

運用報告書 (全体版)

第8期<決算日2020年12月11日>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|---|---|
| 商品分類 | 追加型投資 / 海外 / 資産複合 | |
| 信託期間 | 2017年1月18日から2027年6月11日までです。 | |
| 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 | ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 以下のマザーファンド受益証券、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券 (ETF) を主要投資対象とします。なお、「D AMマネー・マザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。 |
| | 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。 |
| | 為替ヘッジ外国債券パッシブ・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。 |
| | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 海外の証券取引所に上場している株式 [®] を主要投資対象とします。 ※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を含みます。 |
| | エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 新興国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | マザーファンド受益証券、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券 (ETF) への投資を通じて、海外への株式、債券、不動産投資信託証券 (リート) に実質的に分散投資します。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を行い、為替変動リスクの低減をめざします。 ※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円で為替取引を行う場合があります。 各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直しします。 基準価額の下落を一定水準 (下値目安値 ^(*)) まで抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率 ^(**) を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去12ヵ月間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。 (*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません (相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。) (**) 合計資産比率とは、「D AMマネー・マザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本投資比率をもとに運用を行います。 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社 [®] の投資助言を活用します。 | |
| 組入制限 | 各マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 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。 | |
| 分配方針 | 決算日 (原則として6月、12月の各11日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。 | |

<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。

ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)

愛称：ワールドOne

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、「ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)」は、2020年12月11日に第8期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

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/>

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

■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 | 新株予約権付社債(転換)比率 | 債券先物比率 | 債券組入率 | 投資信託(債券)受託資産比率 | 純資産額 |
|-----------------|------------|--------|-----------|-----------|----------|-----------|----------------|--------|--------|----------------|---------------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | | | | | | | |
| 4期(2018年12月11日) | 円 9,975 | 円 0 | % △3.7 | % 16.5 | % 0.6 | % 35.7 | % - | % - | % - | % 6.4 | 百万円 53,883 |
| 5期(2019年6月11日) | 10,392 | 0 | 4.2 | 26.5 | 2.0 | 58.5 | - | - | 10.4 | 49,438 | |
| 6期(2019年12月11日) | 10,681 | 0 | 2.8 | 27.3 | 0.9 | 57.6 | - | - | 10.2 | 46,310 | |
| 7期(2020年6月11日) | 10,437 | 0 | △2.3 | 4.7 | 0.4 | 56.8 | - | - | 1.7 | 41,188 | |
| 8期(2020年12月11日) | 10,685 | 0 | 2.4 | 18.7 | 1.1 | 63.5 | - | - | 7.2 | 36,032 | |

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

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 株式組入率 | 株式先物比率 | 債券組入率 | 新株予約権付社債(転換)比率 | 債券先物比率 | 債券組入率 | 投資信託(債券)受託資産比率 |
|---------------------|-------------|--------|----------|----------|-----------|----------------|--------|--------|----------------|
| | 騰落率 | | | | | | | | |
| (期首) 2020年6月11日 | 円 10,437 | % - | % 4.7 | % 0.4 | % 56.8 | % - | % - | % - | % 1.7 |
| 6月末 | 10,412 | △0.2 | 6.1 | 0.7 | 60.8 | - | - | 2.4 | |
| 7月末 | 10,489 | 0.5 | 8.0 | 0.7 | 65.6 | - | - | 3.1 | |
| 8月末 | 10,524 | 0.8 | 13.8 | 2.4 | 55.6 | - | - | 5.7 | |
| 9月末 | 10,424 | △0.1 | 13.7 | 1.0 | 58.1 | - | - | 5.2 | |
| 10月末 | 10,408 | △0.3 | 16.3 | 1.1 | 61.5 | - | - | 6.1 | |
| 11月末 | 10,660 | 2.1 | 18.0 | 1.4 | 63.2 | - | - | 7.1 | |
| (期末) 2020年12月11日 | 10,685 | 2.4 | 18.7 | 1.1 | 63.5 | - | - | 7.2 | |

