー・クローネ=12.39円、1スウェーデン・クローナ=11.42円、1メキシコ・ペソ=5.52円、1フィリピン・ペソ=2.08円、100チリ・ペソ=15.25円、100コロンビア・ペソ=3.21円、1カタール・リアル=29.71円、1インド・ルピー=1.57円、1パキスタン・ルピー=0.74円、100インドネシア・ルピア=0.76円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.56円、1ブラジル・レアル=27.61円、1チェコ・コルナ=4.69円、100韓国・ウォン=9.13円、1オフショア・人民元=15.62円、1マレーシア・リンギット=25.87円、1南アフリカ・ランド=7.44円、1タイ・バーツ=3.42円、1ポーランド・ズロチ=28.28円、100ハンガリー・フォリント=37.26円、1ユーロ=121.10円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年6月3日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	13,140,909円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	285,635
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	653,484
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)	1,260,401
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,273,053
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	5,036,787
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	971,740
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	653,064
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)	955,079
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	952,009
D I A M マネーマザーファンド(評価額)	99,657
(B) 負 債	117,346
未 払 信 託 報 酬	117,164
そ の 他 未 払 費 用	182
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	13,023,563
元 本	11,894,258
次 期 繰 越 損 益 金	1,129,305
(D) 受 益 権 総 口 数	11,894,258口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,949円

(注) 期首における元本額は11,422,337円、当期中における追加設定元本額は568,597円、同解約元本額は96,676円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月4日 至2019年6月3日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△21円
支 払 利 息	△21
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△170,112
売 買 益	275,454
売 買 損	△445,566
(C) 信 託 報 酬 等	△128,146
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△298,279
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,113,887
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	313,697
(配 当 等 相 当 額)	(297,711)
(売 買 損 益 相 当 額)	(15,986)
(G) 合 計(D+E+F)	1,129,305
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,129,305
追 加 信 託 差 損 益 金	313,697
(配 当 等 相 当 額)	(298,235)
(売 買 損 益 相 当 額)	(15,462)
分 配 準 備 積 立 金	2,095,189
繰 越 損 益 金	△1,279,581

(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	45,699円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	298,235
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,049,490
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,393,424
(f) 1万口当たり当期分配対象額	2,012.25
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第16期 (決算日 2019年2月14日)

(計算期間 2018年2月15日～2019年2月14日)

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

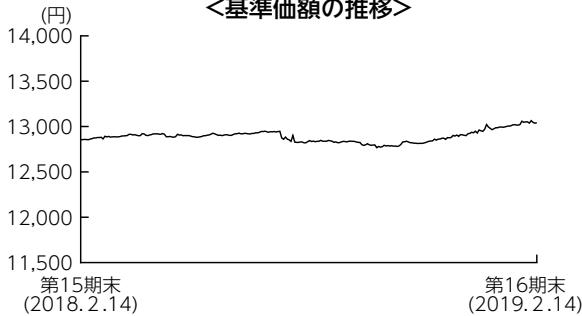
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率 比	新株予約債 権付社債 (転換社債) 率 比	債券先物率 比
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首) 2018年2月14日	円 12,855	% -	ポイント 380.56	% -	% 99.5	% -	% -
2月 末	12,879	0.2	381.29	0.2	99.2	-	-
3月 末	12,899	0.3	381.91	0.4	99.4	-	-
4月 末	12,889	0.3	381.64	0.3	99.5	-	-
5月 末	12,919	0.5	382.50	0.5	99.4	-	-
6月 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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月15日から2019年2月14日まで）

<基準価額の推移>



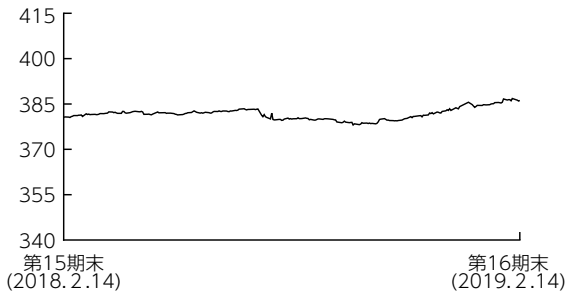
基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

<NOMURA-BPI総合の推移>



投資環境

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

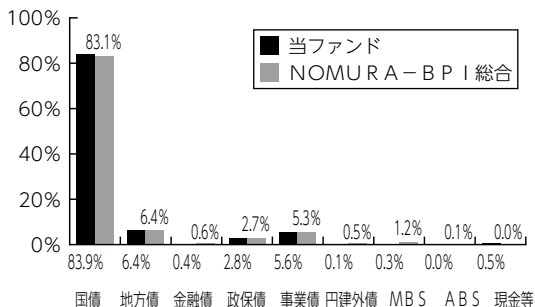
ポートフォリオについて

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

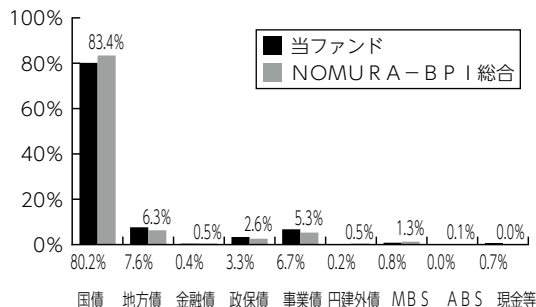
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

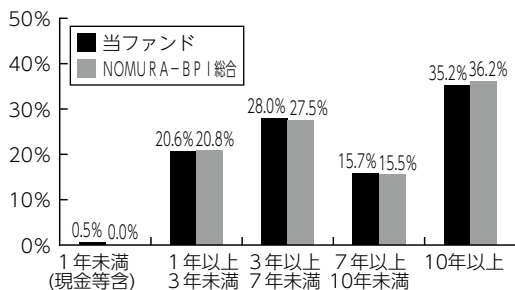


期末

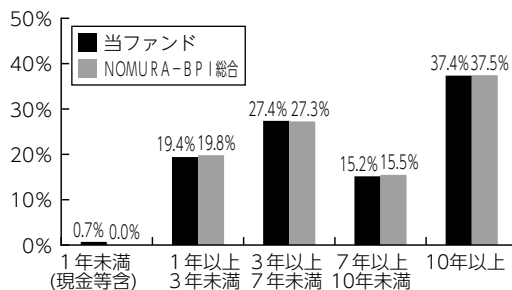


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークは、前期末比で1.5%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(12,890円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については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 (2018年2月15日から2019年2月14日まで) 公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国 債 証 券	千円 212,600,000	千円 234,177,067	% 80.2	% -	% 55.6	% 16.8	% 7.8
地 方 債 証 券	21,443,900	22,249,515	7.6	-	2.7	4.0	1.0
特 殊 債 証 券	16,423,867	17,541,186	6.0	-	3.4	2.3	0.3
金 融 債 証 券	1,200,000	1,201,430	0.4	-	-	0.2	0.2
普 通 社 債 証 券	14,381,000	14,908,641	5.1	-	1.1	2.3	1.7
合 計	266,048,767	290,077,840	99.3	-	62.7	25.6	11.0

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

■投資信託財産の構成

2019年2月14日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月14日)現在

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

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

■損益の状況

当期 自2018年2月15日 至2019年2月14日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2019年2月7日）

（計算期間 2018年2月8日～2019年2月7日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

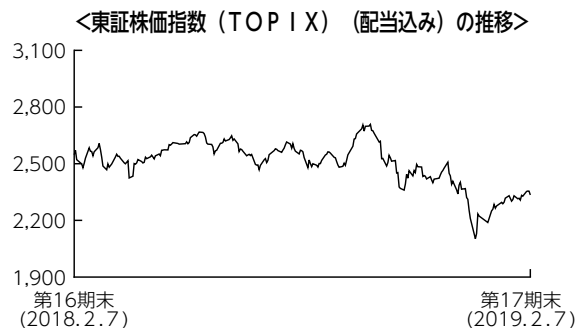
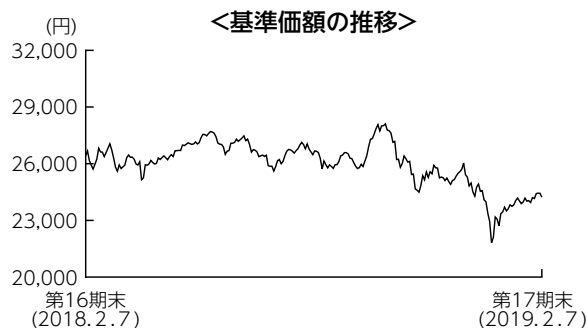
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月8日から2019年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は24,228円となり、前期末に比べ8.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種
 期首 (前期末)

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



期末

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

○組入上位10銘柄
 期首 (前期末)

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



期末

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

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,984円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については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 (2018年2月8日から2019年2月7日まで)

(1) 株 式

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 100,959	百万円 98,142	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	81,677,032千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	281,533,266千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.29

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2018年2月8日から2019年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 55

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額	
水産・農林業 (0.1%)		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
極洋	5		5.4	5		15,206	北野建設	27		2.9	9,193	昭和産業	10.4		11.4	33,812					
日本水産	143		166.5	143		122,710	植木組	1.6		1.8	4,060	鳥越製粉	10.1		11.1	8,746					
マルハニチロ	24.1		24.1	24.1		87,121	三井ホーム	16		-	-	中部飼料	13.9		15	16,920					
カネコ種苗	4.4		4.6	4.4		6,035	矢作建設工業	17.3		18.8	13,742	フィード・ワン	76.6		83	14,442					
サカタのタネ	18.8		20.2	18.8		73,023	ピーエス三菱	15.1		14.5	8,352	東洋精糖	2		2	2,179					
ホクト	12.9		14	12.9		27,412	日本ハウスホールディングス	24.3		26.2	11,397	日本甜菜製糖	6.5		7	12,341					
ホクリヨウ	1.6		2.3	1.6		1,405	大東建設	46		49	745,780	三井製糖	9		9.7	27,994					
鉱業 (0.3%)							新日本建設	15.1		16.4	17,941	塩水港精糖	13.7		14.4	3,182					
住石ホールディングス	33.7		35.9	33.7		3,590	NIPPPO	29.4		36.4	76,076	日新製糖	5.4		5.8	11,814					
日鉄鉱業	3.5		3.9	3.5		18,271	東亜道路工業	2.6		2.6	8,008	森永製菓	26.7		31	140,895					
三井鉱山ホールディングス	6.5		6.9	6.5		9,694	前田道路	40		43.1	93,096	中村屋	2.9		3	12,780					
国際石油開発帝石	617.8		668.6	617.8		678,629	日本道路	3.4		3.8	24,206	江崎グリコ	31.8		36.9	205,164					
日本海洋掘削	4.4		-	4.4		-	東亜建設工業	10.3		12.1	17,327	名糖産業	5.5		5.9	8,419					
石油資源開発	20.1		24	20.1		49,728	若築建設	6.9		6.9	10,094	井村屋グループ	4.5		5.2	12,698					
K&Oエナジーグループ	7.5		8	7.5		11,664	東洋建設	39.9		50.3	20,723	不二家	7.3		6.9	15,635					
建設業 (2.9%)							五洋建設	151.1		163.3	102,552	山崎製パン	93.1		100.8	216,115					
ヒノキヤグループ	-		3.5	-		7,122	世紀東急工業	17.2		20.1	12,341	第一屋製パン	2		2.1	2,137					
ショーボンドホールディングス	12		11.9	12		93,415	福田組	4.1		4.5	19,530	モロゾフ	1.9		2	9,807					
ミライト・ホールディングス	39.1		46.9	39.1		75,978	住友林業	81.2		97.5	136,890	亀田製菓	7.1		7.6	39,140					
タマホーム	9.6		10.3	9.6		12,174	日本基礎技術	14.2		14.4	4,867	寿スビリツツ	11		13	55,445					
サンヨーホームズ	2.3		2.5	2.3		2,092	日成ビルド工業	18.8		-	-	カルビ	51.8		56.1	175,873					
日本アクア	4.1		4.1	4.1		1,767	ヤマダ・エスバイエルホーム	58		-	-	森永乳業	22.8		24.6	77,490					
ファーストコーポレーション	4.3		4.6	4.3		3,491	BCコーポレーション	15.9		17.1	6,805	六甲バター	5.7		9	17,874					
バステラ	1.8		3.2	1.8		4,272	大和ハウス工業	375.3		380.8	1,287,484	ヤクルト本社	68.1		91.3	648,230					
TATERU	11.2		20.2	11.2		5,959	ライト工業	24.5		26.4	35,904	明治ホールディングス	75.3		87.2	721,144					
スペースビューホールディングス	-		20.3	-		19,325	積水ハウス	413.3		420.8	679,381	雪印メグミルク	27.4		29.6	77,788					
ダイセキ環境ソリューション	3		3.2	3		2,051	日特建設	10.9		11.8	7,363	プリマハム	80		17.3	34,669					
第一カットター興業	1.3		1.9	1.3		3,562	北陸電気工事	7.1		6.7	6,036	日本ハム	98		53.2	230,888					
安藤・間	97.8		106.4	97.8		80,757	ユアテック	20		22.1	19,934	林業産業	4.1		4.3	2,494					
東急建設	48.9		48.8	48.9		47,775	西部電気工業	2.1		-	-	丸大食品	6.1		13.3	24,312					
コムシホールディングス	44.7		59.1	44.7		165,361	四電工	1.9		2	5,334	S Foods	8		11.1	43,734					
ミザワホーム	10.6		13.1	10.6		9,589	中電工	16.4		17.6	40,180	伊藤ハム株式会社ホールディングス	73.3		79.3	49,959					
ビーホールホールディングス	12.6		13.8	12.6		4,899	関電工	50.6		62.6	62,224	サッポロホールディングス	41.6		45.1	111,938					
藤井コンストラクショングループ	8.2		10.3	8.2		28,644	きんでん	84.5		91.5	161,314	アサヒグループホールディングス	238.4		257.9	1,220,382					
東建コーポレーション	4.7		5.1	4.7		32,895	東京エネシス	14.4		14.2	14,498	キリンホールディングス	547		557.2	1,474,908					
ソネット	1.6		1.8	1.6		1,258	トーエネック	3.6		3.8	12,331	宝ホールディングス	85.2		92.2	111,746					
ヤマウラ	6		6.5	6		6,305	住友電設	10.1		9.5	17,052	オノンホールディングス	32.5		35.2	12,672					
大成建設	126.5		136.8	126.5		663,480	日本電設工業	19.5		23.5	53,298	養命酒製造	3.5		3.9	8,034					
大林組	381		412.3	381		419,309	協和エクシオ	45.6		53.8	145,582	コトコト 株式会社ホールディングス	79.9		94.3	322,977					
清水建設	388.6		420.5	388.6		388,962	新日本空調	9.8		11.7	21,258	サントリー食品インターナショナル	87		82.4	401,700					
飛鳥建設	115.9		11.8	115.9		17,133	NDS	2		-	-	ダイドールグループホールディングス	5.8		6.9	36,432					
長谷工コーポレーション	148.3		171.9	148.3		206,623	九電工	25.1		27	106,245	伊藤園	37.7		37.4	188,496					
松井建設	14		15.2	14		11,020	三機工業	26.9		31.6	35,676	キーコーヒー	11.2		12.2	24,668					
銭高組	1.8		1.8	1.8		9,594	日輝	109.4		118.4	191,808	ユニカフェ	3.5		3.9	3,900					
鹿島建設	558		322.2	558		494,899	中外卸工業	3.9		3.9	8,162	ジャパンフーズ	1.6		1.8	2,181					
不動テトラ	96.5		9.4	96.5		15,820	ヤマト	10.5		12.4	5,753	日清オイルグループ	13.4		15.9	50,562					
大末建設	4.1		4.9	4.1		4,630	太平電業	8.6		9.3	22,905	不二製油グループ本社	30.8		30.1	108,661					
鉄建建設	7.7		8.3	7.7		22,119	高砂熱学工業	35		34.6	58,197	かどや製油	1.2		1.3	6,526					
西松建設	29.3		29.6	29.3		75,835	三晃金属工業	1.4		1.5	4,378	J-オイルミルズ	5.9		6.4	25,696					
三井住友建設	91.6		99.1	91.6		68,379	朝日工業社	2.6		2.7	8,262	キッコーマン	88.9		81.3	418,695					
大豊建設	46		9.3	46		32,689	明星工業	23		24.9	16,932	味の素	261.7		271.9	449,314					
前田建設工業	90.6		98.1	90.6		106,732	大気社	16.8		18.8	53,486	キユーピー	63.4		68.6	170,608					
佐田建設	8.4		8.8	8.4		3,361	ダイダマン	8.5		9.2	22,650	ハウス食品グループ本社	43.4		47	187,295					
ナカノフードー建設	9.7		10.5	9.7		5,481	日比谷総合設備	14.2		13.1	23,855	カゴメ	45.6		49.4	139,406					
奥村組	20.9		22.6	20.9		77,066	東芝プラントシステム	27.5		29.7	58,509	焼津水産化学工業	5.5		6.1	6,581					
東鉄工業	15.3		16.5	15.3		48,691	OS JBホールディングス	56.3		60.8	18,118	アリアケジャパン	10.4		11.3	79,213					
イチケン	2.3		2.6	2.3		5,166	東洋エンジニアリング	15		16.2	12,295	ビエトロ	1.5		1.6	2,616					
富士ピー・エス	-		4.3	-		2,214	千代田化工建設	82.5		99.1	33,297	エバラ食品工業	2.5		2.6	5,675					
浅沼組	45		4.9	45		14,523	新興ブランテック	24.5		24.7	31,023	ニチレイ	54.2		64	171,008					
戸田建設	148		159.8	148		112,499	食料品 (4.3%)					東洋水産	62.4		63.3	258,264					
熊谷組	19.9		19.6	19.9		67,424	日本製粉	37.7		40.9	75,746	イトード	3.2		4.3	7,030					
青木あすなる建設	8.3		6.8	8.3		6,779	日清製粉グループ本社	139.3		139.1	310,053	大冷	1.3		1.5	2,605					
							日東富士製粉	0.8		0.8	4,912	ヨシムラ・フード・ホールディングス	1.7		3.3	2,178					