(注1) 騰落率は期首比です。

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

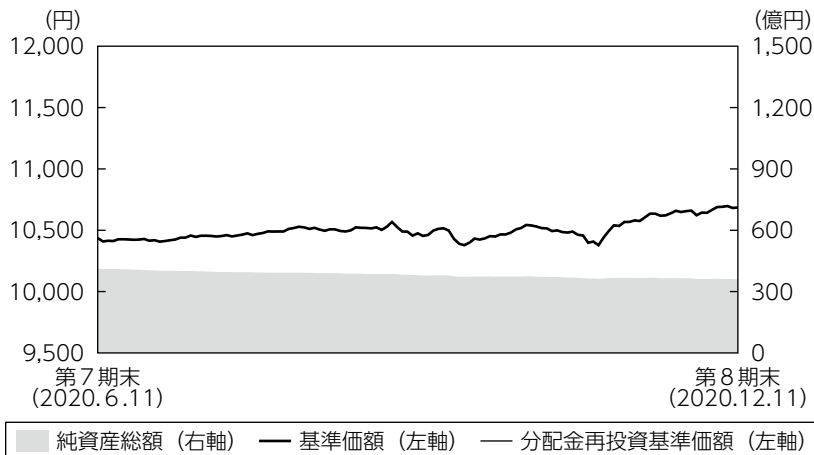
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年6月12日から2020年12月11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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

当期は全ての資産が上昇したため、基準価額は上昇しました。特に株式市場では、期初は欧米における新型コロナウイルスの感染拡大や米中対立激化に対する懸念などから調整する場面もありましたが、経済活動正常化への期待感などから底堅く推移しました。2020年9月以降は米国大統領選挙を巡る不透明感などから調整しましたが、その後米国大統領選挙の結果判明や、11月以降ワクチン開発の進展報道を好感して反発し、前期末比で上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|------------------------------|-------|
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 13.8% |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1.8% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 3.2% |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 21.7% |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 2.7% |

投資環境

先進国株式市場は上昇しました。米国市場は欧米における新型コロナウイルスの感染拡大から調整する場面もありましたが、経済活動正常化への期待感などから底堅く推移しました。2020年9月以降は利益確定の売りが広がったことや大統領選挙を巡る不透明感から調整しましたが、その後、大統領選挙の結果判明等から反発して期末を迎えました。欧州市場は方向感に欠ける展開が続きましたが、11月以降ワクチン開発の進展報道を好感して反発し、各国市場は前期末比で上昇しました。

先進国債券市場では、米国債の利回りは上昇（価格は低下）しました。一方、ドイツ債の利回りは低下（価格は上昇）しました。米国債利回りはF R B（米連邦準備理事会）の金融政策の新戦略を受けて米国金融緩和の長期化観測が強まり利回りは低下していましたが、新型コロナウイルスのワクチン開発の期待を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債については新型コロナウイルス感染再拡大に伴う欧州景気の下振れ懸念やE C B（欧州中央銀行）の追加緩和期待から利回りが低下しました。

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は新型コロナウイルスのワクチン開発進展や感染の再拡大を材料に期半ばにかけて一進一退の展開となりました。期末には米国大統領選挙が終了し政治の先行き不透明感が和らいだことや、米製薬大手が開発中のワクチンが治験で高い有効性を示したとの報道を受け上昇しました。豪州リート市場は上昇基調となり、欧州リート市場は期半ばにかけて下落基調となりましたが、期末には共に上昇しました。

新興国株式市場は上昇しました。米中対立激化に対する懸念などから調整する場面も見られましたが、新型コロナウイルスに対するワクチンの開発や世界的な経済活動再開への期待から堅調に推移しました。2020年9月に入ると米国で大型ハイテク株を中心に売りが広がる中、リスク選好の動きが後退したことから調整しましたが、10月以降、中国経済の底堅さやワクチン開発の進展報道などが好感され堅調に推移しました。

新興国債券市場は上昇（利回りは低下）しました。期初から2020年8月上旬にかけては、ロックダウン（都市封鎖）後の経済活動再開に伴う景気回復期待などから上昇しました。9月には米国の追加経済対策協議の難航や欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて軟調となりましたが、11月以降は米国大統領選挙でのバイデン氏勝利による不透明感の後退やワクチンへの期待感などから、再度上昇しました。米国長期金利は上昇し、対米国債スプレッド（利回り格差）は縮小しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

基本投資比率に基づき、5つのマザーファンドとETF（上場投資信託証券）への分散投資を行いつつ、基準価額の下落幅を抑制することをめざして運用を行いました。当期は、前期に引き続きボラティリティが高かったため、期初の合計資産比率は17%程度でしたが、基準価額の動きに応じて合計資産比率を段階的に引き上げ、期末では63%程度としました。

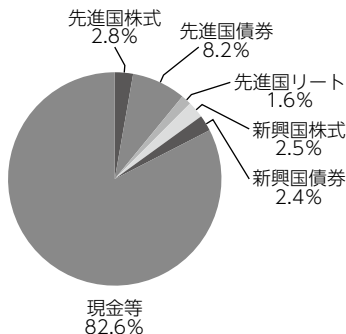
なお、当期の基本投資比率は以下の通りです。

先進国株式：15%、先進国債券：45%、先進国リート：10%、新興国株式：15%、新興国債券：15%

【運用状況】

○資産配分

期首（前期末）

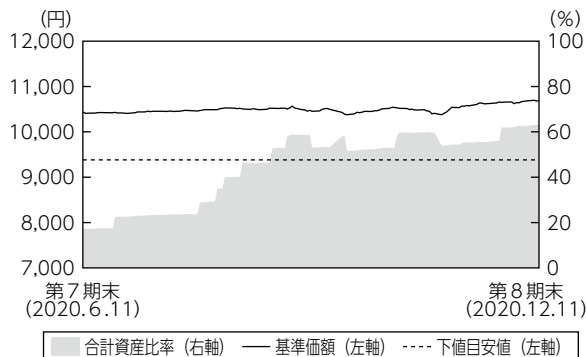


※1 比率は純資産総額に対する割合です。

※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。

※3 先進国株式：外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、先進国債券：為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、先進国リート：外国リート・パッシブ・ファンド・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、新興国債券：エマージング債券パッシブ・マザーファンド。また、マザーファンドの他に上場投資信託証券（ETF）、有価証券指数等先物取引等を含む場合があります。

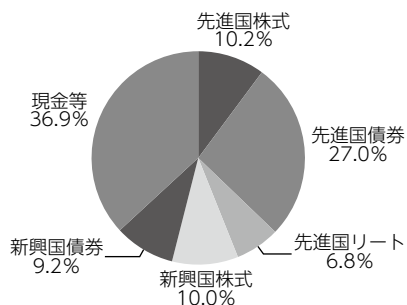
<基準価額、下値目安値、合計資産比率の推移>



※1 合計資産比率は純資産総額に対する「D I A Mマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計の割合です。

※2 基準価額は信託報酬控除後です。

期末



●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。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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、為替ヘッジあり）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たポートフォリオを構築しました。

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|----------------------------|
| | 2020年6月12日 ～2020年12月11日 |
| 当期分配金（税引前） | －円 |
| 対基準価額比率 | －％ |
| 当期の収益 | －円 |
| 当期の収益以外 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 804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、現行の基本投資比率に基づき各マザーファンドへの分散投資を行い、信託財産の成長を図ります。また、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率を機動的に変更することでファンドのリスクをコントロールし、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざした運用を行います。

なお、基本投資比率は原則として年1回見直します。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動したファンドパフォーマンスをめざします。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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目標としたパッシブ運用を行います。

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマーク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。