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

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

銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末		
	株数	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
ジーテクト				千株		千円				千株		千円				千株		千円		
中国工業	12.4	1.7	20.9	13.5	1.9	53,810	21,073	1,081	53,810	9.4	10.2	9,618	12.7	16.5	38,065	12.7	16.5	38,065		
東プレ	20.9	21.6	81.6	22.6	23.5	7,237	21,056	7,237	3.8	4.9	3,248	6,211	11.4	18.5	31,468	6,211	11.4	18.5		
高周波熱錬	21.6	21.6	21.6	23.5	21,056				547.5	555.5	1,485,684	260,793	9.2	10	10,290	260,793	9.2	10		
東京製鋼	81.6	81.6	81.6	7.4	7.237				64.9	70.2	260,793	136,154	232.9	252	268,884	232.9	252	268,884		
サンコール	6.3	6.3	6.3	6.9	4,395				53	49.1	136,154	7,775	262.4	263.7	90,449	262.4	263.7	90,449		
モリテックスチール	6.6	6.6	6.6	9.5	3,961				3.1	3.4	2,600	13,000	120.8	117.7	160,542	120.8	117.7	160,542		
パイオラックス	16.6	16.6	16.6	19.4	42,815				4.8	5.2	3,800	20,393	105	11.4	49,077	105	11.4	49,077		
エイチワン	8.3	8.3	8.3	12	13,260				11.3	12.3	9,300	6,999	36.3	36.4	20,966	36.3	36.4	20,966		
日本発条	111.7	111.7	111.7	120.9	124,527				8.8	10.4	7,800	3,546	70.7	76.5	206,014	70.7	76.5	206,014		
中央発條	1.3	1.3	1.3	1.4	4,048				2.5	2.6	2,000	12,507	5	9.5	8,597	5	9.5	8,597		
アドパネクス	1.8	1.8	1.8	1.6	2,468				5.4	5.5	4,200	8,904	4.4	4.8	8,707	4.4	4.8	8,707		
立川プラインド工業	5	5	5	5.4	5,313				5.6	5.3	4,200	2,657	14	15.1	19,871	14	15.1	19,871		
三益半導体工業	8.7	8.7	8.7	9.5	13,642				3.6	4.4	3,400	11,192	7.8	9.1	3,221	7.8	9.1	3,221		
機械 (4.9%)									608.2	658.2	1,119,927	6,617	11.5	12.4	16,603	6,617	11.5	12.4		
日本ドライケミカル	1.5	1.5	1.5	3.4	3,954				3.3	3.5	2,450	6,617	50.5	49.7	45,028	50.5	49.7	45,028		
日本製鋼所	36.6	36.6	36.6	36.7	74,794				3.9	4.3	3,400	33,631	147.9	149.3	582,270	147.9	149.3	582,270		
三浦工業	48.5	48.5	48.5	52.6	125,766				22.5	24.3	19,900	10,294	89.9	97.1	35,247	89.9	97.1	35,247		
タクマ	38	38	38	44.2	61,482				7.9	8.6	6,600	1,800	190	205.6	872,566	190	205.6	872,566		
ツガミ	30	30	30	27.1	19,268				4.5	4.7	3,500	27,965	87.1	94.3	321,091	87.1	94.3	321,091		
オークマ	39.1	39.1	39.1	15.4	89,782				26.9	29.1	23,000	40,446	18.2	21.1	33,464	18.2	21.1	33,464		
東芝機械	63	63	63	13.7	29,961				9.9	10.7	8,000	14,903	69.3	68.1	63,128	69.3	68.1	63,128		
アマダホールディングス	173	173	173	187.2	201,427				19.6	21.2	16,300	37,682	69.4	75.1	109,120	69.4	75.1	109,120		
アイデンエンジニアリング	28.5	28.5	28.5	33.7	26,656				28.5	33.2	27,000	17,222	265.4	268.1	286,598	265.4	268.1	286,598		
滝澤鉄工所	3.5	3.5	3.5	3.9	6,555				9.5	9.6	7,200	5,836	138.5	159.9	324,916	138.5	159.9	324,916		
F U J I	33.6	33.6	33.6	36.3	52,308				19	2	1,500	5,428	210.5	227.8	418,924	210.5	227.8	418,924		
牧野フライス製作所	56	56	56	14.2	60,634				2.1	2.3	1,800	166,192	2,723	552.4	1,935,057	2,723	552.4	1,935,057		
オーエスジー	51.7	51.7	51.7	59.7	135,399				46.6	54.4	46,100	3,467	1,133.9	1,227	1,706,143	1,133.9	1,227	1,706,143		
ダイジェット工業	1.4	1.4	1.4	1.4	2,244				1.8	1.9	1,500	11,881	342	79.6	258,700	342	79.6	258,700		
旭ダイヤモンド工業	33.3	33.3	33.3	31.8	23,436				11.6	12.6	10,000	15,240	4.5	4.8	6,254	4.5	4.8	6,254		
DMG森精機	62.1	62.1	62.1	76.7	114,743				12.8	12.7	10,000	1,968,962	131.4	142.2	443,664	131.4	142.2	443,664		
ソディック	24.4	24.4	24.4	26.4	21,648				154.8	167.5	16,900	12,546	73	17	23,239	73	17	23,239		
ディスコ	15.2	15.2	15.2	16.4	271,748				4.1	4.5	3,600	10,842	96	24.3	39,293	96	24.3	39,293		
日東工器	6.9	6.9	6.9	6.6	14,869				4.8	4.6	3,600	186,052	3.3	3.3	6,263	3.3	3.3	6,263		
日進工具	3	3	3	3.7	9,113				61.4	66.4	66,000	65,360	5.5	5.9	23,511	5.5	5.9	23,511		
パンチ工業	9.4	9.4	9.4	8.5	4,496				67	16	1,200	5,144	10.5	11.3	16,012	10.5	11.3	16,012		
富士ダイス	4.3	4.3	4.3	5.4	3,504				4.3	5.8	5,100	3,886	81	15.3	41,264	81	15.3	41,264		
豊和工業	6.2	6.2	6.2	6.7	5,715				9.6	10.2	8,000	18,202	17	2.2	7,854	17	2.2	7,854		
OKK	4.3	4.3	4.3	5	4,235				19.1	19.1	15,000	376,092	31.6	33.9	131,362	31.6	33.9	131,362		
石川製作所	2.9	2.9	2.9	2.9	3,433				57.7	67.4	67,000	3,352	136.5	147.7	1,941,516	136.5	147.7	1,941,516		
東洋機械金属	8.8	8.8	8.8	8.8	5,139				3.1	3.4	2,700	17,173	4.1	6.6	11,259	4.1	6.6	11,259		
津田駒工業	27	27	27	2.6	4,872				5.4	6.3	5,100	4,331	5	4.2	5,363	5	4.2	5,363		
エンシュウ	29	29	29	3.2	3,564				2.2	2.2	1,800	70,566	6.2	6.2	8,909	6.2	6.2	8,909		
島精機製作所	14.2	14.2	14.2	16.7	59,619				54.7	59.2	59,000	52,494	16.5	17.8	20,559	16.5	17.8	20,559		
オプトラン	8.2	8.2	8.2	11.9	22,848				36.3	44.6	44,000	36,964	4.3	4.6	4,540	4.3	4.6	4,540		
NCホールディングス	3.6	3.6	3.6	3.8	1,835				31.5	34.1	34,000	15,763	62	13.5	37,125	62	13.5	37,125		
フリーユー	8	8	8	9.7	9,952				8.6	9.3	7,800	77,292	15.8	16.5	2,029	15.8	16.5	2,029		
ヤマシンフィルタ	15.3	15.3	15.3	21.1	13,567				35.1	34.2	34,000	18,813	16.4	17.7	24,355	16.4	17.7	24,355		
日阪製作所	16.1	16.1	16.1	15	12,840				11.2	10.9	10,000	126,177	83.3	89.9	24,452	83.3	89.9	24,452		
やまびこ	21.7	21.7	21.7	23.6	26,078				28.4	30.7	30,700	13,205	10.2	11	8,910	10.2	11	8,910		
平田機工	3.1	3.1	3.1	5.7	37,107				10.5	13.6	13,600	16,362	5.3	5.1	6,257	5.3	5.1	6,257		
ベガサスミシン製造	10.5	10.5	10.5	11.4	7,364				7.2	7.7	6,600	28,987	26.6	28.8	28,137	26.6	28.8	28,137		
マルマエ	-	-	-	3.3	2,392				7	7.5	6,000	1,750	24.3	24.4	17,470	24.3	24.4	17,470		
タツモ	-	-	-	3.9	3,525				4.8	5	4,000	8,159	120.5	130.3	630,000	120.5	130.3	630,000		
ナブテスコ	61.7	61.7	61.7	66.7	189,294				5.2	5.6	4,600	40,754	18.2	19.6	42,708	18.2	19.6	42,708		
三井海洋開発	11.9	11.9	11.9	12.9	40,377				19	20.5	19,500	82,941	14	16.4	33,718	14	16.4	33,718		
レオン自動機	10	10	10	12	16,740				35.1	35.1	35,100	19,635	1.3	1.3	1,684	1.3	1.3	1,684		
S M C	35.6	35.6	35.6	35.9	1,386,458				16.8	17	17,000	12,054	20.4	44.1	99,798	20.4	44.1	99,798		
新川	9.2	9.2	9.2	9.2	3,634				13.8	14.9	14,900	5,275	2.9	3	5,367	2.9	3	5,367		
ホソカワマイクロ	4.2	4.2	4.2	4.3	19,522				10.3	11.2	11,200	27,178	5.5	5.1	20,298	5.5	5.1	20,298		
ユニオンツール	5.1	5.1	5.1	5.2	15,990				17.4	18.9	18,900	86,156	2.7	2.8	5,810	2.7	2.8	5,810		
オイレス工業	14.5	14.5	14.5	16.9	32,160				33.8	34	34,000	17,293	146.7	158.8	594,706	146.7	158.8	594,706		
日精エー・エス・ビー機械	3.8	3.8	3.8	3.5	13,597				11.5	11.4	11,400	20,416	46	53.2	66,287	46	53.2	66,287		
サトーホールディングス	14.8	14.8	14.8	14.6	37,960				18.2	17.6	17,600	157,974	5	5.8	4,657	5	5.8	4,657		
技研製作所	5.7	5.7	5.7	8.5	27,115				112.5	121.8	121,800	8,046	6.4	6.4	17,158	6.4	6.4	17,158		
日本エアテック	3.9	3.9	3.9	3.8	2,150				4.1	4.5	4,500	28,224								
カワタ	-	-	-	2.5	3,192				5.2	5.6	5,600									

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	千円		千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
サンケン電気	66	14.3	31,274	澤藤電機	1.2	1.5	2,512	いすゞ自動車	328.6	387.9	596,978									
ナカヨ	2.2	2.3	3,254	原田工業	—	3.8	3,469	トヨタ自動車	1,378.5	1,367.5	8,991,312									
アイホン	6.4	7	11,886	コーセル	15.7	17	19,720	日野自動車	161.8	153.2	158,715									
リネクスエレクトロニクス	58.7	127	82,423	イリソ電子工業	9.5	11.2	54,320	三菱自動車工業	419.7	454.2	297,046									
セイコーエプソン	168.8	152.2	251,130	新日本無線	6.9	—	—	エフテック	7.3	8.7	7,856									
ワコム	88	88.9	42,583	オプテックスグループ	9.2	21.6	43,329	レックホールディングス	4.1	4.5	3,172									
アルパック	26.1	24.5	88,567	千代田インテグレ	5.5	5.1	9,679	GMB	1.9	2.5	2,335									
アクセル	4.7	5	2,580	アイ・オー・データ機器	4.7	5.1	6,390	ファルテック	2	2.1	1,621									
E I Z O	10.4	11.3	52,488	レーザーテック	23.2	25.1	108,557	武蔵精密工業	12.1	28.9	41,818									
ジャパンディスプレイ	233	290.1	21,177	スタンレー電気	86.7	86.9	278,949	日産車体	44.3	24	23,736									
日本信号	31.3	31.2	30,139	岩崎電気	4.4	4.8	6,518	新明和工業	49.3	57.1	84,508									
京三製作所	27	26.3	10,967	ウシオ電機	68.8	74.5	92,752	極東開発工業	21.1	24.4	37,771									
能美防災	15	16.2	29,824	岡谷電機産業	6.1	8.8	3,440	日信工業	23	22.4	34,563									
ホーチキ	8.2	7.7	8,547	ハリオス テクノ ホールディング	9.7	11.3	7,864	トビー工業	9.3	10.1	24,017									
星和電機	—	4.1	1,881	エノモト	—	2.6	2,202	ティラド	4.1	4.5	10,318									
エレコム	9.8	11.1	35,742	日本セラミック	11.5	12.5	32,637	曙ブレーキ工業	52.7	67.3	11,306									
パナソニック	1,295.4	1,401.8	1,445,956	遠藤照明	5.8	6.3	4,548	タチエス	19.2	20.8	31,304									
シャープ	79	121.8	148,596	古河電池	8.1	8.8	6,441	NOK	60.9	65.9	119,015									
アンリツ	82.7	79	173,879	双信電機	5	5.9	2,041	フタバ産業	34.7	34.1	20,494									
富士通ゼネラル	34.6	37.4	55,426	山一電機	8.2	8.9	11,676	K Y B	11.8	12.8	38,156									
ソニー	757.5	822.6	3,876,913	図研	7.4	7.9	13,003	大同メタル工業	14.3	19.9	15,701									
T D K	59.3	64.2	551,478	日本電子	41	24.2	46,439	プレス工業	60.2	60.8	37,871									
帝国通信工業	5	5.4	6,474	カシオ計算機	91.2	108.5	162,424	ミクニ	14.4	15.5	7,440									
タムラ製作所	43.7	47.2	29,736	ファナック	107.8	116.6	2,191,497	太平洋工業	23.7	25.7	43,355									
アルプスアルパイン	97.7	127.7	294,731	日本シイエムケイ	20	31.2	22,027	ケーヒン	26	28.2	55,159									
池上通信機	36	3.9	4,875	エンプラス	5.1	5.5	16,373	河西工業	13.9	15	13,440									
パイオニア	189	204.5	13,292	大真空	4.2	4.5	4,320	アイシン精機	93.4	101.1	423,103									
日本電波工業	10.3	11.2	4,121	ローム	50.9	59.3	472,028	マツダ	355.9	385.1	500,630									
鈴木	4.5	6.1	3,922	浜松ホトニクス	82.6	88.1	347,554	今仙電機製作所	10.5	11.4	11,662									
日本トリム	2.4	2.4	13,008	三井ハイテック	15	13.6	12,988	日本技研工業	1,020.4	1,035.2	3,107,670									
ローランド ディー・ジィ	5.8	6.3	14,143	新光電気工業	42.8	41.1	31,112	スズキ	224.7	224.5	1,201,299									
フォスター電機	13.3	14.4	23,184	京セラ	186.1	187.1	1,118,858	S U B A R U	352	381	1,027,747									
クラリオン	60	10.7	26,717	太陽誘電	50.9	54.6	111,984	安永	5.5	5.9	8,165									
S M K	29	3.4	8,870	村田製作所	119	128.8	2,239,832	ヤマハ発動機	160.1	173.2	405,288									
ヨコオ	7.4	8.8	13,252	ユーション	17.1	19.4	19,089	ショーワ	29.4	29	44,399									
ティアック	84	8.6	1,788	双葉電子工業	18.5	20	34,920	T B K	13.5	14.8	5,964									
ホシデン	28.6	36.1	29,024	北陸電気工業	4.6	4.6	4,471	エクセディ	13.7	16.6	44,986									
ヒロセ電機	18.3	17.5	208,775	ニチコン	35.7	38.6	33,968	豊田合成	41.2	39.7	93,771									
日本航空電子工業	29	28.2	40,861	日本ケミコン	9.2	8.8	18,576	愛三工業	19.9	19.2	13,996									
T O A	12.2	13.3	14,350	K O A	15.7	18.6	29,536	盟和産業	1.7	1.9	2,014									
マクセルホールディングス	22.5	26.4	42,873	市光工業	17	18.4	11,095	日本プラスト	4.6	9.6	7,228									
古野電気	13.5	15.8	14,804	小糸製作所	67.9	73.6	461,472	ヨロス	11.5	11.5	17,549									
ユニデンホールディングス	31	3.7	7,958	ミツバ	20.9	22.6	14,870	エフ・シー・シー	18.5	22.1	54,940									
アルパイン	27	—	—	SCREENホールディングス	21.5	21.3	106,500	シマン	45.7	49.5	766,755									
スミダコーポレーション	11.6	10.4	12,916	キャノン電子	10.4	11.3	20,611	ティ・エス テック	26.3	28.5	93,907									
アイコム	6.3	6.8	14,803	キャノン	610.4	660.6	2,104,011	ジャムコ	5.7	6.2	16,733									
リオン	4.8	5.6	9,895	リコー	340.9	369	426,195	精密機器 (2.0%)												
本多通信工業	8.8	10.5	5,754	象印マホービン	—	22.9	27,182	テルモ	173.8	173.6	1,064,168									
船井電機	11.5	12.5	7,375	MUTOHホールディングス	1.6	1.6	2,982	クリエートメディック	3.8	4.2	4,403									
横河電機	113.5	122.8	252,476	東京エレクトロン	75.6	81.9	1,298,934	日機装	39.2	39.7	38,112									
新電元工業	4	4.4	19,162	輸送用機器 (8.1%)				島津製作所	135.5	157.9	431,698									
アズビル	34	79.2	191,822	トヨタ紡織	33	42.9	75,847	J M S	10.5	11.1	6,604									
東亜ディーケーケー	5.6	6.1	4,855	芦森工業	2.4	2.6	3,868	クボテック	2.5	2.6	988									
日本光電工業	47.4	54.1	178,259	ユニプレス	21.9	23.8	49,789	長野計器	8.9	9.6	8,121									
チノー	3.9	4.3	5,538	豊田自動織機	91.8	99.3	545,157	パイ・テクノロジー	2.7	2.9	46,661									
共和電業	1.3	1.3	4,771	モリタホールディングス	18.2	21.4	37,385	東京計器	7.2	7.7	7,168									
日本電子材料	4.5	4.7	3,600	三櫻工業	14.4	15.5	8,990	愛知時計電機	1.5	1.6	6,040									
堀場製作所	22.5	24.3	136,323	デンソー	251.6	270.2	1,256,159	インターアクション	4.4	6.5	14,306									
アドバンテスト	63.2	83.6	211,173	東海理化電機製作所	29.8	32.3	61,757	オーバル	11.2	11.7	2,819									
小野測器	4.8	5.7	3,442	三井E&Sホールディングス	41	44.3	56,571	東京精密	20.5	22.2	71,262									
エスピーク	10.1	10.9	21,898	川崎重工業	88.2	95.5	270,074	マニー	13.8	14.9	71,296									
キーエンス	55.7	60.2	3,748,052	名村造船所	34	36.8	15,787	ニコン	197.6	213.8	393,819									
日置電機	5.9	6.4	28,672	サバイスホールディングス	13.8	16.3	2,917	トプコン	60.9	65.8	97,976									
シスメックス	88.2	95.6	590,425	日本車輛製造	41	4.5	11,209	オリンパス	168.9	182.8	848,192									
日本マイクロナクス	19.7	19.8	17,740	三菱ロジスネクスト	13.5	14.6	20,162	理研計器	10.8	10.9	22,127									
メガチップス	8.9	9.7	20,321	近畿車輛	1.7	1.9	3,762	タムロン	9.1	10.9	19,140									
OBARA GROUP	6.6	7.1	25,666	日産自動車	1,337.3	1,447.3	1,343,239	H O Y A	230.9	247.1	1,628,389									

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	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
			千株	千円				千株	千円				千株	千円
シード	1.2		5.2	6,744	電気・ガス業 (2.0%)					SGホールディングス	76.1		109.8	327,423
ノーリツ鋼機	11.5		9.7	18,274	東京電力ホールディングス	905.1	979.5	658,224		海運業 (0.2%)				
エー・アンド・デイ	10.4		11.2	7,873	中部電力	346.9	375.4	627,481		日本郵船	89.8	97.1		175,945
朝日インテック	—		52	254,280	関西電力	462.7	500.7	792,107		商船三井	67.9	69		182,714
シブズン時計	135.3	134.2	77.567		中国電力	156.7	169.6	249,481		川崎汽船	49.6	35.8		55,704
リズム時計工業	4.3		4.1	7,080	北陸電力	111.1	120.1	105,808		NSユナイテッド海運	5.1	6.4		16,832
大研医器	10.1		9.8	5,870	東北電力	265.5	287.4	408,108		明治海運	11.4	12.1		4,271
メニコン	15.6		16.8	45,578	東国電力	102.1	110.5	157,020		飯野海運	54.7	55		21,835
シンシア	—		1.9	934	九州電力	250.4	252.9	334,839		共栄タンカー	0.8	0.8		1,216
松風	5.6		6.2	7,526	北海道電力	113.7	114.8	89,544		乾汽船	8.3	10.4		7,415
セイコーホールディングス	17.5		19	44,384	沖縄電力	18.3	22.7	46,716		空運業 (0.6%)				
ニプロ	78.5	84.9	118,605		電源開発	90.2	97.7	269,358		日本航空	199.2	212.8		856,732
その他製品 (2.0%)					エフオン	5.7	7.3	6,635		ANAホールディングス	210.5	212.5		862,112
中本パックス	1.1	3.4	5,531		イーレックス	17.8	21.3	14,079		パスコ	10	2.3		1,948
スノーピーク	3.5	4.5	5,598		レノバ	—	12.7	13,881		倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
バラマウントベッドホールディングス	12	14.1	65,071		東京瓦斯	241.9	240.7	699,835		トランコム	3	3.3		21,912
トランザクション	5.1	6.7	4,817		大阪瓦斯	220	238	514,318		日新	9.3	10		19,050
S HO - B I	3.9	3.5	1,221		東邦瓦斯	56.2	60.7	279,220		三菱倉庫	37.1	40.2		106,610
ニホンフラッシュ	5.3	5.2	10,618		北海道瓦斯	31	6.6	9,490		三井倉庫ホールディングス	61	14.3		28,585
前田工織	11.4	13.6	37,848		広島ガス	23.4	25.5	8,746		住友倉庫	74	43.7		63,496
永大産業	15	16.4	7,314		西部瓦斯	13.8	13.9	34,597		滋澤倉庫	5.9	6.5		10,192
アートネイチャー	12.1	13.1	8,017		静岡ガス	32.2	37.7	33,628		東陽倉庫	19.5	20.5		6,088
パティタイムホールディングス	117.2	126.8	571,234		メタウオーター	6.4	5.9	18,349		日本トランスシディ	26	25.7		11,256
アイフィスジャパン	2.4	2.7	1,657		陸運業 (4.7%)					ケイヒン	2.1	2.2		2,824
共立印刷	18.9	20.8	4,846		SB Sホールディングス	11.2	12.2	20,081		中央倉庫	6.6	6.9		6,906
S HO E I	5.1	5.8	22,823		東武鉄道	121.2	129.4	390,141		川西倉庫	2.2	2.3		2,716
フランスベッドホールディングス	13.4	17.4	15,068		相鉄ホールディングス	36.3	42.2	135,884		安田倉庫	9.7	9.7		8,516
パイロットコーポレーション	19.8	21.4	113,848		東京急行電鉄	308	333.3	609,272		東洋埠頭	3.2	3.3		4,719
萩原工業	6.3	6.8	11,240		京浜急行電鉄	155.3	168.1	300,562		宇徳	9.4	10.1		5,514
トッパン・フォームズ	24.3	26.3	23,538		小田急電鉄	168.6	196.6	476,165		上組	67.6	71.8		174,545
フジシールインターナショナル	25.4	27.4	110,148		京王電鉄	63.4	68.6	420,518		サンリツ	2.8	2.9		2,012
タカラトミー	47.5	51.4	61,731		京成電鉄	78.9	92	324,760		キムラユニティー	2.9	3.2		3,484
廣済堂	10.6	11.4	8,835		富士急行	15.5	16.7	59,118		キューソー流通システム	3.1	3		6,171
エステールホールディングス	3.4	3.5	2,310		新京成電鉄	2.9	3.1	6,441		近鉄エクスプレス	20.3	22		36,630
アーク	47.9	46.7	4,529		東日本旅客鉄道	203.7	218.2	2,216,912		東海運	6.1	6.3		1,764
タカノ	5	4.9	4,135		西日本旅客鉄道	102.3	110	864,490		エーアイティ	7.7	7.5		7,627
プロネクサス	10.6	10.5	12,201		東海旅客鉄道	101.5	109.9	2,596,387		内外トランスライン	3.8	3.8		5,449
ホクソン	8.2	7.7	1,054		西武ホールディングス	144.5	156.3	302,284		日本コンセプト	2.1	3.2		3,206
ウッドワン	3.8	4	4,148		鴻池運輸	16	19.6	32,594		情報・通信業 (8.4%)				
大建工業	8.8	9.3	17,688		西日本鉄道	31.4	34	91,358		NECネットエスアイ	12.3	13.4		33,567
凸版印刷	320	173.2	309,335		ハマキョウレックス	8	9.4	35,720		システナ	8.9	43		46,784
大日本印刷	148.4	172.9	435,362		サイカイ引越センター	6	6.5	40,365		デジタルアーツ	5.5	6.5		52,195
図書印刷	7.6	11.5	11,097		近鉄グループホールディングス	107.4	116.1	553,797		新日鐵住金ソリューションズ	17.5	18		52,776
共同印刷	3.5	3.9	9,126		阪急阪神ホールディングス	143.2	155	599,850		キューブシステム	6.5	6.4		5,331
N I S S H A	23.3	25.1	36,545		南海電気鉄道	50.9	51.9	151,288		エイジア	1.7	2.4		2,786
光村印刷	1	1	1,964		京阪ホールディングス	47.8	51.8	232,582		コア	4.7	5.1		6,732
宝印刷	5.9	6.4	10,208		神戸電鉄	2.6	3	11,685		ソリトンシステムズ	3.7	6.8		5,691
アックス	112.6	121.9	200,891		名古屋鉄道	83.3	93.1	269,338		ソフトウエアホールディングス	5.4	5.2		7,753
ツツミ	3.5	3.9	7,569		山陽電気鉄道	8.3	9	18,972		T I S	37.1	40.1		199,898
小松ウォール工業	3.8	3.8	7,087		日本通運	42.2	45.6	298,680		ネオス	3.4	4.1		4,239
ヤマハ	76.4	73	382,520		ヤマトホールディングス	188.3	203.7	572,600		電算システム	3.9	4.6		11,012
河合楽器製作所	3.8	3.8	12,711		山丸	27.6	32.3	166,345		グリー	59.6	83.1		38,059
クリナップ	10.5	11.5	7,130		丸運	6	6.2	1,847		キューエックモホールディングス	18.9	24.6		44,722
ビジョン	68.5	74.2	325,738		全昭和運輸	38	9.4	25,774		三菱総合研究所	4.8	4.7		15,345
兼松サステック	0.9	0.8	1,240		セコグループホールディングス	64.6	64.1	54,933		ポルテージ	2.1	2.4		1,360
キングダム	9.4	10.2	8,047		トナミホールディングス	2.6	2.8	16,576		電算	1.3	1.3		2,797
リネット	26.9	29.2	71,335		ニッコンホールディングス	40.8	44.2	120,003		A G S	6.3	6.8		4,549
イトーキ	23.9	22.6	12,723		日本石油輸送	1.3	1.4	3,977		ファインデックス	9.3	10.1		6,787
任天堂	69.8	75.5	2,213,282		福山通運	15.7	14.9	63,325		ヒト・コミュニティソリューションズ	2.5	2.8		4,390
三菱鉛筆	18.7	20.2	46,460		セイノーホールディングス	80.4	87	130,761		ブレインパッド	2.4	2.6		13,390
タカラスタンダード	23.4	25.4	43,357		エスライン	—	3.1	3,468		K L a b	21.6	21.4		18,254
ココヨ	54.4	58.9	94,416		神奈川中央交通	2.7	2.9	10,686		ホルトクワン・ピットホールディングス	8.1	16		13,872
ナカバヤシ	11.1	12.3	6,678		日立物流	23.6	25.6	77,440		イーブイクイニシアティブジャパン	1.8	2		3,054
グローブライド	5.1	5.9	15,027		丸和運輸機関	5.7	6.1	20,831		ネクソン	124	306.6		512,022
オカムラ	39.6	42.9	54,483		C&Fロジホールディングス	11.8	11.9	14,053		アイスタイル	27.9	30.6		25,214
美津濃	11.2	12.2	31,280		九州旅客鉄道	90.1	97.6	348,920		エムアッパ	3.7	4.2		7,492

銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末				
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		
エイチーム		千株	千円		千株	千円	シンクロ・フード		千株	千円		千株	千円	USEN-NEXT HOLDINGS		千株	千円		千株	千円		
テクノスジャパン	7.6	7.5	13,560	7.6	7.5	13,560	オークネット	0.9	5.1	3,366	0.9	5.1	3,366	ワイヤレスゲート	2.9	4.6	4,259	2.9	4.6	4,259		
enish	10.1	10.1	7,787	10.1	10.1	7,787	AOI TYO HOLDINGS	3.5	6.3	6,016	3.5	6.3	6,016	コネクシオ	5.2	5.3	2,803	5.2	5.3	2,803		
コロプラ	3.3	4.2	2,041	4.2	2,041	2,041	マクロミル	9.1	13.1	10,807	9.1	13.1	10,807	日本通信	7.9	8.6	12,160	7.9	8.6	12,160		
モバイルクリエイト	36.1	34.3	24,215	34.3	24,215	24,215	オーロク	10.4	21.3	32,887	10.4	21.3	32,887	クロップス	100.8	102.6	13,030	100.8	102.6	13,030		
オルトプラス	8.6	—	—	—	—	—	オロクシーズ	—	2.3	2,070	—	2.3	2,070	日本電信電話	2.4	2.3	1,559	2.4	2.3	1,559		
ブロードリーフ	5.4	7.3	2,328	7.3	2,328	2,328	ソルクシーズ	—	1.1	5,203	—	1.1	5,203	KDDI	798.5	823.5	3,817,746	798.5	823.5	3,817,746		
クロス・マーケティンググループ	27.6	59.7	33,790	59.7	33,790	33,790	フェイス	4.3	5.1	3,391	4.3	5.1	3,391	ソフトバンク	1,001.9	1,061.1	2,820,934	1,001.9	1,061.1	2,820,934		
デジタルハーツホールディングス	—	3.3	1,188	3.3	1,188	1,188	ハイマックス	3.9	4.2	3,616	3.9	4.2	3,616	光通信	—	957.3	1,250,233	—	957.3	1,250,233		
メディアアドホールディングス	5.9	5.4	7,630	5.4	7,630	7,630	野村総合研究所	1.5	1.5	2,688	1.5	1.5	2,688	NTTドコモ	13.4	14.2	251,766	13.4	14.2	251,766		
じげん	3.6	3.5	8,102	3.5	8,102	8,102	サイバネットシステム	74.4	76.5	318,622	74.4	76.5	318,622	EMUティーアイ	823.7	864.6	2,208,620	823.7	864.6	2,208,620		
プイキューブ	—	12.8	7,347	12.8	7,347	7,347	CEホールディングス	9.2	9.9	6,336	9.2	9.9	6,336	GMOインターネット	15	14.1	8,586	15	14.1	8,586		
サイバーリンクス	6.9	6.3	2,305	6.3	2,305	2,305	日本システム技術	3.2	3.2	2,272	3.2	3.2	2,272	アドマテック	40.5	43.8	68,809	40.5	43.8	68,809		
ディー・エル・イー	1.8	1.9	1,941	1.9	1,941	1,941	インテジホールディングス	1.4	2	3,012	1.4	2	3,012	カドカワ	1.8	2.5	1,245	1.8	2.5	1,245		
フィックスターズ	5.1	7.5	1,110	7.5	1,110	1,110	東邦システムサイエンス	12.8	15.4	13,582	12.8	15.4	13,582	学研ホールディングス	32.4	35.1	41,733	32.4	35.1	41,733		
CARTA HOLDINGS	1.9	11.5	16,157	11.5	16,157	16,157	ソースネクスト	3.8	3.7	3,367	3.8	3.7	3,367	ゼンリン	3.7	4.1	16,810	3.7	4.1	16,810		
オプティム	5.7	6.4	6,752	6.4	6,752	6,752	インフォコム	15.7	46.4	26,030	15.7	46.4	26,030	昭文社	13.5	24	67,248	13.5	24	67,248		
セレス	1.9	2.7	12,312	2.7	12,312	12,312	FIG	—	4.9	19,110	—	4.9	19,110	インプレスホールディングス	5.1	5.4	2,430	5.1	5.4	2,430		
ペリサーブ	3.4	4	6,040	4	6,040	6,040	アルテリア・ネットワークス	—	10.6	3,572	—	10.6	3,572	アイネット	9.5	9.7	1,455	9.5	9.7	1,455		
ティエゴアイ	1.4	1.1	7,348	1.1	7,348	7,348	フォーカスシステムズ	6.3	8	12,285	6.3	8	12,285	松竹	6.3	6.8	9,200	6.3	6.8	9,200		
セック	11.1	12.1	24,030	12.1	24,030	24,030	フジ・メディア・ホールディングス	2.5	3.7	13,061	2.5	3.7	13,061	東宝	7.4	7.9	86,110	7.4	7.9	86,110		
日本アジアグループ	1.1	2	7,440	2	7,440	7,440	オービック	116.5	124.9	199,715	116.5	124.9	199,715	エヌ・ティ・ティ・データ	73.2	79.2	312,048	73.2	79.2	312,048		
豆蔵ホールディングス	11.7	12.8	4,595	12.8	4,595	4,595	ジャストシステム	35.1	41.8	427,196	35.1	41.8	427,196	ピー・シー・エー	4.2	5.1	71,298	4.2	5.1	71,298		
テクノマトリックス	8.3	8.1	8,424	8.1	8,424	8,424	TDCソフト	18.1	17.1	39,723	18.1	17.1	39,723	ビジネスプレイング太田昭	345.6	320.7	379,708	345.6	320.7	379,708		
プロシッパ	6.1	8.6	16,847	8.6	16,847	16,847	ヤフー	4.9	10.5	9,166	4.9	10.5	9,166	DT S	1.7	1.6	3,211	1.7	1.6	3,211		
カネー・オンライン・エンターテイメント	1.6	3.6	4,716	3.6	4,716	4,716	トレンドマイクロ	802.3	785.1	244,166	802.3	785.1	244,166	スウォフ・エニクス・ホールディングス	1.9	2.1	4,111	1.9	2.1	4,111		
GMOペイメントゲートウェイ	301.7	290.2	91,413	290.2	91,413	91,413	インフォメーション・デバイス	54.3	64.2	362,730	54.3	64.2	362,730	シーイーシー	11.6	13.5	56,362	11.6	13.5	56,362		
ザッパラス	7.8	19.8	110,682	19.8	110,682	110,682	日本オラクル	3.5	3.4	5,052	3.5	3.4	5,052	カプコン	51.7	56	186,760	51.7	56	186,760		
システムリサーチ	5.5	5.9	2,194	5.9	2,194	2,194	アルファシステムズ	18	24.4	196,908	18	24.4	196,908	アイ・エス・ビー	6.6	12.9	27,412	6.6	12.9	27,412		
インターネットエンシアティブ	1.1	1.6	4,880	1.6	4,880	4,880	フューチャー	18	24.4	196,908	18	24.4	196,908	ジャステック	23.8	51.6	117,028	23.8	51.6	117,028		
ざくらインターネット	18.1	19.6	52,645	19.6	52,645	52,645	CAC Holdings	3.7	4	10,408	3.7	4	10,408	アイネス	2.2	2.4	4,576	2.2	2.4	4,576		
グインクス	13.3	14.4	6,768	14.4	6,768	6,768	ソフトバンク・テクノロジー	15.1	16.3	28,655	15.1	16.3	28,655	T K C	6.5	7	6,531	6.5	7	6,531		
GMOクラウド	—	4.1	5,174	4.1	5,174	5,174	オービックビジネスコンサルタント	8.4	9.1	8,745	8.4	9.1	8,745	富士ソフト	25.7	31.8	147,075	25.7	31.8	147,075		
SRAホールディングス	2.5	2.7	9,504	2.7	9,504	9,504	伊藤忠テクノソリューションズ	4.7	5.1	10,883	4.7	5.1	10,883	N S D	3.7	4	8,020	3.7	4	8,020		
MINORソリューションズ	5.9	6.4	16,742	6.4	16,742	16,742	アイティフォー	3	3.3	2,719	3	3.3	2,719	コナミホールディングス	14.1	15.2	19,866	14.1	15.2	19,866		
システムインテグレイター	2.2	2.4	3,960	2.4	3,960	3,960	東計電算	5.7	12.4	49,662	5.7	12.4	49,662	日本システムウエア	10.4	10.1	39,491	10.4	10.1	39,491		
朝日ネット	1.6	3.4	2,570	3.4	2,570	2,570	エックスネット	25.3	54.9	138,073	25.3	54.9	138,073	ハウスイ	15.4	18	80,730	15.4	18	80,730		
eBASE	10.2	10.1	5,191	10.1	5,191	5,191	大塚商会	13.6	14.6	12,059	13.6	14.6	12,059	高千穂交易	18.3	19.7	47,063	18.3	19.7	47,063		
アバント	2.2	3.7	6,378	3.7	6,378	6,378	サイボウズ	2	1.8	5,436	2	1.8	5,436	伊藤忠食品	45.5	49.3	217,413	45.5	49.3	217,413		
アドソル日進	—	3.2	4,265	3.2	4,265	4,265	ソフトブレイン	1.8	2.3	1,945	1.8	2.3	1,945	エレマテック	3.2	4	7,256	3.2	4	7,256		
フリービット	4.3	4.3	7,271	4.3	7,271	7,271	電通国際情報サービス	33.4	65.1	262,027	33.4	65.1	262,027	J B Cホールディングス	8.8	9.5	16,216	8.8	9.5	16,216		
コムチュア	7.4	7.9	7,394	7.9	7,394	7,394	インターネットガレージ	14.9	14.1	8,939	14.9	14.1	8,939	ソフトバンクグループ	9.8	12	30,672	9.8	12	30,672		
サイバーコム	5.7	6.7	19,892	6.7	19,892	19,892	イーエムシステムズ	8.9	9.5	4,854	8.9	9.5	4,854	卸売業 (5.1%)	503.7	503.2	5,012,878	503.7	503.2	5,012,878		
アステリア	2	2.2	5,152	2.2	5,152	5,152	C I J	6.9	7.4	23,680	6.9	7.4	23,680	ハウスイ	0.9	0.9	784	0.9	0.9	784		
マークライズ	—	5.9	4,979	5.9	4,979	4,979	東洋ビジネスエン지니어リング	20	23.5	66,881	20	23.5	66,881	高千穂交易	66.881	4.3	4.7	4,667	66.881	4.3	4.7	4,667
メディカル・データ・ビジョン	—	4.2	6,102	4.2	6,102	6,102	日本エンタープライズ	3.9	9.7	10,912	3.9	9.7	10,912	伊藤忠食品	10.912	2.7	2.9	13,862	10.912	2.7	2.9	13,862
gumi	4.2	10.6	10,250	10.6	10,250	10,250	WOWOW	3.8	4.1	11,955	3.8	4.1	11,955	エレマテック	4.1	5.6	10,242	4.1	5.6	10,242		
ショーケース・ティービー	12.8	13.9	8,896	13.9	8,896	8,896	スカラ	8.8	9.5	7,666	8.8	9.5	7,666	J A L U X	5.2	3.4	8,466	5.2	3.4	8,466		
モバイルファクトリー	2.1	2.6	1,781	2.6	1,781	1,781	IMAGICA GROUP	1.1	1.1	2,106	1.1	1.1	2,106	あらた	3.2	3.7	29,111	3.2	3.7	29,111		
テラスカイ	2.2	3.3	5,388	3.3	5,388	5,388	ネットワンシステムズ	11.7	12.7	2,298	11.7	12.7	2,298	トーメンデバイス	2.9	6.8	4,542	2.9	6.8	4,542		
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	—	0.7	2,863	0.7	2,863	2,863	システムソフト	5.3	5.7	16,455	5.3	5.7	16,455	東京レトロン デバイス	1.7	1.9	4,478	1.7	1.9	4,478		
PCIホールディングス	1.7	5.3	6,927	5.3	6,927	6,927	アルゴグラフィックス	7.8	9.7	7,207	7.8	9.7	7,207	フィールズ	4	4.4	8,078	4	4.4	8,078		
パイプHD	1.9	2.2	5,123	2.2	5,123	5,123	マーベラス	9.4	10.2	5,344	9.4	10.2	5,344	双日	8.5	10.5	6,709	8.5	10.5	6,709		
アイビシー	1.8	2	1,780	2	1,780	1,780	エイベックス	45.4	42.7	107,219	45.4	42.7	107,219	アルフレッサ ホールディングス	660.7	667.4	274,968	660.7	667.4	274,968		
ネオジャパン	1.2	2	2,574	2	2,574	2,574	兼松エレクトロニクス	26.5	29.1	2,880	26.5	29.1	2,880	横浜冷凍	124.1	134.3	398,736	124.1	134.3	398,736		
P R T I M E S	—	2.																				

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末				
	株	数	価 額	株	数	価 額		株	数	価 額	株	数	価 額		株	数	価 額	株	数	価 額		
		千株	千円		千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
メディアスホールディングス	1.8	6.7	4,549				三井物産	948.7	995.7	1,737,496				加藤産業	17.4	18.9	61,708					
UKCホールディングス	7.2	7.7	15,423				日本紙パルプ商事		5.8	6.9	28,566			北恵	-	2.3	2,168					
ジュテックホールディングス	2.6	2.7	2,716				日立エレクトロロジーズ	38.8	36.7	155,791			イノテック	9.7	8.3	8,573						
大光	2.6	3	1,818				カメイ	14.5	15.8	18,391			エレクトロハット	10.5	11.4	31,156						
OCHIホールディングス	3.2	3.4	3,872				東都水産	1.7	1.8	4,467			J Kホールディングス	11.2	11.1	6,282						
TOKAIホールディングス	59	63.9	56,679				OUGホールディングス	1.8	2.1	5,115			日伝	9.3	10	15,630						
黒谷	-	2	980				スターゼン	4.4	4.5	18,090			北沢産業	9.5	9.2	2,668						
Cominix	1.7	1.9	1,565				山善	43.6	47.2	51,967			杉本商事	6	6.6	11,424						
三洋貿易	6.1	6.1	10,980				椿本興業	2.5	2.7	9,895			因幡電機産業	14.7	17.1	78,660						
ピューティガレージ	1.5	1.8	2,853				住友商事	704.4	714.7	1,159,600			パイテックホールディングス	5.1	5.4	10,989						
ワイン・パートナーズ	8.1	7.8	8,447				内田洋行	5.1	5.5	12,303			東テク	3.7	4.1	9,343						
ミタチ産業	2.6	2.9	2,114				三菱商事	783.7	848	2,676,288			ミスミグループ本社	129.6	151.3	394,439						
シッパヘルスケアホールディングス	23.3	25.1	103,286				第一実業	5.1	5.5	19,112			アルテック	9.6	8.7	1,931						
明治電機工業	3.8	3.9	6,961				キャノンマーケティングジャパン	31.9	34.5	70,207			タキヒヨー	3.7	3.8	6,809						
デリカフーズホールディングス	2.2	2.2	2,981				西華産業	6.9	6.8	10,329			戴王産業	1.8	2.1	2,679						
スターティアホールディングス	2.5	2.4	1,430				佐藤商事	10	10.9	9,690			スズケン	50.9	55.1	307,458						
コメダホールディングス	20.6	27.7	58,391				菱洋エレクトロ	10.4	12.3	18,474			ジェコス	7.7	8.5	8,882						
富士興産	4.1	4.6	2,953				東京産業	11.1	12.1	6,449			ルネサスイーストン	10.2	11.2	4,816						
協栄産業	1.4	1.4	2,114				ユアサ商事	10.6	12.4	41,044			小売業 (4.9%)									
小野建	9.7	10.6	17,797				神鋼商事	2.5	2.7	6,814			ローソン	28.3	30.6	204,102						
南陽	-	2.5	5,597				小林産業	7.6	7	1,953			サンエー	8.4	9.2	40,296						
佐鳥電機	8.2	9	8,379				阪和興業	20.9	21	61,551			カワチ薬品	8.7	9.4	19,270						
エコトレードディング	2.5	2.6	1,565				正栄食品工業	6.2	6.4	18,137			エービーシー・マート	20.3	18.9	118,125						
伯東	6.8	8.3	9,835				カナデン	10.7	11.7	14,601			ハードオフコーポレーション	4.9	4.8	3,926						
コンドーテック	8.9	9.4	9,099				菱電商事	8	9.6	13,324			アスフル	9.7	12.7	26,847						
中山福	6.4	6.6	3,445				フルサト工業	6.1	6.7	10,880			ゲオホールディングス	20.4	18.4	29,697						
ナガイレーベン	14.8	17.4	38,367				岩谷産業	24.8	26.7	98,256			アダストリア	17.2	16.7	31,963						
三菱食品	12.3	13.4	39,114				すてきナイスグループ	4.8	5	4,315			ジューソフト	6.7	7.4	4,972						
松田産業	8.1	8.9	12,807				昭光通商	40	4.4	2,802			シー・ワイ・エス・ベイエリア	1.5	1.5	1,132						
第一興商	16.6	18	93,960				ニチモウ	1.7	1.9	3,629			くらコーポレーション	6.6	7.1	39,334						
メディアルホールディングス	111.9	130.5	329,121				極東貿易	16	16.8	6,156			キャンドゥ	5.3	5.7	8,778						
S P K	2.4	2.5	5,690				イワキ	16	3.5	5,727			パルグループホールディングス	5.7	6.2	18,817						
親原電気ホールディングス	3.8	4.5	12,586				三菱石油	30	32.4	30,067			エディオン	43.4	51.1	50,078						
アズワン	8.7	8.7	68,730				稲畑産業	26.8	29	45,037			サーヨーポレーション	19.2	24.5	13,989						
スズデン	3.9	4.3	6,798				G S Iクレオス	3	3.2	3,872			ワッツ	4.5	4.1	2,984						
尾家産業	3.3	3.4	3,940				明和産業	10.4	11.4	4,753			ハロース	4.2	4.6	10,483						
シモジマ	6.8	7.4	8,443				ワキタ	23.8	25.8	29,695			あみやき亭	2.4	2.7	9,612						
ドウシシャ	11.8	11.4	18,559				東邦ホールディングス	33.1	35.8	93,080			ひらまつ	15.4	24.1	8,194						
小津産業	2.5	2.6	4,836				サンゲツ	37.7	36.5	74,679			大黒天物産	2.7	2.8	11,172						
高速	6.6	7.3	7,738				ミツコグループホールディングス	16.2	17.5	14,000			ハニースホールディングス	10.8	11.8	11,174						
たけびし	3.9	4.3	5,981				シナネホールディングス	5.3	5	11,035			ファーマイズホールディングス	2.6	2.7	1,514						
リックス	2.5	2.7	4,106				伊藤忠エネクス	24.7	26.6	24,259			アルペン	8.6	9.3	15,345						
丸文	9.9	10.7	7,564				サンリオ	31.4	37.3	82,507			ハブ	2.1	3.9	3,673						
ハピネット	7.6	10.1	15,846				サンワ テクノス	6.6	7.3	6,891			クオールホールディングス	12.3	17.7	25,257						
橋本総業ホールディングス	2.3	2.4	3,410				リョーサン	14	13.4	41,071			ジンズ	7.6	8.1	42,444						
日本ライフライン	31.8	37.9	58,972				新光商事	12.3	11.4	21,181			ビッツカメラ	64.7	64.5	79,722						
タカショー	-	6.1	2,641				トーホー	5	5.5	11,297			DCMホールディングス	60.2	65.1	72,521						
エクセル	4.5	4.5	9,553				三信電気	10.3	10	18,090			ペッパーフードサービス	6	9.5	24,434						
マルカカイ	3.6	4	7,836				東陽テクニカ	12.9	14	12,166			Monotaro	39.7	76.3	182,662						
I DOM	33.9	40.7	16,402				モスフードサービス	14.6	15.9	43,263			東京一番フーズ	2.5	2.5	1,487						
日本エム・ディ・エム	7.5	7	7,476				加賀電子	10.1	12.1	24,611			DDホールディングス	2.4	2.7	5,548						
進和	6.6	7.1	14,966				ソーダニッカ	11.6	12.7	6,896			きちりホールディングス	3.1	3.1	2,157						
エスケイジャパン	2.4	2.9	1,844				立花エレテック	7.6	9	13,986			アークソフサービスホールディングス	9.3	8.9	18,245						
ダイトロン	5.1	5.5	7,694				フォーバル	4.9	5.3	4,478			J. フロンティアリング	133.4	154.5	186,945						
シークス	7.1	15.3	23,454				P A L T A C	15.7	21.8	115,758			ドット・ビレスホールディングス	19.6	21.2	44,583						
田中商事	3.5	3.7	2,205				三谷産業	12.1	14.4	3,916			マツモトキヨシホールディングス	46.2	50	167,250						
オーハシテクニカ	6.3	6.8	9,520				太平洋興発	4.7	4.9	3,572			ブロンコピラー	5.8	6.3	16,317						
白銅	4	4	6,724				西井Smelltecホールディングス	2.3	2.8	13,258			ZOZO	109.7	130.6	234,427						
伊藤忠商事	819.6	845.4	1,716,584				ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	0.9	1,215			トレジャー・ファクトリー	3.3	3.7	2,889						
丸紅	917.8	1,191.9	991,660				国際紙パルプ商事	-	21.2	5,702			物語コーポレーション	3.2	3.4	32,164						
高島	1.9	2	3,604				ヤマタセ	5.6	6.1	10,339			ココカラファイン	11.7	13.6	65,824						
長瀬産業	67.3	68	112,132				丸紅建材リース	11	1.1	2,084			三起伊勢丹ホールディングス	208.8	225.9	241,261						
蝶理	7.1	7.7	11,719				日鉄住金物産	8.7	8.7	40,194			H a m e e	2.8	3.1	2,523						
豊田通商	124.6	134.9	450,566				泉州電業	3.7	4.1	10,475			ウエルシアホールディングス	29.5	32	130,240						
三共生興	18.9	20.7	8,507				トラスコ中山	23.2	25.1	79,316			クリエイトSDホールディングス	16.5	17.7	48,816						
兼松	47.6	48.3	61,292																			