●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。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第8期 | | 項目の概要 |
|-------------|------------------------------|---------|--|
| | (2020年6月12日 ～2020年12月11日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 65円 | 0.623% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,502円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (32) | (0.303) | |
| (販売会社) | (32) | (0.303) | |
| (受託会社) | (2) | (0.016) | |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.004 | (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) | (0.003) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (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 | 0.006 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.005) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.002) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.013 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (保管費用) | (1) | (0.008) | |
| (監査費用) | (0) | (0.001) | |
| (その他) | (0) | (0.003) | |
| 合計 | 68 | 0.646 | |

(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。

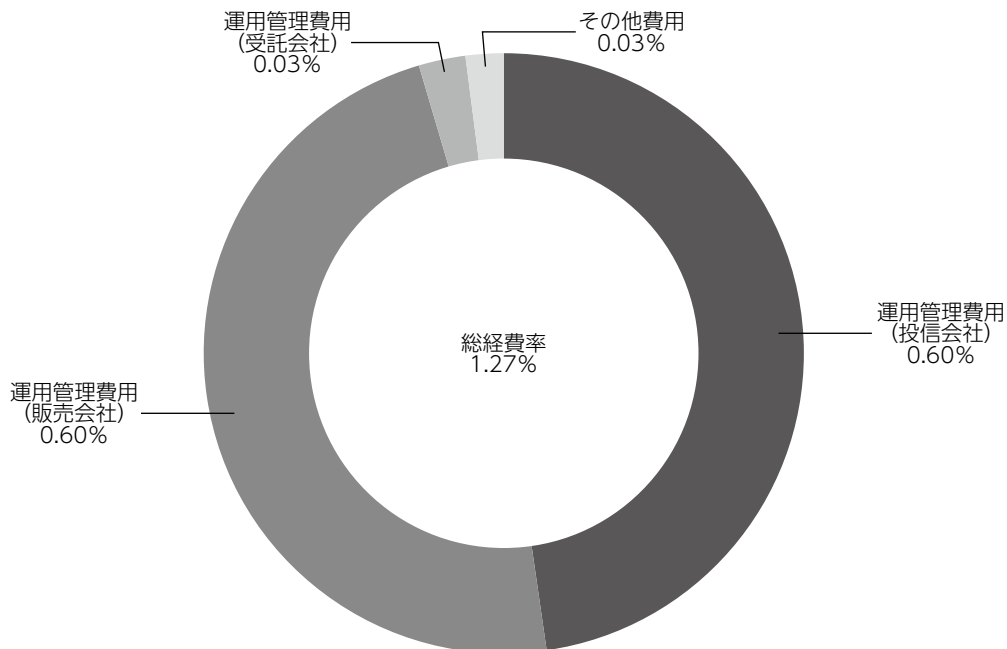
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券(マザーファンドを除く)が支払った費用を含みません。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.27%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■売買及び取引の状況 (2020年6月12日から2020年12月11日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|--------|-----|------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 内 国債証券 | - | 9,021,900 (-) |

(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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2020年6月12日から2020年12月11日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 848,529 | 3,407,354 | 302,684 | 1,185,900 |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 6,133,256 | 9,073,351 | 1,881,322 | 2,783,200 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2,159,480 | 2,432,973 | 660,196 | 711,200 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 2,741,215 | 3,214,144 | 964,906 | 1,125,600 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 1,581,200 | 3,303,467 | 492,442 | 1,017,800 |

■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 | |
|-------------------|-----------------------|----------------------|
| | 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 | 74,903,136千円 | 44,467,519千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 352,130,531千円 | 41,322,440千円 |
| (c) 売買高比率(a)/(b) | 0.21 | 1.07 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2020年6月12日から2020年12月11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) 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 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| 国 債 証 券 | 10,000,000 | 10,002,100 | 27.8 | — | — | — | 27.8 |
| 合 計 | 10,000,000 | 10,002,100 | 27.8 | — | — | — | 27.8 |

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
|------------------|--------|------------|------------|------------|
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 312回 利付国庫債券（10年） | 1.2000 | 10,000,000 | 10,002,100 | 2020/12/20 |
| 合 計 | — | 10,000,000 | 10,002,100 | — |

(2) 外国投資信託受益証券

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | 当 期 | | 末 | |
|---|-------------------|-------------|-----------|-------------|--|
| | □ 数 | □ 数 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (アメリカ・ドル) | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF | 20.5 | 20.5 | 559 | 58,145 | |
| 合 計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | □ 数 20.5 | 559 | 58,145 | |
| | < 1銘柄<0.1%> | < 1銘柄<0.2%> | — | — | |

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

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

(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) 親投資信託残高

| | 期 首 (前期末) | 当 期 | 末 |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千□ | 千□ | 千円 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 298,326 | 844,171 | 3,664,719 |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2,310,540 | 6,562,474 | 9,730,836 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 557,429 | 2,056,714 | 2,434,532 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 915,052 | 2,691,361 | 3,555,288 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 490,833 | 1,579,591 | 3,306,558 |

■投資信託財産の構成

2020年12月11日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 10,002,100 | 27.5 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 58,145 | 0.2 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 3,664,719 | 10.1 |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 9,730,836 | 26.7 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2,434,532 | 6.7 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 3,555,288 | 9.8 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 3,306,558 | 9.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 3,671,629 | 10.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 36,423,810 | 100.0 |

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2020年12月11日現在、62,012千円、0.2%、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは412,407,730千円、99.8%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは523,661,396千円、99.5%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは52,193,399千円、97.5%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは71,190,290千円、99.8%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは142,746,884千円、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、2020年12月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.01円、1カナダ・ドル=81.58円、1オーストラリア・ドル=78.30円、1香港・ドル=13.42円、1シンガポール・ドル=77.95円、1ニュージーランド・ドル=73.73円、1台湾・ドル=3.68円、1イギリス・ポンド=138.28円、1イスラエル・シケル=31.95円、1スイス・フラン=117.41円、1トルコ・リラ=13.18円、1デンマーク・クローネ=16.97円、1ノルウェー・クローネ=11.87円、1スウェーデン・クローナ=12.32円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1フィリピン・ペソ=2.16円、100チリ・ペソ=14.14円、100コロンビア・ペソ=3.04円、1クウェート・ディナール=341.24円、1カタール・リアル=28.35円、1サウジアラビア・リアル=27.78円、1インド・ルピー=1.42円、1パキスタン・ルピー=0.65円、100インドネシア・ルピア=0.73円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=28.36円、1ブラジル・レアル=20.72円、1チェコ・コルナ=4.80円、100韓国・ウォン=9.59円、1オフショア・人民元=15.93円、1マレーシア・リングギット=25.66円、1南アフリカ・ランド=6.93円、1タイ・バーツ=3.46円、1ポーランド・ズロチ=28.53円、100ハンガリー・フォリント=35.69円、1ユーロ=126.29円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年12月11日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--|-----------------|
| (A) 資 産 | 49,303,028,507円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 3,589,712,703 |
| 公 社 債(評価額) | 10,002,100,000 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 58,145,230 |
| 外 国 株 式 パ ッ シ ュ ・ フ ァ ン ド ・ マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額) | 3,664,719,442 |
| 為 替 フ ル ヘ ッ ジ 外 国 債 券 パ ッ シ ュ ・ フ ァ ン ド ・ マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額) | 9,730,836,562 |
| 外 国 リ ー ト ・ パ ッ シ ュ ・ フ ァ ン ド ・ マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額) | 2,434,532,416 |
| エ マ ー ジ ン グ 株 式 パ ッ シ ュ ・ マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額) | 3,555,288,441 |
| エ マ ー ジ ン グ 債 券 パ ッ シ ュ ・ マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額) | 3,306,558,897 |
| 未 収 入 金 | 12,903,930,576 |
| 未 収 利 息 | 57,204,240 |
| (B) 負 債 | 13,270,799,496 |
| 未 払 金 | 12,902,562,400 |
| 未 払 解 約 金 | 129,251,845 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 238,408,190 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 577,061 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 36,032,229,011 |
| 元 本 | 33,721,664,491 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 2,310,564,520 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 33,721,664,491口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D) | 10,685円 |