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
ティールライフ	千株	千株	千円	VTホールディングス	千株	千株	千円	愛眼	千株	千株	千円
エー・ピーカンパニー	1.5	1.6	1,427	鯨魚	37.8	41	17,015	ケーユーホールディングス	9.1	9.7	2,919
チムユー	2.2	2.3	1,053	ポブラ	3.1	3.4	4,851	吉野家ホールディングス	5.8	6.2	4,848
シュッピン	3.4	3.8	9,591	フジ・コーポレーション	3	3.1	1,819	松屋ホールディングス	36.7	42.3	74,659
ネクステージ	6.8	8.1	5,904	ユナイテッドアローズ	1.9	2.5	5,120	関西スーパーマーケット	5.4	5.8	20,590
ジョイフル本田	11.4	18.6	17,279	ハイデイ日高	13.8	13.9	52,333	サガミホールディングス	14.9	16.2	21,448
扇真族	16.4	35.4	48,568	京都きもの友禅	12.2	15.9	34,757	王将フードサービス	8.4	9.2	9,089
キリン堂ホールディングス	4.1	4	7,024	ココロイド	7.3	7.7	3,226	プレナス	8.2	8.9	63,813
ホットランド	3.9	4.8	6,897	ピーシーダゴコーポレーション	37.1	40.2	94,952	ミニストップ	12.5	13.6	24,792
すかいらーくホールディングス	6.5	6.3	7,938	トッパカルチャー	16.7	16	6,960	アークス	8.3	9	17,379
綿半ホールディングス	69.3	112.6	204,256	P L A N T	7.9	8.6	39,259	パローホールディングス	20.9	22.7	55,319
ヨシックス	4.2	4.5	9,103	スキホールディングス	4.1	4.6	1,329	藤久	26	26.1	70,835
コナカ	1.8	2	6,060	グイア・ホールディングス	2.6	2.9	2,917	ベルク	0.9	0.9	674
ブックオフコーポレーション	37.1	35.2	41,360	スクロール	24.5	26.5	121,502	大 庄	5	5.9	28,674
ゴルフダイジェスト・オンライン	6.4	-	-	ユンディーホールディングス	9.8	14.8	9,723	ファーストリテイリング	6	6.5	9,925
B E E N O S	4.5	4.9	3,332	ユニバーサルホールディングス	17.4	18.6	7,235	サンドラッグ	18.7	16.2	777,924
あさひ	1.5	2.8	3,029	エー・ファミリーマートホールディングス	11.4	13.5	29,038	サックスホールディングス	47.3	45.4	157,084
日本調剤	8.3	10	15,080	木曾路	35.7	33.8	425,880	ヤマザウ	10.5	10.2	11,046
コスモス薬品	3.9	4.3	16,813	S R Sホールディングス	13.7	14.8	36,570	やまや	2.3	2.4	4,260
トーエル	5.6	5.3	109,816	千趣会	13.2	14.3	14,271	ペルーナ	2.3	2.1	4,741
一六堂	5.5	5.8	4,007	タカキュー	20.2	21.9	5,037	島根銀行	27.4	29.6	25,633
オンリー	2.5	-	-	ケーユー	9	9.2	1,692	じもとホールディングス	2.4	2.7	1,871
セパン&アイ・ホールディングス	1.7	2.2	2,217	上新電機	20.7	22.4	11,760	めざきフィナンシャルグループ	75.7	82.1	9,852
薬王堂	468.1	506.6	2,415,468	日本瓦斯	13.2	14.3	33,161	東宝ホールディングス	581.1	628.6	184,808
クイート・レストランホールディングス	4.9	5.2	13,119	ライオンホールディングス	20.5	19.6	81,046	九州フィナンシャルグループ	15.1	16.3	25,313
ツルハホールディングス	30	32.6	40,424	東天虹	19.8	21.4	56,538	ゆうちょ銀行	183.4	198.5	87,538
サンマルクホールディングス	24.2	26.2	259,380	いなげや	0.8	0.8	1,038	富士第一銀行	316.8	343.1	430,247
フェリシモ	8.8	9.5	23,674	島忠	12.4	13.6	18,890	ココロシティフィナンシャルグループ	28.5	29.2	11,008
トリドールホールディングス	2.9	2.7	2,926	チヨダ	27	27.3	83,811	西日本フィナンシャルホールディングス	680	770.7	339,878
TOKYO BASE	13.8	14.9	29,338	ライフコーポレーション	13.2	12.7	23,583	関西フィナンシャルホールディングス	75.8	77.4	74,304
TOKYO BASE	2.2	10.7	9,223	リンガーハット	8.5	9.2	22,512	三十三フィナンシャルグループ	-	56.8	45,326
ウィルプラスホールディングス	-	1.1	843	さが美グループホールディングス	13.8	14.9	34,985	野村ホールディングス	-	10.4	16,650
ジャパネット	-	4.6	7,787	Mr Ma x HD	10	-	-	野村ホールディングス	-	21	62,958
サツドラホールディングス	1.5	2	3,666	テナアライド	14	16.6	8,316	新生銀行	96.8	88.8	128,582
デファクトスタンダード	-	0.7	277	AOKIホールディングス	10.6	11.5	4,531	あおぞら銀行	66.6	67.5	210,600
ダイエー・リテールホールディングス	5.2	6.5	6,376	オーワーク	22.3	24.2	30,371	三井住友フィナンシャルグループ	7,901.7	8,428.8	4,872,689
パロックスジャパンリミテッド	8.9	9.7	8,778	コムリ	16	17.2	17,905	りそなホールディングス	1,227.4	1,328	687,505
グスリのアオキホールディングス	8.9	12	86,520	青山商事	17.2	18.7	51,574	三井住友トラスト・ホールディングス	219.9	237.9	971,107
カノ源ホールディングス	-	3.4	2,652	しまむら	21.4	21.1	57,265	三井住友フィナンシャルグループ	846.5	853	3,350,584
スゴローホールディングス	10.7	13.3	86,450	はせがわ	13	14.1	133,950	第四銀行	13.7	-	-
L I X I L ビバ	10.6	10.2	14,983	高島屋	5.9	6.1	2,403	北越銀行	11.2	-	-
メディカルシステムネットワーク	12.7	12.9	5,830	松屋	175	94.7	135,610	千葉銀行	401	428.7	288,943
総合メディカル	4.9	-	-	エチ・ツー・オー リテイリング	22.5	24.3	25,636	群馬銀行	227.1	242	112,046
はるやまホールディングス	5.2	5.5	4,526	近鉄百貨店	52.9	62.1	95,261	武蔵野銀行	17.8	18	43,182
ノジマ	19.6	21.6	42,098	パルコ	4.3	4.7	15,933	千葉興業銀行	30.8	33.3	11,322
カッパ・クリエイト	13.9	16.9	23,085	丸井グループ	10.7	11.7	12,343	筑波銀行	46.6	50.4	10,735
ライトオン	9.4	10.2	8,282	アクシアル リテイリング	107	102.3	206,134	七十七銀行	35.1	37.9	68,182
ジーンズメイト	3.4	3.7	1,439	井筒屋	9.3	10	34,350	青森銀行	8.7	9.4	24,947
良品計画	14.8	17.1	458,622	イオン	6.3	6.4	1,267	秋田銀行	7.2	7.7	16,285
三城ホールディングス	13.8	15.1	6,160	イズミ	429.7	465.1	1,040,196	山形銀行	12.6	13.7	26,098
アドヴァン	11.4	18.6	18,432	東武ストア	20.2	24.5	130,830	岩手銀行	7.8	8.5	27,497
アルビス	2.5	4.6	10,925	平和堂	1.3	-	-	東北銀行	99.9	108.2	32,676
コナカ	14.3	15.7	6,923	フジ	22.7	24.5	61,127	みちのく銀行	5.8	6.3	6,659
ハウス オブ ローゼ	3.4	1.5	2,755	ヤオコー	13.1	14.6	26,980	ふくおかフィナンシャルグループ	7.2	7.7	12,435
G-7ホールディングス	1.3	3.5	8,011	ゼビオホールディングス	12.7	13.8	80,454	静岡銀行	454	98.3	229,235
イオン北海道	11.2	12.3	9,692	ケーズホールディングス	15.2	14.6	18,746	十六銀行	29.5	30.4	263,088
コジマ	19.3	17.7	10,389	オリンピックグループ	47.3	125.5	122,864	スルガ銀行	15	16.2	36,693
ヒマラヤ	3.1	3.9	3,900	日産東販ホールディングス	6.6	7.1	4,671	八十二銀行	202.4	218.9	56,407
コーナン商事	15.9	15.9	43,375	Genky DrugStores	16.4	18.2	5,733	山梨中央銀行	69	15	19,980
エコス	4.5	4.5	7,533	総合メディカルホールディングス	4.4	4.7	12,464	大垣共立銀行	17.7	19.1	42,764
ワタミ	13.2	15.9	22,371	フックオフグループホールディングス	-	10.5	20,065	福井銀行	9.6	10.3	15,851
マルシェ	3	3.3	2,557	アインホールディングス	-	6.4	4,876	北國銀行	12.7	12.9	42,183
パルティフィイング・システムホールディングス	72.4	72.5	475,600	元気寿司	15	16.2	125,712	清水銀行	3.8	5	8,075
西松屋チェーン	24.5	26.5	23,691	ヤマダ電機	2.8	3.4	12,920	富士銀行	2.2	2.3	7,003
センショーホールディングス	57.9	57	133,608	アークランドサカモト	374.3	368	193,568	滋賀銀行	105	24.2	59,532
幸楽苑ホールディングス	7.1	7.6	17,145	ニトリホールディングス	18.9	20.5	29,048	南都銀行	13.1	14.2	31,012
ハウクフレイ	2.7	2.7	3,015	グルメ軒屋	44.3	52.4	739,364				
サイゼリヤ	16.6	19.9	40,755		8	8.8	9,970				

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	千 円		株 数	株 数	評 価 額	千 円		株 数	株 数	評 価 額	千 円
百五銀行	107.3	108.8	40,256	40,256	保険業 (2.3%)					シーアールイー	1.8	1.8	3,612	
京都銀行	42.7	43.4	194,649	194,649	かんぽ生命保険	42.2	45.7	113,244	113,244	プロバリエーション	-	-	1,100	
紀陽銀行	42.2	42.9	65,250	65,250	SOMPホールディングス	219.3	213.3	853,839	853,839	ケイイスター不動産	4	3.2	6,092	
三重銀行	5	-	-	-	アニコム ホールディングス	7.6	9.4	27,664	27,664	アグレ都市デザイン	-	-	1.5	
ほくほくフィナンシャルグループ	74.4	80.6	97,284	97,284	MSADインフラストラクチャーホールディングス	292.4	316.5	1,019,763	1,019,763	グッドコムアセット	-	-	2.2	
広島銀行	165.1	178.5	107,635	107,635	ソニーフィナンシャルホールディングス	91.9	99.4	208,143	208,143	ジェイ・エス・ビー	-	-	0.4	
山陰合同銀行	66.3	71.8	54,137	54,137	第一生命ホールディングス	632.7	684.7	1,195,143	1,195,143	パーク24	62	70.6	184,124	
中国銀行	77.3	78.1	78,334	78,334	東京海上ホールディングス	421.3	438.8	2,343,630	2,343,630	パラカ	3.6	3.1	5,266	
鳥取銀行	3.6	4.3	5,779	5,779	T&Dホールディングス	345.9	374.2	506,105	506,105	三井不動産	558.5	642.2	1,702,793	
伊予銀行	159.6	160.3	95,218	95,218	アドバンスクリエイト	2.6	2.8	4,958	4,958	三菱地所	832.5	847.9	1,617,793	
百十四銀行	119	12.9	31,243	31,243	その他金融業 (1.2%)					平和不動産	19.8	23	47,564	
四国銀行	17.1	17.3	17,697	17,697	全国保証	31.5	34.1	133,331	133,331	東京建物	122.2	132.2	176,883	
阿波銀行	90	19.4	58,976	58,976	ジェイリース	-	2.6	949	949	ダイビル	28.8	35.6	38,092	
大分銀行	6.4	7.4	24,198	24,198	イントラスト	-	3.4	1,485	1,485	京阪神ビルディング	18.6	21.7	19,356	
宮崎銀行	7.4	8	21,120	21,120	日本モーゲージサービス	-	1.6	2,118	2,118	住友不動産	268	272	1,120,640	
佐賀銀行	6.8	7.3	12,577	12,577	CASA	-	4.1	4,739	4,739	大京	17.8	-	-	
十八銀行	69	7.4	19,158	19,158	アルヒ	9.6	11	25,300	25,300	テーオーシー	38.6	27.7	22,935	
沖縄銀行	10.9	11.1	34,798	34,798	プレミアグループ	-	2.5	7,975	7,975	東京楽天地	1.8	1.9	8,787	
琉球銀行	21.7	27.9	29,685	29,685	クレディセゾン	84.9	84.7	118,749	118,749	レオパレス21	133.5	149.3	76,889	
セブン銀行	419.5	408.8	139,400	139,400	アクリーティブ	6.3	-	-	-	スターツコボレーション	15.2	16.4	40,508	
みずほフィナンシャルグループ	15,195.2	16,445.7	2,851,684	2,851,684	芙蓉総合リース	12.8	13.9	75,338	75,338	フジ住宅	14.3	15.4	13,167	
高知銀行	4.1	4.5	3,312	3,312	興銀リース	21	22.7	57,113	57,113	空港施設	11.7	14.4	7,804	
山口フィナンシャルグループ	105	151.1	165,152	165,152	東京センチュリー	22.5	24.4	122,976	122,976	明和地所	6.2	6.7	4,087	
長野銀行	3	4.1	6,154	6,154	日本証券金融	45.8	53.3	32,353	32,353	ゴールドクレスト	8.8	9.5	15,333	
名古屋銀行	9.7	9.8	31,556	31,556	アイフル	187.8	184.4	51,263	51,263	日本エスリード	4.4	4.7	7,440	
北洋銀行	168.6	182.3	51,773	51,773	リコーリース	8.8	9.5	32,347	32,347	日神不動産	14.9	17.8	7,938	
愛知銀行	3.8	4.4	14,960	14,960	イオンフィナンシャルサービス	79.4	77.2	162,274	162,274	日本エスコ	20.1	21.9	17,979	
第三銀行	6.3	-	-	-	アコム	224.9	243.2	88,768	88,768	タカラレーベン	52.4	56.6	19,753	
中京銀行	4.6	5	10,660	10,660	ジャックス	13.6	13.4	25,285	25,285	サンヨーハウジング名古屋	5.8	6.8	6,276	
大光銀行	3.8	4	6,564	6,564	オリエントコーポレーション	242.1	327.1	39,906	39,906	イオンモール	72.1	60.6	111,988	
愛媛銀行	15.6	16.9	17,491	17,491	日立キャピタル	30.8	28.6	70,070	70,070	ファースト住建	4.2	4.6	5,345	
トマト銀行	4.3	4.8	5,020	5,020	アプラスフィナンシャル	54.4	58.7	4,813	4,813	ランド	241.4	492.6	4,433	
みなと銀行	10.1	-	-	-	オリックス	746	807.5	1,328,337	1,328,337	カチサ	11.4	13.5	47,452	
京葉銀行	99	53.4	34,977	34,977	三菱UFJリース	283.9	273.1	153,209	153,209	トーセイ	13.6	16.6	17,944	
関西アーバン銀行	15.6	-	-	-	九州リースサービス	4.8	5.9	4,082	4,082	穴吹興産	1.2	1.3	3,602	
栃木銀行	57.9	62.7	14,295	14,295	日本取引所グループ	328.6	326.8	615,691	615,691	エヌ・ティ・ティ都市開発	69.5	-	-	
北日本銀行	3.5	3.9	7,959	7,959	イー・ギャランティ	3	11.3	12,068	12,068	サンフロンティア不動産	12.6	16.7	20,958	
東和銀行	19.6	21.2	14,416	14,416	アサックス	1.6	4.9	2,631	2,631	エフ・ジェー・ネクスト	8.6	10.5	9,114	
福島銀行	10.6	10.5	4,021	4,021	NE(キャピタルソリューション)	4.6	5	8,020	8,020	インテリクス	3.2	3.5	2,271	
大東銀行	5.4	5.8	3,520	3,520	不動産業 (2.5%)					ランドビジネス	6.9	6.2	4,817	
トモニホールディングス	92.2	93.5	36,839	36,839	いちご	159.8	153.9	57,712	57,712	ブランドハウス	9.9	10.6	4,526	
フィデアホールディングス	108.6	117.8	15,903	15,903	日本駐車場開発	135.1	145.8	23,328	23,328	日本空港ビルディング	32.7	38.6	165,015	
池田泉州ホールディングス	118.6	128.5	38,164	38,164	ヒューリック	233.5	252.6	252,600	252,600	サービス業 (4.8%)				
証券・商品先物取引業 (0.8%)					三栄建築設計	4.5	4.9	8,202	8,202	日本工営	7.3	7.8	19,624	
FPG	39.1	38.7	39,938	39,938	スター・マイカ	4.1	5.5	8,019	8,019	LIFULL	37.7	40.7	27,798	
マセキアインベストメント	2.3	4.7	3,431	3,431	野村不動産ホールディングス	74.4	80.6	172,967	172,967	ジェイエイチリートメント	8.7	9.4	21,291	
SBIホールディングス	126.5	144.2	317,384	317,384	三重交通グループホールディングス	22.7	24.6	15,055	15,055	日本M&Aセンター	37.5	87.3	247,320	
日本アジア投資	10.1	10.5	2,089	2,089	サムティ	9.5	16.7	24,949	24,949	メンバーズ	2.7	4	5,588	
ジャフコ	16.1	19.8	74,646	74,646	ディア・ライフ	11.3	15.4	6,945	6,945	中広	1.2	1.1	612	
大和証券グループ本社	957	971.1	541,776	541,776	コーセーアールイー	1.9	3.7	2,793	2,793	タケエイ	11.3	12.2	9,064	
野村ホールディングス	1,924	2,129.4	925,224	925,224	エー・ディー・ワークス	150	171.5	5,831	5,831	E・Jホールディングス	-	-	1.5	
岡三証券グループ	95	103.1	48,766	48,766	日本商業開発	6.3	7.5	11,392	11,392	トラスト・テック	4.9	5.6	18,452	
丸三証券	35.6	35.9	28,684	28,684	フレックスコーポレーション	15.3	19.1	29,261	29,261	コジカホールディングス	5.7	31.3	50,048	
東洋証券	40	43.4	7,030	7,030	エニソホールディングス	13.1	18.3	39,820	39,820	アルトナー	-	-	2.2	
東海フィナンシャルホールディングス	123.8	144.3	67,676	67,676	THEグローバル社	5.3	5.5	2,695	2,695	パソナグループ	10.3	14.3	19,919	
光世証券	2.7	2.9	2,108	2,108	日本管理センター	7.4	7.9	6,809	6,809	CDS	3	2.9	3,262	
水戸証券	34.7	35.1	9,126	9,126	サンセイラディック	3.3	3.2	2,512	2,512	リクアンドモチベーション	19.9	21.6	19,548	
いちよし証券	23.5	25.4	21,793	21,793	エストラスト	1.6	1.6	1,228	1,228	GCA	12.4	12	9,408	
松井証券	54.7	59.3	68,788	68,788	フジヤースホールディングス	27.2	27	18,144	18,144	エス・エム・エス	21.4	43.1	79,691	
だいこう証券ビジネス	5.5	5	1,995	1,995	オープンハウス	18.2	19.7	89,438	89,438	パソナホールディングス	100	117.3	228,148	
マネックスグループ	118.7	113	42,488	42,488	東急不動産ホールディングス	270.8	325.4	197,192	197,192	リニカル	7	6.6	9,292	
カブドットコム証券	71.6	90.4	47,460	47,460	阪田グループホールディングス	93.3	101	202,808	202,808	グックパッド	34.1	36.7	11,010	
極東証券	15	16.2	18,500	18,500	イープランド	-	1.8	1,225	1,225	エスクリ	3.8	3.2	1,913	
岩井コスモホールディングス	11.4	12.4	14,892	14,892	ムゲンエステート	6.9	8.5	5,015	5,015	アイ・ケイ・ケイ	6.4	5.8	4,170	
藍澤證券	20.9	22.7	14,800	14,800	ピーロット	-	2	2,554	2,554	学情	5	4.7	6,152	
マネーパートナーズグループ	14.3	14.2	4,146	4,146	ファーストブラザーズ	3.1	3.3	3,521	3,521	スタジオアリス	5.4	5.8	13,885	
小林洋行	3.3	3.4	887	887	ハウスドゥ	1.8	4.5	7,551	7,551	シミックホールディングス	6	6.5	10,036	