(注) 期首における元本額は39,462,378,684円、当期中における追加設定元本額は108,436,378円、同解約元本額は5,849,150,571円です。

■損益の状況

当期 自2020年6月12日 至2020年12月11日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 64,458,700円 |
| 受 取 配 当 金 | 202,419 |
| 受 取 利 息 | 66,150,702 |
| 支 払 利 息 | △1,894,421 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,010,419,930 |
| 売 買 益 | 1,355,722,616 |
| 売 買 損 | △345,302,686 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △239,302,946 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 835,575,684 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 105,901,772 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,369,087,064 |
| (配 当 等 相 当 額) | (946,976,864) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (422,110,200) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 2,310,564,520 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | 2,310,564,520 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,369,087,064 |
| (配 当 等 相 当 額) | (947,021,906) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (422,065,158) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 1,765,776,885 |
| 繰 越 損 益 金 | △824,299,429 |

(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 | 191,725,867円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 947,021,906 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 1,574,051,018 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 2,712,798,791 |
| (f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額 | 804.47 |
| (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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2020年2月17日）

（計算期間 2019年2月16日～2020年2月17日）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | MSCIコクサイ・インデックス | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|-------|---------------------------------------|-------|------------|------------|-----------|
| | 円 | % | （円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | ポイント | | | |
| 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 |
| 18期(2020年2月17日) | 41,812 | 21.5 | 1,354,548.25 | 21.9 | 94.7 | 2.7 | 370,420 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

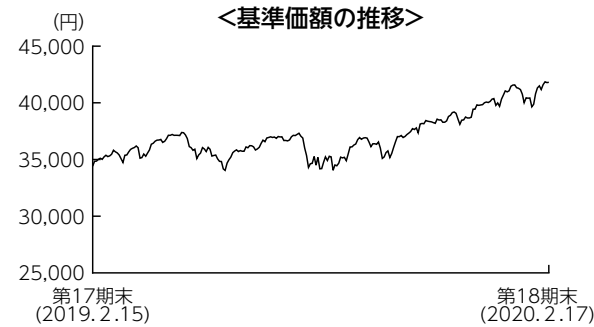
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2019年2月16日から2020年2月17日まで）

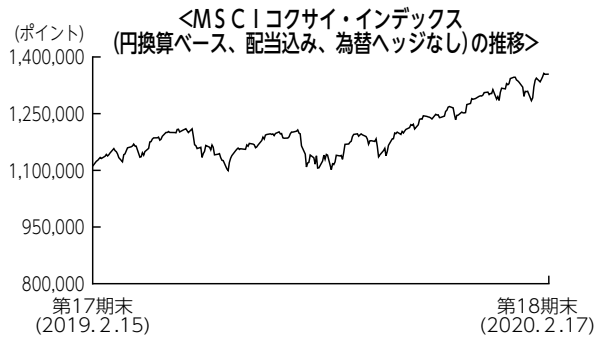


基準価額の推移

当期末の基準価額は41,812円となり、前期末比で21.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場において、米ドルやユーロなどの通貨に対して円高となったことはマイナスに寄与したものの、米国のハト派的な金融政策や米中貿易協議の進展期待などから、米国や欧州などの株式市場が力強く上昇し、基準価額は上昇しました。



投資環境

外国株式市場は、米国が金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから2019年4月下旬にかけて堅調に推移しました。その後方向感の定まらない展開となりましたが、10月中旬以降は米中貿易協議への進展期待から上昇傾向となりました。2020年に入ると、中東情勢の悪化懸念や新型コロナウイルスの感染拡大などから一時下落する場面があったものの、前期末比で大きく上昇しました。欧州市場では英国やイタリアの政局混乱など不安要因はありましたが、前期末比で上昇しました。

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

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

期末

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



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で21.9%上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------|------|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 | 1円 | 0.002% |
| (株 式) | (0) | (0.001) |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投 資 証 券) | (0) | (0.000) |
| (b) 有価証券取引税 | 1 | 0.004 |
| (株 式) | (1) | (0.004) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投 資 証 券) | (0) | (0.000) |
| (c) その他費用 | 13 | 0.034 |
| (そ の 他) | (13) | (0.034) |
| 合 計 | 15 | 0.040 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(37,077円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2019年2月16日から2020年2月17日まで)

(1) 株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---------------------------------|------------------|----------|--------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | (-) | (-) | 0.998 | 152 |
| BOSTON PROPERTIES INC | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 17.771 | 747 | 1.282 | 165 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PROLOGIS INC | (-) | (-) | 17.307 | 158 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | (-) | (-) | 6.948 | 584 |
| EQUINIX INC | 0.553 | 306 | (-) | (-) |
| DUKE REALTY TRUST | (-) | (-) | 0.995 | 554 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 2.731 | 334 | (-) | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 0.47 | 149 | 5.676 | 183 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 5.493 | 432 | (-) | (-) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 11.666 | 378 | 1.048 | 326 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 0.579 | 153 | (-) | (-) |
| WELLTOWER INC | 2.255 | 198 | 10.6 | 825 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE MACERICH COMPANY | (△11.649) | (-) | 3.465 | 302 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | (-) | (-) | 9.014 | 240 |
| MID AMERICA | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REALTY INCOME CORP | 8.128 (6.813) | 974 | 1.315 | 159 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | (-) | (-) | 8.885 | 151 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | (-) | (-) | 1.424 | 169 |
| | 2.065 | 151 | (-) | (-) |
| | (-) | (-) | 5.19 | 382 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|-----------|-------------|--------|-------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| REGENCY CENTERS CORP | 7.479 | 483 | 9.099 | 590 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UDR INC | 4.195 | 188 | 3.508 | 157 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 3.846 | 631 | 7.04 | 1,105 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PUBLIC STORAGE | - | - | 1.533 | 370 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 8.681 | 1,108 | 1.263 | 159 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VENTAS INC | 3.913 | 259 | 4.652 | 329 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 2.506 | 148 | 5.38 | 331 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WEYERHAEUSER CO | - | - | 6.078 | 148 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 2.161 | 226 | 4.785 | 497 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | - | - | 2.783 | 338 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 39.953 | 829 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VEREIT INC | 12.782 | 123 | 23.607 | 226 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN TOWER CORP | 2.719 | 577 | 7.003 | 1,510 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WP CAREY INC | 1.702 | 150 | 3.811 | 334 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVITATION HOMES INC | 11.957 | 342 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | - | - | 19.124 | 373 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VICI PROPERTIES INC | 34.2 | 841 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | - | - | 6.221 | 202 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 7.819 | 430 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | - | - | (-) | (-) |
| | (17.676) | (388) | (-) | (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 11.77 | 308 | 7.978 | 208 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| MIRVAC GROUP | 110.284 | 354 | 76.649 | 242 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GPT GROUP | 89.108 | 550 | 75.831 | 465 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LENLEASE GROUP | - | - | 17.897 | 223 |
| | (△42.974) | (△572) | (-) | (-) |