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

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

■投資信託財産の構成

2019年2月7日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	281,168,547,397円
一 等 株 式 (評 価 額)	4,125,464,360
未 収 入 金 (金 額)	275,040,369,410
未 収 入 委 託 証 書 金 (金 額)	89,044,788
未 収 入 委 託 証 書 金 (金 額)	424,228,839
(B) 負 債	1,984,233,000
未 収 入 委 託 証 書 金 (金 額)	1,489,440,000
未 収 入 委 託 証 書 金 (金 額)	376,733,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	279,184,314,397
元 本	115,232,523,115
次 期 繰 越 損 益	163,951,791,282
(D) 受 取 金 数	115,232,523,115口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	24,228円

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2018年2月8日 至2019年2月7日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	金 配 当 益	6,275,204,545円
受 取	金	6,228,808,737
そ の 他 収 益	金	52,719,900
支 払 利 息	息	△6,324,092
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	買 損 益	△27,670,046,291
売 買	損	11,457,593,174
売 買	損	△39,127,639,465
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	引 損 益	△882,002,368
取 引	益	1,171,869,352
取 引	損	△2,053,871,720
(D) そ の 他 費 用	用	△6,516
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)		△22,276,850,630
(F) 前 期 繰 越 損 益 金		179,810,421,658
(G) 解 約 差 損 益 金		△53,943,765,219
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金		60,361,985,473
(I) 合 計(E + F + G + H)		163,951,791,282
次 期 繰 越 損 益 金(I)		163,951,791,282

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

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

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

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第16期（決算日 2019年2月21日）

（計算期間 2018年2月22日～2019年2月21日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

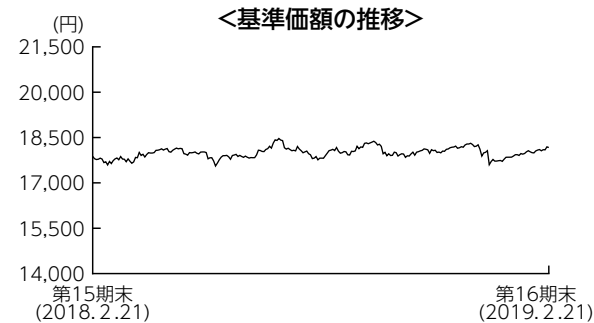
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月22日から2019年2月21日まで）



基準価額の推移

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

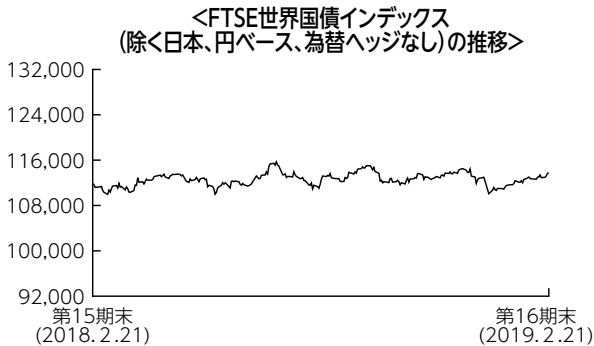
基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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



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

ポートフォリオについて

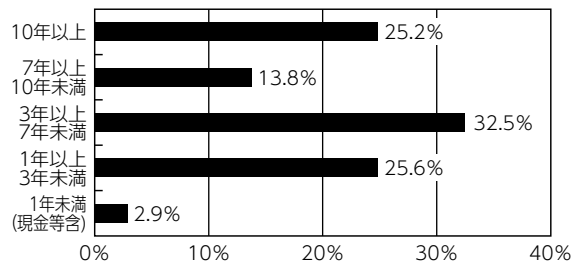
ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

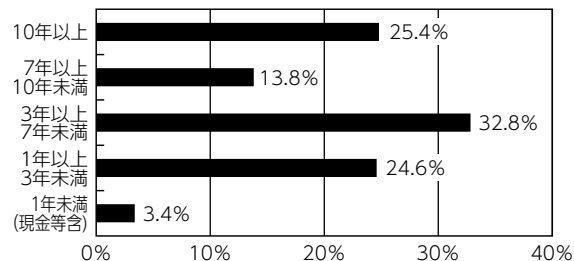
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差	
北米	米国	45.6%	45.9%	△0.3%
	カナダ	2.0%	2.0%	△0.1%
	計	47.5%	47.9%	△0.4%
中南米	メキシコ	0.7%	0.8%	△0.1%
	計	0.7%	0.8%	△0.1%
欧州	オーストリア	1.5%	1.5%	△0.0%
	ベルギー	2.4%	2.5%	△0.0%
	フィンランド	0.7%	0.6%	0.0%
	フランス	9.9%	10.1%	△0.2%
	ドイツ	6.6%	6.7%	△0.1%
	アイルランド	0.8%	0.8%	0.0%
	イタリア	8.6%	9.1%	△0.5%
	オランダ	2.0%	2.0%	0.0%
	スペイン	5.6%	5.9%	△0.3%
	ユーロ計	38.2%	39.1%	△1.0%
デンマーク	0.5%	0.5%	△0.0%	
スウェーデン	0.3%	0.4%	△0.0%	
英国	6.7%	6.8%	△0.1%	
ポーランド	0.6%	0.6%	△0.1%	
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%	
	計	46.5%	47.7%	△1.2%
アジア・オセアニア	オーストラリア	2.1%	2.1%	△0.0%
	シンガポール	0.3%	0.4%	△0.1%
	マレーシア	0.4%	0.5%	△0.0%
	計	2.8%	3.0%	△0.1%
アフリカ	南アフリカ	0.5%	0.6%	△0.1%
	計	0.5%	0.6%	△0.1%
現金など	1.9%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,996円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については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（2018年2月22日から2019年2月21日まで）

公社債

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

(注) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 811,860	千アメリカ・ドル 813,428	千円 90,046,589	% 45.6	% -	% 18.6	% 17.2	% 9.7	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 42,320	千カナダ・ドル 45,974	千円 3,864,133	2.0	-	0.9	0.7	0.3	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 47,170	千オーストラリア・ドル 51,717	千円 4,118,815	2.1	-	1.4	0.6	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,770	千シンガポール・ドル 8,130	千円 666,012	0.3	-	0.2	0.1	-	
イギリス	千イギリス・ポンド 74,480	千イギリス・ポンド 91,989	千円 13,280,489	6.7	-	5.1	1.1	0.6	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 44,900	千デンマーク・クローネ 58,974	千円 991,943	0.5	-	0.4	0.1	-	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 29,640	千ノルウェー・クローネ 30,580	千円 393,883	0.2	-	0.1	0.1	-	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 48,610	千スウェーデン・クローナ 54,908	千円 652,318	0.3	-	0.2	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 251,739	千メキシコ・ペソ 247,524	千円 1,425,739	0.7	-	0.5	0.3	-	
マレーシア	千マレーシア・リングギット 29,750	千マレーシア・リングギット 29,948	千円 814,899	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 151,470	千南アフリカ・ランド 136,165	千円 1,075,710	0.5	-	0.5	0.0	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 36,520	千ポーランド・ズロチ 38,526	千円 1,116,887	0.6	-	0.2	0.3	0.0	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	11,360	12,568	1,577,178	0.8	-	0.5	0.1	0.1	
オランダ	26,590	31,424	3,943,507	2.0	-	1.2	0.7	0.1	
ベルギー	32,330	38,532	4,835,485	2.4	-	1.8	0.5	0.1	
フランス	133,920	156,515	19,641,123	9.9	-	6.3	2.6	1.0	
ドイツ	88,160	104,329	13,092,260	6.6	-	3.7	2.0	0.9	
スペイン	75,970	88,720	11,133,550	5.6	-	3.7	1.4	0.5	
イタリア	127,670	135,633	17,020,656	8.6	-	5.1	2.8	0.8	
フィンランド	9,470	10,384	1,303,175	0.7	-	0.4	0.2	0.1	
オーストリア	19,070	23,005	2,886,920	1.5	-	0.9	0.4	0.1	
合 計	-	-	千円 193,881,281	98.1	-	52.1	31.4	14.6	

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	1,900	1,910	55,393	2028/04/25
POLAND 2.00 04/25/21	国債証券	2.0000	1,130	1,142	33,122	2021/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	4,000	4,061	117,738	2022/04/25
POLAND 2.50 04/25/24	国債証券	2.5000	1,050	1,065	30,896	2024/04/25
POLAND 2.50 07/25/26	国債証券	2.5000	4,200	4,203	121,845	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	3,300	3,482	100,948	2025/07/25
POLAND 2.50 07/25/27	国債証券	2.5000	3,000	2,988	86,636	2027/07/25
POLAND 1.75 07/25/21	国債証券	1.7500	2,200	2,211	64,105	2021/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	3,200	3,629	105,223	2022/09/23
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.2500	2,970	3,157	91,529	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	3,680	4,079	118,273	2021/10/25
POLAND 4.00 10/25/23	国債証券	4.0000	3,100	3,374	97,835	2023/10/25
小計	-	-	36,520	38,526	1,116,887	-
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.00 02/18/45	国債証券	2.0000	870	950	119,254	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	210	218	27,357	2031/03/18
IRISH 3.40 03/18/24	国債証券	3.4000	930	1,088	136,548	2024/03/18
IRISH 5.40 03/13/25	国債証券	5.4000	1,260	1,651	207,250	2025/03/13
IRISH 3.90 03/20/23	国債証券	3.9000	700	815	102,318	2023/03/20
IRISH 0.80 03/15/22	国債証券	0.8000	950	980	123,085	2022/03/15
IRISH 4.50 04/18/20	国債証券	4.5000	1,130	1,195	150,028	2020/04/18
IRISH 1.30 05/15/33	国債証券	1.3000	450	456	57,225	2033/05/15
IRISH 2.40 05/15/30	国債証券	2.4000	1,100	1,273	159,760	2030/05/15
IRISH 0.90 05/15/28	国債証券	0.9000	580	591	74,225	2028/05/15
IRISH 1.10 05/15/29	国債証券	1.1000	340	348	43,788	2029/05/15
IRISH 1.00 05/15/26	国債証券	1.0000	1,200	1,252	157,141	2026/05/15
IRISH 1.70 05/15/37	国債証券	1.7000	570	598	75,095	2037/05/15
IRISH 5.00 10/18/20	国債証券	5.0000	850	927	116,330	2020/10/18
IRISH 10/18/22	国債証券	-	220	221	27,767	2022/10/18
小計	-	-	11,360	12,568	1,577,178	-
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,620	2,668	334,930	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,430	2,130	267,408	2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	590	687	86,292	2023/01/15
NETHERLANDS 5.50 01/15/28	国債証券	5.5000	1,350	1,998	250,729	2028/01/15
NETHERLANDS 4.00 01/15/37	国債証券	4.0000	1,560	2,458	308,524	2037/01/15
NETHERLANDS 2.50 01/15/33	国債証券	2.5000	1,300	1,652	207,342	2033/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	-	2,310	2,342	294,018	2022/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	-	1,680	1,701	213,544	2024/01/15
NETHERLANDS 3.50 07/15/20	国債証券	3.5000	1,670	1,765	221,561	2020/07/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	国債証券	3.2500	1,860	2,030	254,868	2021/07/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	2,000	2,186	274,333	2023/07/15
NETHERLANDS 0.50 07/15/26	国債証券	0.5000	1,700	1,765	221,503	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	1,550	1,694	212,583	2022/07/15
NETHERLANDS 2.00 07/15/24	国債証券	2.0000	1,560	1,749	219,493	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,700	1,740	218,433	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,260	1,323	166,145	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,450	1,528	191,793	2027/07/15
小計	-	-	26,590	31,424	3,943,507	-

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

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

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

銘柄	当	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 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	1,700	1,737	218,075		2021/07/30	
SPAIN 1.15 07/30/20	国債証券	1.1500	2,100	2,143	268,994		2020/07/30	
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,460	1,470	184,474		2023/07/30	
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	2,390	2,695	338,316		2024/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,900	2,581	323,932		2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,500	2,337	293,283		2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,800	2,002	251,305		2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	950	1,007	126,380		2048/10/31	
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.8500	2,900	3,151	395,483		2020/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	2,100	2,300	288,714		2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	2,200	2,271	284,989		2027/10/31	
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	2,400	2,476	310,720		2026/10/31	
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	2,300	2,743	344,230		2023/10/31	
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	1,340	1,362	170,921		2022/10/31	
小計	—	—	75,970	88,720	11,133,550		—	
(ユーロ…イタリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	2,240	2,863	359,298		2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	3,020	3,276	411,117		2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	2,090	1,981	248,701		2028/02/01	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,650	1,416	177,780		2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,430	1,379	173,051		2048/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	2,390	2,680	336,316		2024/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	660	538	67,608		2067/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	2,400	2,777	348,544		2025/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	2,590	2,878	361,226		2022/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	2,110	2,398	300,979		2026/03/01	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	国債証券	4.2500	4,600	4,787	600,788		2020/03/01	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.7500	3,300	3,501	439,398		2021/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,260	1,932	242,447		2032/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,100	1,103	138,468		2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	2,570	2,692	337,867		2030/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	2,500	2,439	306,164		2023/03/15	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	2,420	2,361	296,297		2023/03/01	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	2,500	2,508	314,775		2022/04/15	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	770	769	96,617		2022/04/01	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	3,100	4,006	502,729		2031/05/01	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,560	195,831		2023/05/01	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国債証券	3.7500	2,300	2,446	307,012		2021/05/01	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	2,100	2,090	262,316		2024/05/15	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	2,630	2,518	315,998		2025/05/15	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,500	1,424	178,804		2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	2,500	2,396	300,786		2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,040	1,983	248,857		2027/06/01	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国債証券	0.4500	910	904	113,453		2021/06/01	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	3,200	3,415	428,553		2021/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	2,510	3,023	379,424		2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	2,430	2,934	368,276		2039/08/01	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,146	269,355		2023/08/01	

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

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

■投資信託財産の構成

2019年2月21日現在

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

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月21日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2018年2月22日 至2019年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

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

変更前：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）

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

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

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2019年2月15日）

（計算期間 2018年2月16日～2019年2月15日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

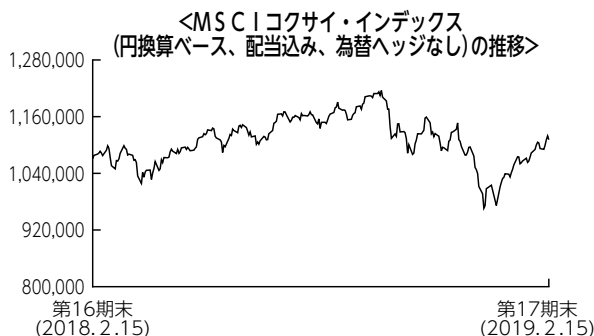
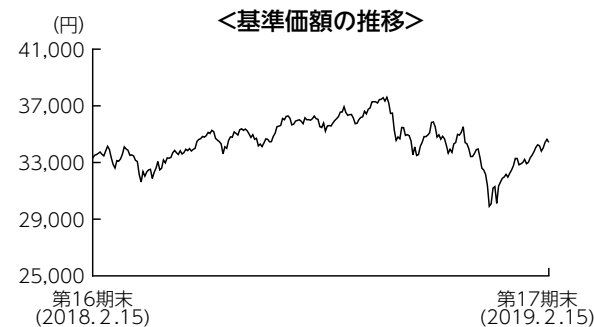
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月16日から2019年2月15日まで）



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

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

期末

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



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は各決算日時点のGICS（世界産業分類基準）によるものです。

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（34,450円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については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 (2018年2月16日から2019年2月15日まで)

(1) 株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 109,193	百万円 108,526	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	92,002,372千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	299,138,263千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.30

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千株	千円			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
KIMBERLY-CLARK CORP	242.02	301.75	3,525	389,405			家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	86.16	103.26	4,371	482,824			資本市場
KOHL'S CORP	113.57	149.1	984	108,728			複合小売り
KROGER CO	620.93	666.1	1,929	213,041			食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	115.22	137.25	2,488	274,858			半導体・半導体製造装置
PACKAGING CORP OF AMERICA	61.57	89.82	874	96,578			容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	126.22	154.52	1,093	120,787			情報技術サービス
LEGGETT & PLATT INC	95.88	95.88	425	46,993			家庭用耐久財
LENNAR CORP	162	260.65	1,257	138,864			家庭用耐久財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	214.62	298.62	607	67,113			各種金融サービス
ELI LILLY & CO	702.83	845.73	10,212	1,127,834			医薬品
L BRANDS INC	162.62	216.98	591	65,347			専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	141.63	188.9	1,131	125,005			保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	479.82	605.55	6,770	747,684			航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	223.57	281.67	2,169	239,591			ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	182.4	225.6	6,790	749,949			航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	213.46	213.46	979	108,159			保険
RANGE RESOURCES CORP	136.97	-	-	-			石油・ガス・消耗燃料
LOWE'S COS INC	581.78	710.7	7,214	796,749			専門小売り
DOMINION ENERGY INC	451.31	654.73	4,772	527,128			総合公益事業
SCANA CORP	109.02	-	-	-			総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	321.98	464.14	1,270	140,297			ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	74.76	109.52	1,395	154,095			食品
MCDONALD'S CORPORATION	575.15	675.89	11,886	1,312,786			ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	184.09	215.99	4,230	467,227			資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	28.55	37.51	802	88,668			保険
MANPOWERGROUP INC	42.57	62.65	523	57,857			専門サービス
MARKEL CORPORATION	9.89	12.22	1,234	136,358			保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	147.74	185.26	3,262	360,343			ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	358.21	435.93	3,929	434,019			保険
MASCO CORP	230.43	286.38	1,066	117,813			建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	43.87	53.82	1,009	111,441			建設資材
MATTEL INC	240.03	240.03	405	44,826			レジャー用品
METLIFE INC	649.37	702.51	3,076	339,823			保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	203.42	243.23	1,356	149,864			半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	951.77	1,179.47	10,760	1,188,368			ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	500.52	629.53	2,859	315,853			娯楽
CVS HEALTH CORP	719.13	1,131.5	7,659	845,873			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	1,931.11	2,319.3	18,308	2,021,996			医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	-	398.97	914	100,946			半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	71.76	89.94	1,319	145,776			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	5,166.74	6,344.42	67,821	7,490,245			ソフトウェア
MICRON TECH INC	761.46	1,016.04	4,290	473,868			半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	41	41	508	56,174			機械
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	153.31	202.69	1,836	202,808			半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	264.63	552.42	1,060	117,076			半導体・半導体製造装置
3M CO	424.07	505.59	10,361	1,144,275			コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	40.42	60.93	845	93,400			家庭用耐久財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	105.82	146.8	2,013	222,420			通信機器
KANSAS CITY SOUTHERN	72.47	88.56	928	102,598			陸運・鉄道
MYLAN NV	313.44	435.74	1,373	151,684			医薬品
ILLUMINA INC	104.53	126.9	3,711	409,891			ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	375.54	447.02	2,381	262,988			電力
NATIONAL OILWELL VARCO INC	269.38	334.68	971	107,300			エネルギー設備・サービス
NETAPP INC	183.87	231.04	1,470	162,435			コンピュータ・周辺機器
NEWFIELD EXPLORATION CO	137.4	-	-	-			石油・ガス・消耗燃料
NEWELL BRANDS INC	362.06	433.8	940	103,914			家庭用耐久財

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

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

銘柄	期首(前期末)		当期			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
SIMON PROPERTY GROUP INC	21.825	26.5	4,869	537,803		0.2
PUBLIC STORAGE	11.151	13.721	2,856	315,419		0.1
VENTAS INC	25.041	30.244	1,957	216,241		0.1
VORNADO REALTY TRUST	12.211	15.346	1,047	115,704		0.0
WEYERHAEUSER CO	51.939	63.699	1,619	178,827		0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	8.141	11.885	1,176	129,919		0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	15.118	18.388	2,092	231,122		0.1
AGNC INVESTMENT CORP	25.741	44.741	791	87,409		0.0
VEREIT INC	72.429	93.429	772	85,332		0.0
AMERICAN TOWER CORP	30.693	38.497	6,767	747,390		0.2
WP CAREY INC	-	15.148	1,138	125,705		0.0
INVITATION HOMES INC	22.567	30.427	692	76,448		0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21.975	-	-	-		-
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	19.124	381	42,177		0.0
COLONY CAPITAL INC	39.311	-	-	-		-
小計	910.976	1,082.101	65,889	7,276.820		-
	40銘柄<1.7%>	39銘柄<2.1%>	-	-		2.1
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	2.582	9.288	317	26,346		0.0
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10.748	10.748	240	19,971		0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9.675	9.675	247	20,506		0.0
小計	23.005	29.711	805	66,824		-
	3銘柄<0.0%>	3銘柄<0.0%>	-	-		0.0
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		%
MIRVAC GROUP	295.783	295.783	757	59,326		0.0
GPT GROUP	144.955	144.955	843	66,099		0.0
LENDLEASE GROUP	37.363	60.871	811	63,574		0.0
STOCKLAND	126.459	194.018	715	56,092		0.0
WESTFIELD CORP	140.035	-	-	-		-
DEXUS	63.819	80.596	967	75,776		0.0
GOODMAN GROUP	121.619	147.572	1,846	144,643		0.0
VICINITY CENTRES	270.443	270.443	695	54,456		0.0
SCENTRE GROUP	383.688	476.956	1,888	147,983		0.0
小計	1,584.164	1,671.194	8,525	667,952		-
	9銘柄<0.2%>	8銘柄<0.2%>	-	-		0.2
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円		%
LINK REIT	163.5	185.5	16,073	226,155		0.1
小計	163.5	185.5	16,073	226,155		-
	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	-	-		0.1
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		%
CAPITALAND MALL TRUST	199	199	473	38,524		0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200.806	200.806	552	44,917		0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	-	206.3	383	31,211		0.0
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	192.1	359	29,219		0.0
小計	591.906	798.206	1,768	143,872		-
	3銘柄<0.0%>	4銘柄<0.0%>	-	-		0.0
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		%
BRITISH LAND CO PLC	71.871	71.871	419	59,307		0.0
HAMMERSON PLC	58.616	58.616	222	31,481		0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	37.974	59.062	522	73,857		0.0
SEGRO PLC	61.113	82.914	537	75,941		0.0
小計	229.574	272.463	1,702	240,587		-
	4銘柄<0.1%>	4銘柄<0.1%>	-	-		0.1
(オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円		%
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	-	12.061	1,729	215,670		0.1
小計	-	12.061	1,729	215,670		-
	1銘柄<-%>	1銘柄<0.1%>	-	-		0.1
(フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		%
GECINA SA	3.67	3.67	462	57,700		0.0

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

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

■投資信託財産の構成

2019年2月15日現在

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

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月15日)現在

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第11期 (決算日 2019年4月18日)

(計算期間 2018年4月19日～2019年4月18日)

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

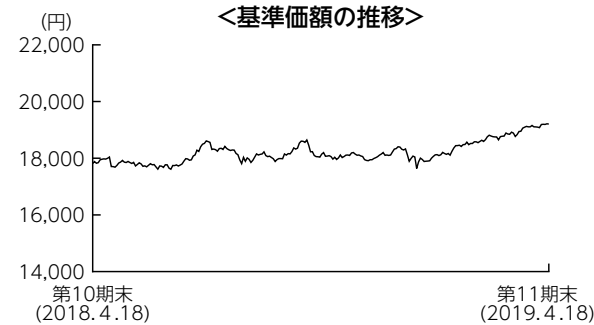
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2018年4月19日から2019年4月18日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は19,206円となり、前期末比で7.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

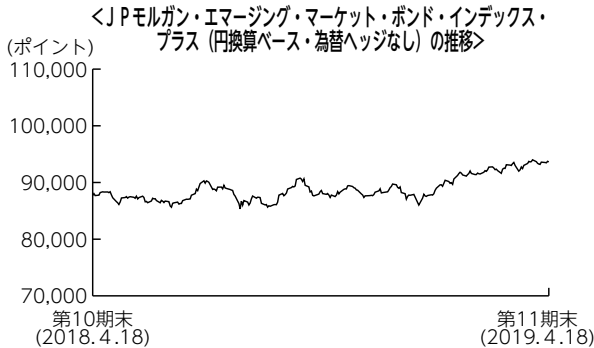
当期の新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）したものの、債券の利息収入や、為替市場で円安米ドル高が進行したことなどを主な要因として、基準価額は上昇しました。

投資環境

当期の新興国債券の利回りは上昇しました。

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

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



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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○国別構成比 期首（前期末）

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

期末

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



(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で6.8%上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（18,213円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については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（2018年4月19日から2019年4月18日まで）

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 876,100	千アメリカ・ドル 940,532	千円 105,377,278	% 97.5	% 11.0	% 68.9	% 21.6	% 6.9
合 計	—	—	105,377,278	97.5	11.0	68.9	21.6	6.9

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

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

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

■投資信託財産の構成

2019年4月18日現在

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

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年4月18日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

■損益の状況

当期 自2018年4月19日 至2019年4月18日

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第11期（決算日 2019年4月18日）

（計算期間 2018年4月19日～2019年4月18日）

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

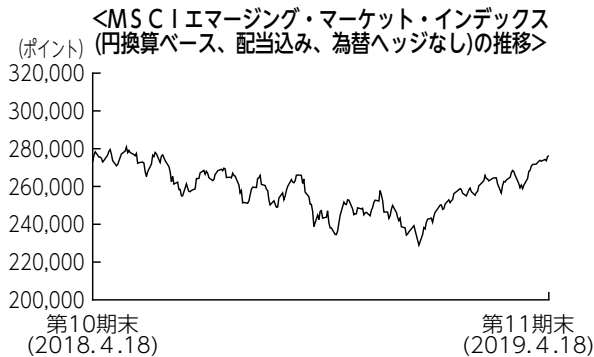
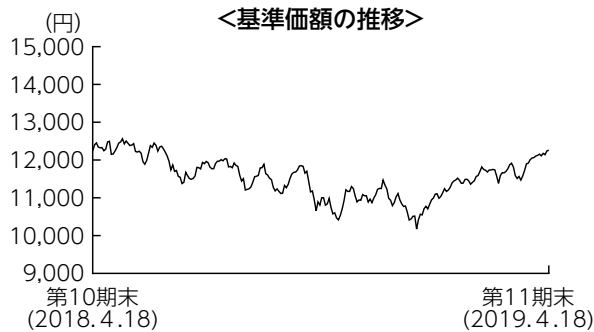
年 月 日	基 準 価 額		MSCIエマージング・ マーケット・インデックス		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入 比率
	円	騰落率	(円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	騰落率			
(期 首) 2018年 4 月 18 日	円 12,241	% -	ポイント 273,007.15	% -	% 92.1	% 7.1	% 0.7
4 月 末	12,288	0.4	273,760.40	0.3	92.2	7.1	0.7
5 月 末	11,889	△2.9	265,261.40	△2.8	91.6	7.2	0.6
6 月 末	11,411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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年4月19日から2019年4月18日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は12,260円となり、前期末比で0.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

ブラジルやインドなどの株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

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

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

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

期末

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



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(11,540円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については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 (2018年4月19日から2019年4月18日まで)

(1) 株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外国	タイ	証券 — (59,033)	千タイ・バーツ — (19)	証券 — (—)	千タイ・バーツ — (—)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 投資信託受益証券、投資証券

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

種	類	別	買		建		売		建		
			新規買付額	決	済	額	新規売付額	決	済	額	
外	国	株	式	先	物	取	引				
				百万円		百万円		百万円		百万円	
			53,548		55,556		—		—		

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

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

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

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

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

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	—	7,170	3,427	48,941	銀行	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	—	430	1,593	22,750	食品	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	—	740	1,594	22,772	ライフサイエンス・ツール/サービス	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	—	1,180	1,692	24,163	商業サービス・用品	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	—	3,080	1,136	16,229	自動車部品	
CHINA TOWER CORP LTD	—	38,060	7,992	114,134	各種電気通信サービス	
XIAOMI CORP	—	3,356	3,966	56,645	コンピュータ・周辺機器	
MEITUAN DIANPING	—	294	1,622	23,174	インターネット販売・通信販売	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY-RTS	—	114	11	167	電気設備	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	—	2,760	1,189	16,986	半導体・半導体製造装置	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	9,040	7,960	1,759	25,120	資本市場	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	—	1,340	1,779	25,411	不動産管理・開発	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	1,640	1,480	4,070	58,119	機械	
CHINA VANKE CO LTD-H	1,254.61	1,208.61	3,952	56,436	不動産管理・開発	
LUYE PHARMA GROUP LTD	—	1,080	774	11,057	医薬品	
CAR INC	—	680	432	6,175	陸運・鉄道	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	—	390	748	10,681	半導体・半導体製造装置	
CGN POWER CO LTD	12,130	9,810	2,158	30,819	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	7,025	6,950	646	9,229	電気設備	
BAIC MOTOR CORP LTD	—	1,635	1,038	14,825	自動車	
GF SECURITIES CO LTD	1,332	1,120	1,285	18,360	資本市場	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	512	512	1,584	22,628	自動車部品	
HUATAI SECURITIES CO LTD	1,794	1,458	2,303	32,895	資本市場	
3SBIO INC	1,130	1,290	1,984	28,331	バイオテクノロジー	
LEGEND HOLDINGS CORP	—	315	685	9,783	コンピュータ・周辺機器	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	2,120	1,605	1,810	25,853	医薬品	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	10,000	9,040	1,545	22,074	資本市場	
CHINA LITERATURE LTD	—	240	894	12,766	メディア	
DALI FOODS GROUP CO LTD	—	1,880	1,017	14,523	食品	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	—	1,410	922	13,168	電子装置・機器・部品	
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	—	5,250	882	12,594	保険	
MEITU INC	1,050	1,525	526	7,513	コンピュータ・周辺機器	
BOC AVIATION LTD	—	194	1,320	18,852	商社・流通業	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	—	230	686	9,803	保険	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	—	960	1,689	24,127	資本市場	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	—	445	3,722	53,156	ライフサイエンス・ツール/サービス	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	—	20,960	503	7,183	繊維・アパレル・贅沢品	
小 計	株 数	金 額	779,691.89	892,466.75	981.470	14,015,400
	銘 柄 数<比率>		139銘柄	207銘柄	—	<22.8%>
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円		
ACER INC	3,145.32	2,785.32	5,918	21,485	コンピュータ・周辺機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	745.54	675.54	16,212	58,853	コンピュータ・周辺機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	466.16	456.16	8,781	31,875	半導体・半導体製造装置	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	7,378.06	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	2,629.28	1,949.28	8,109	29,435	建設資材	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	—	310	6,975	25,319	電子装置・機器・部品	
TAIWAN BUSINESS BANK	3,361.71	3,714.57	4,438	16,113	銀行	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	990	850	5,839	21,197	半導体・半導体製造装置	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	730	650	5,622	20,409	コンピュータ・周辺機器	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	725.43	549.75	4,150	15,066	コンピュータ・周辺機器	
QUANTA COMPUTER INC	2,668.58	2,608.58	15,834	57,477	コンピュータ・周辺機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	900.7	920.7	4,525	16,426	不動産管理・開発	
EVA AIRWAYS CORP	2,861.61	1,962.69	3,081	11,185	旅客航空輸送業	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	687.6	627.6	16,411	59,574	コンピュータ・周辺機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,397.55	5,123.45	9,401	34,127	銀行	
CHINA AIRLINES	2,321.56	2,321.56	2,309	8,385	旅客航空輸送業	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	2,011.69	1,961.69	8,072	29,302	自動車部品	

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

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

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
GRUPO TELEvisa SAB	2,614	2,389	9,718	57,824	メディア
GRUPO BIMBO SAB DE CV	1,644	1,626	6,588	39,201	食品
GRUMA SAB DE CV	245.7	216.4	4,322	25,716	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	220.3	202.6	3,867	23,011	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	543	376	2,745	16,338	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	2,616	2,484	30,533	181,673	銀行
MEXICHEM SAB DE CV	1,082.25	940.25	4,305	25,617	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	147	161.55	3,703	22,036	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	1,567	1,343	4,579	27,248	家庭用品
ALSEA SAB DE CV	-	437	1,959	11,661	ホテル・レストラン・レジャー
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	206.85	204.65	6,310	37,549	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	4,110.52	3,389.52	19,913	118,484	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE CV	35,278.78	32,125.78	47,899	285,002	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	2,447	1,988	5,741	34,160	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	434	426	4,559	27,126	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	5,462	4,962	27,519	163,739	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	397	312	6,083	36,196	運送インフラ
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	-	274	2,493	14,838	メディア
GENEREA SAB DE CV	1,030	-	-	-	消費者金融
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	532	544	4,579	27,247	ガス
BANCO SANTANDER MEXICO SA	1,953.9	1,545.9	5,024	29,893	銀行
GRUPO LALA SAB DE CV	504	-	-	-	食品
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	-	515	6,283	37,386	飲料
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	66,826.3 23銘柄	59,294.65 23銘柄	216,398 -	1,287,571 <2.1%>
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	7,964	7,186	33,774	73,290	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,309.4	1,798.9	9,893	21,469	コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	1,040.86	855.7	7,102	15,412	銀行
AYALA CORP	248.03	244.33	21,989	47,717	各種金融サービス
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	3,406	3,077	4,609	10,002	コングロマリット
DMCI HOLDINGS INC	3,518.5	3,518.5	4,222	9,162	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC	27.85	27.85	5,194	11,271	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	406.8	814.2	10,503	22,791	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,900.5	2,892.4	17,744	38,506	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP	441.3	437.2	13,290	28,841	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	820.37	1,449.97	11,309	24,542	銀行
BDO UNIBANK INC	2,130.13	1,925.83	25,420	55,163	銀行
MEGAWORLD CORP	9,620	9,620	5,473	11,878	不動産管理・開発
PLDT INC	95.2	86	10,526	22,842	無線通信サービス
ROBINSONS LAND CORP	2,187.22	2,187.22	5,314	11,533	不動産管理・開発
SECURITY BANK CORP	234.2	234.2	4,215	9,147	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC	9,369.75	9,700.75	38,414	83,360	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	902.1	791.3	12,027	26,100	食品
SM INVESTMENTS CORP	241.58	219.38	20,402	44,273	コングロマリット
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	18,109	11,489	5,147	11,169	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	2,163	1,282	4,608	10,001	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY	240	234.3	8,879	19,269	電力
GT CAPITAL HOLDINGS INC	90.7	91.37	7,876	17,091	各種金融サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	68,466.49 23銘柄	60,163.4 23銘柄	287,943 -	624,836 <1.0%>
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	70,291.7	64,144.7	315,207	53,364	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	45.34	47.7	217,860	36,883	銀行
BANCO DE CHILE	27,488.49	22,134.93	220,441	37,320	銀行
EMPRESAS CMPC SA	1,248.39	1,115.77	255,399	43,239	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	392.14	376.73	325,080	55,036	石油・ガス・消耗燃料

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

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

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE REC LTD	716.16	508.92	20,135	32,820	運送インフラ
BAJAJ FINSERV LTD	856.77	551.73	8,300	13,530	各種金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	37.2	37.23	28,216	45,992	保険
COAL INDIA LTD	84.02	79.67	24,446	39,847	自動車
TATA MOTORS LTD	759.01	1,124.57	28,294	46,119	石油・ガス・消耗燃料
VAKRANGEE LTD	315.68	—	—	—	自動車
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	359.54	—	—	—	情報技術サービス
BHARTI INFRATEL LTD	329.95	289.33	12,185	19,861	消費者金融
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	283.64	322.96	10,107	16,474	各種電気通信サービス
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	344.12	254.66	21,199	34,554	貯蓄・抵当・不動産金融
CADILA HEALTHCARE LTD	23.33	23.33	223	363	金属・鉱業
AVENUE SUPERMARTS LTD	181.46	169.62	5,731	9,342	医薬品
IDFC BANK LTD	—	112.16	15,821	25,789	食品・生活必需品小売り
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,144.21	—	—	—	銀行
	—	83	13,129	21,401	旅客航空輸送業
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	56,633.8 80銘柄	54,947.24 79銘柄	3,245,320 —	5,289,872 <8.6%>
(パキスタン)	百株	百株	千パキスタン・ルピー	千円	
LUCKY CEMENT LTD	99	—	—	—	建設資材
MCB BANK LTD	390	390	7,264	5,811	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	745	745	10,622	8,497	石油・ガス・消耗燃料
HABIB BANK LTD	514	—	—	—	銀行
	544	544	6,597	5,278	銀行
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	2,292 5銘柄	1,679 3銘柄	24,483 —	19,587 <0.0%>
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
AKR CORPORINDO TBK PT	1,504	—	—	—	商社・流通業
UNITED TRACTORS TBK PT	1,692.01	1,670.01	4,413,001	35,304	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	4,792	4,588	2,959,260	23,674	食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,673	1,375	6,792,500	54,340	家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	21,705	19,392	15,028,800	120,230	自動車
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	53,615	47,363	18,329,481	146,635	各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	8,456	6,756	4,171,830	33,374	食品
GUDANG GARAM TBK PT	486	448	3,692,640	29,541	タバコ
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	9,248	7,955	2,967,215	23,737	タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	1,856	1,803	3,876,450	31,011	建設資材
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	—	2,620	2,037,050	16,296	紙製品・林産品
BUKIT ASAM TBK PT	—	2,567	1,021,666	8,173	石油・ガス・消耗燃料
BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	2,904.16	2,613.16	2,462,903	19,703	銀行
BANK MANDIRI	19,918	17,900	13,648,750	109,190	銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	2,765	—	—	—	複合小売り
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	—	980	1,026,550	8,212	紙製品・林産品
BANK RAKYAT INDONESIA	58,799	52,904	22,960,336	183,682	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	10,641	10,641	2,511,276	20,090	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	7,443	7,244	7,026,680	56,213	銀行
KALBE FARMA TBK PT	24,762	18,222	2,724,189	21,793	医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	3,303	2,765	3,684,362	29,474	建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	10,390	9,338	25,656,155	205,249	銀行
XL AXIATA TBK PT	2,907	—	—	—	無線通信サービス
JASA MARGA PERSERO TBK PT	2,001.25	2,001.25	1,220,762	9,766	運送インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT	8,517	7,465	1,052,565	8,420	不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT	14,345	14,345	1,872,022	14,976	石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK	19,128	16,599	1,195,128	9,561	不動産管理・開発
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	2,390	2,385	2,164,387	17,315	食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	1,808	1,808	690,656	5,525	各種電気通信サービス
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	4,803	4,803	1,239,174	9,913	銀行
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	3,920	—	—	—	建設・土木

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 外国新株予約権証券

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

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		期末
	□	数	□	数	外貨建金額 邦貨換算金額
(トルコ) EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM		千口 231.071		千口 -	千トルコ・リラ -
小計	□	数 231.071	□	数 -	金額 -
	銘	柄	数<比	率>	1銘柄<0.0%>
(メキシコ) FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D CEMEX SAB DE CV FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		千口 203.9 1,546.875 322.6		千口 184.4 1,485.375 326.1	千メキシコ・ペソ 33,477 199,193 81,662 53,261
小計	□	数 2,073.375	□	数 1,995.875	金額 56,154
	銘	柄	数<比	率>	3銘柄<0.6%>
(南アフリカ) HYPROP INVESTMENTS LTD FORTRESS REIT LTD-B RESILIENT REIT LTD		千口 29.707 - 28.6		千口 22.174 57.784 28.6	千南アフリカ・ランド 1,646 4,865 12,874
小計	□	数 58.307	□	数 108.558	金額 3,858
	銘	柄	数<比	率>	2銘柄<0.1%>
合計	□	数 2,362.753	□	数 2,104.433	金額 365,061
	銘	柄	数<比	率>	6銘柄<0.6%>

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当期		期末
		買	建	建
外国	MINI MSCI EMG MKT		百万円 2,724	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

2019年4月18日現在

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

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年4月18日)現在

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

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

■損益の状況

当期 自2018年4月19日 至2019年4月18日

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

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

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

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

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
	円	騰落率	(配当込み) ポイント (ベンチマーク)	騰落率			
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 (㈩東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証R E I T指数の商標に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

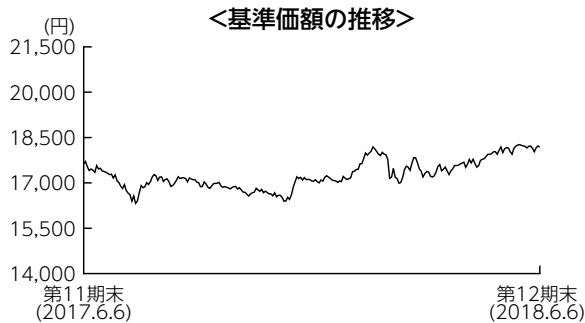
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数 (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 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

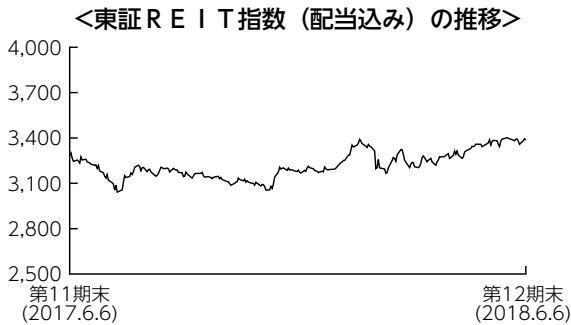
当ファンドの基準価額は18,181円となり、前期末比で3.1%上昇しました。

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□	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	144,844	—	215,55705	34,681,169				—
	銘 柄 数<比 率>	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	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・イヤー2045) 529,834円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー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・イヤー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
	(-)	(-)	(-)	(-)
INFRAREIT 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
(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 TRUST	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		
	7,585,978	9,953,908	344,188	37,877,928		71.3
	158銘柄<71.6%>	161銘柄<71.3%>	—	—		—
(カナダ)	千□	千□	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	
	口	数	口	数	外貨建金額	邦貨換算金額	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	口	502,594	口	572,477	11,377	941,254		—
銘柄数	29銘柄	<1.8%>	銘柄数	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	口	9,924,884	口	11,393,811	45,238	3,678,834		—
銘柄数	31銘柄	<8.1%>	銘柄数	26銘柄	<6.9%>			6.9

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額
(香港)	千口	千円	千口	千円	千口	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	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	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	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	5,052.594	6,518,289	20,834	3,040,225	—		—
	口数・金額 銘柄数<比率>	28銘柄<5.4%>	26銘柄<5.7%>	—	—		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	56	70,287	991	30,098	—		—
	口数・金額 銘柄数<比率>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	—	—		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	585.91	732,035	1,096	140,121	—		—
	口数・金額 銘柄数<比率>	3銘柄<0.2%>	3銘柄<0.3%>	—	—		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	43.05	109,543	12,667	1,618,200	—		—
	口数・金額 銘柄数<比率>	4銘柄<0.5%>	5銘柄<3.0%>	—	—		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	37.875	51,136	3,112	397,546	—		—
	口数・金額 銘柄数<比率>	9銘柄<0.8%>	7銘柄<0.7%>	—	—		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				末
		首(前期末)	当	外貨建金額	邦貨換算金額	
		□ 数	□ 数	千ユーロ	千円	%
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
ALTEA		0.902	1,518	303	38,781	0.1
KLEPIERRE		70.45	87,317	2,861	365,512	0.7
COVIVIO		18.09	22,663	2,010	256,783	0.5
MERCIALYS		19.06	22,547	337	43,058	0.1
UNIBAIL-RODAMCO SE		33.91	—	—	—	—
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	171,552 7銘柄<4.5%>	173,241 6銘柄<2.4%>	9,958	1,272,143	2.4
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
HAMBORNER REIT AG		27.89	33,143	302	38,653	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		34.83	61,358	789	100,873	0.2
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	62.72 2銘柄<0.2%>	94,501 2銘柄<0.3%>	1,092	139,526	0.3
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		—	136.98	1,292	165,091	0.3
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		30	39,724	373	47,698	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS S		37.214	46,179	815	104,233	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		159.33	140,114	1,742	222,563	0.4
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		22.2	—	—	—	—
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	248,744 4銘柄<0.8%>	362,997 4銘柄<1.0%>	4,224	539,588	1.0
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
BENI STABILI SPA		343.798	437.76	327	41,827	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		112.11	20.03	138	17,662	0.0
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	455,908 2銘柄<0.1%>	457.79 2銘柄<0.1%>	465	59,489	0.1
合計	□ 数 銘柄 数<比率>	42,503.759 324銘柄<99.7%>	52,573.48 311銘柄<99.3%>	—	52,796,215	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	
		千円	%
投資信託受益証券、投資証券	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 ・ 口 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

先進国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
先進国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 エポリューション	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)	合計(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10期（決算日 2019年4月5日）

（計算期間 2018年4月6日～2019年4月5日）

DIAMマネー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	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				
6期(2015年4月6日)	10,090	0.1	82.8	—	—	百万円 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
10期(2019年4月5日)	10,098	△0.0	79.4	—	—	16,167

(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)。

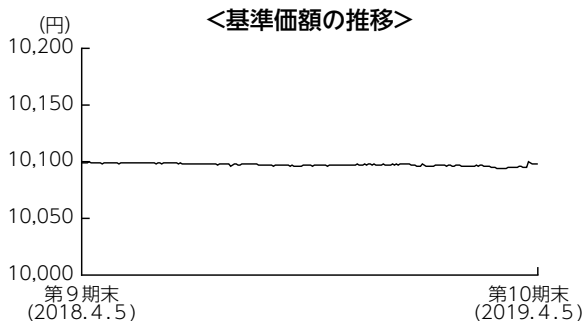
■当期中の基準価額の推移

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) 2018年 4 月 5 日	10,099	% -		% 71.1		% -	% -
4 月 末	10,099	0.0		71.0	-	-	-
5 月 末	10,099	0.0		73.6	-	-	-
6 月 末	10,098	△0.0		72.2	-	-	-
7 月 末	10,098	△0.0		72.2	-	-	-
8 月 末	10,097	△0.0		88.4	-	-	-
9 月 末	10,097	△0.0		79.1	-	-	-
10 月 末	10,097	△0.0		77.9	-	-	-
11 月 末	10,097	△0.0		78.2	-	-	-
12 月 末	10,096	△0.0		71.4	-	-	-
2019年 1 月 末	10,097	△0.0		71.4	-	-	-
2 月 末	10,095	△0.0		71.4	-	-	-
3 月 末	10,100	0.0		79.4	-	-	-
(期 末) 2019年 4 月 5 日	10,098	△0.0		79.4	-	-	-

(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（2018年4月6日から2019年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,098円となり、前期末比で0.01%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によってコールローンがマイナス利回りとなっているため、その影響を受けて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ヵ月物国庫短期証券利回りは概ね $\Delta 0.3\% \sim \Delta 0.1\%$ 台で推移しました。米国が

金融政策正常化のペースを落としたことや国債市場の需給要因から一時的に利回りが低下する局面もありましたが、米国や中国の景気が市場の見方ほど悪くないのではないかとの見通しが強まったことから期末にかけて利回りは上昇し、期を通して見るとレンジ内での推移となりました。

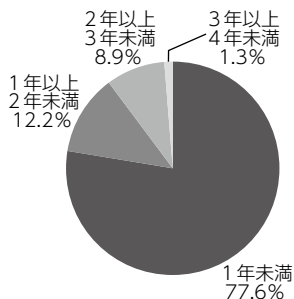
ポートフォリオについて

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。

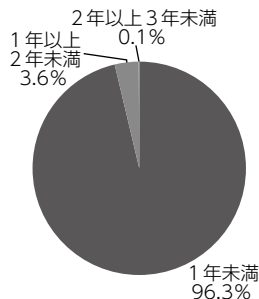
【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○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、国債や政府保証債、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

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(10,097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 (2018年4月6日から2019年4月5日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	12,636,104	(-)
	地 方 債 証 券	40,605	(34,950)
	特 殊 債 券	-	200,019 (329,000)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2018年4月6日から2019年4月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 12,676	百万円 202	% 1.6	百万円 200	百万円 -	% -

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	12,600,000	12,631,008	78.1	—	—	—	78.1
地 方 債 証 券	135,830	136,409	0.8	0.6	—	—	0.8
特 殊 債 券	66,000	67,019	0.4	—	—	0.1	0.4
合 計	12,801,830	12,834,437	79.4	0.6	—	0.1	79.3

(注1) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期		末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
3 0 1 回 利付国庫債券（10年）	1.5000	200,000	200,658	2019/06/20
1 2 3 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	12,000,000	12,029,040	2020/03/20
3 8 8 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	100,000	100,281	2020/05/15
3 9 1 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,672	2020/08/01
3 9 2 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	100,000	100,357	2020/09/01
小 計	—	12,600,000	12,631,008	—
(地方債証券)	%	千円	千円	
2 6 年 度 4 回 静岡県公募公債	0.2090	14,810	14,816	2019/06/24
2 6 年 度 1 回 大阪市みおつくし債	0.2200	6,000	5,999	2019/06/27
2 1 年 度 6 回 愛知県公募公債	1.4400	10,000	10,045	2019/07/30
2 6 年 度 京都府京都みらい債	0.1600	9,200	9,194	2019/09/02
3 3 1 回 大阪府公募公債	1.4100	10,000	10,078	2019/10/29
2 6 年 度 7 回 福岡県公募公債	0.2000	6,500	6,495	2019/12/25
2 1 年 度 3 5 回 兵庫県公募公債	1.4600	40,000	40,457	2020/01/22
4 3 回 川崎市公募公債 5年	0.1370	10,850	10,863	2020/03/19
2 7 年 度 2 回 千葉県公募公債	0.1770	14,670	14,697	2020/05/25
2 7 年 度 京都府京都みらい債	0.1000	13,800	13,762	2020/09/02
小 計	—	135,830	136,409	—
(特殊債券)	%	千円	千円	
8 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	4,000	4,026	2019/09/30
9 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	8,000	8,075	2019/11/29

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	
1 0 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	9,000	9,117	2020/02/28
1 1 2 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1000	30,000	30,455	2020/07/31
1 1 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	6,000	6,093	2020/09/30
1 3 3 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	5,000	5,139	2021/04/30
1 3 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2000	4,000	4,111	2021/06/30
小	計	—	66,000	67,019	—
合	計	—	12,801,830	12,834,437	—

■投資信託財産の構成

2019年4月5日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
公 社 債	12,834,437		79.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,332,745		20.6
投 資 信 託 財 産 総 額	16,167,183		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年4月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,167,183,546円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,330,773,596
公 社 債(評価額)	12,834,437,613
未 収 利 息	1,577,825
前 払 費 用	394,512
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	16,167,183,546
元 本	16,010,803,187
次 期 繰 越 損 益 金	156,380,359
(D) 受 益 権 総 口 数	16,010,803,187口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,098円

■損益の状況

当期 自2018年4月6日 至2019年4月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	6,929,090円
受 取 利 息	7,285,281
支 払 利 息	△356,191
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△10,516,322
売 買 損 益	73,746
売 買 損 益	△10,590,068
(C) そ の 他 費 用	△279
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△3,587,511
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	10,082,629
(F) 解 約 差 損 益 金	△48,033
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	149,933,274
(H) 合 計(D+E+F+G)	156,380,359
次 期 繰 越 損 益 金(H)	156,380,359

(注1) 期首元本額 1,020,388,428円
追加設定元本額 14,995,366,726円
一部解約元本額 4,951,967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	98,710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
マッシュューズ・アジア株式ファンド	99,019,705円
One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円
One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円
One世界分散セレクト (Cコース)	99,040円
リスクコントロール型ETF分散投資ファンド (適格機関投資家限定)	39,612,786円
USD/JPYダイナミックヘッジ戦略ファンド-2019 (適格機関投資家限定)	14,851,485,149円
期末元本合計	16,010,803,187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) (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。