| DEXUS | 20.313 | 265 | 16.334 | 212 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN GROUP | - | - | 15.521 | 230 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SCENTRE GROUP | - | - | 56.688 | 217 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| LINK REIT | - | - | 27.6 | 2,435 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----------|------------|--------|------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV T | (-) | (△5) | (-) | (-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 192.3 | 461 | (-) | (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS | (-) | (△0.05769) | (-) | (-) |
| | (32.128) | (-) | 32.128 | 7 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 20.951 | 127 | 23.003 | 122 |
| HAMMERSON PLC | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | (-) | (-) | 58.616 | 162 |
| SEGRO PLC | 15.752 | 142 | (-) | (-) |
| | (-) | (-) | 18.971 | 175 |
| | 22.038 | 146 | (-) | (-) |
| | (-) | (-) | 17.705 | 123 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (オランダ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | (-) | (-) | 1.163 | 153 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| COVIVIO | 1.446 | 136 | 1.856 | 168 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|-----------|---------------|---------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 株式先物取引 | 百万円 84,266 | 百万円 82,751 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 88,699,016千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 335,421,941千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.26 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2019年2月16日から2020年2月17日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-----------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| BOEING CO | 476.45 | 413.69 | 14,085 | 1,546,613 | 航空宇宙・防衛 |
| ROBERT HALF INTL INC | 108.27 | 83.24 | 501 | 55,021 | 専門サービス |
| BORGWARNER INC | 215.54 | 172.1 | 587 | 64,531 | 自動車部品 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 1,198.2 | 1,066.58 | 4,512 | 495,494 | ヘルスケア機器・用品 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 117.55 | 99.88 | 719 | 78,972 | 航空貨物・物流サービス |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 101.53 | 87.66 | 994 | 109,177 | 娯楽 |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC | 21.42 | 19.29 | 1,472 | 161,648 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,426.27 | 1,814.88 | 12,047 | 1,322,779 | 医薬品 |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP INC | 52.15 | — | — | — | 資本市場 |
| INGREDION INC | 53.05 | 53.05 | 516 | 56,699 | 食品 |
| ONEOK INC | 374.02 | 324.27 | 2,496 | 274,086 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 59 | 59 | 665 | 73,080 | 保険 |
| UNITED RENTALS INC | 76.93 | 61.81 | 969 | 106,456 | 商社・流通業 |
| SEMPRA ENERGY | 230.49 | 215.99 | 3,476 | 381,727 | 総合公益事業 |
| FEDEX CORP | 215.25 | 193.68 | 3,072 | 337,322 | 航空貨物・物流サービス |
| VERISIGN INC | 96.48 | 80.48 | 1,686 | 185,190 | 情報技術サービス |
| AMPHENOL CORP | 252.01 | 227.63 | 2,368 | 260,110 | 電子装置・機器・部品 |
| BROWN-FORMAN CORP | 235.58 | 243.81 | 1,740 | 191,140 | 飲料 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 1,532.41 | 1,252.54 | 903 | 99,158 | メディア |
| CSX CORP | 710.27 | 595.4 | 4,738 | 520,318 | 陸運・鉄道 |
| CABOT OIL & GAS CORP | 382.55 | 314.16 | 464 | 51,052 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CAMPBELL SOUP CO | 140.5 | 140.5 | 683 | 75,036 | 食品 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 243.37 | 200.52 | 1,082 | 118,870 | コンピュータ・周辺機器 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 145.53 | 128.2 | 2,613 | 286,918 | 飲料 |
| CARDINAL HEALTH INC | 269.19 | 229.5 | 1,368 | 150,237 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED | 354.48 | 319.62 | 1,361 | 149,501 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CATERPILLAR INC | 521.82 | 432.58 | 5,969 | 655,415 | 機械 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 112.32 | 98.65 | 1,155 | 126,840 | ソフトウェア |
| CELGENE CORP | 608.71 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| CITRIX SYSTEMS INC | 125.26 | 94.64 | 1,154 | 126,807 | ソフトウェア |
| CENTURYLINK INC | 804.24 | 804.24 | 1,117 | 122,744 | 各種電気通信サービス |
| CERNER CORP | 264.14 | 251.43 | 1,937 | 212,767 | ヘルスケア・テクノロジー |
| JPMORGAN CHASE & CO | 2,927.32 | 2,476.52 | 34,042 | 3,737,838 | 銀行 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 222.43 | 198.96 | 1,520 | 166,967 | 家庭用品 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 142.86 | 112.22 | 1,292 | 141,958 | 保険 |
| CINTAS CORP | 79.44 | 66.04 | 1,987 | 218,173 | 商業サービス・用品 |
| CISCO SYSTEMS INC | 4,106.72 | 3,309.4 | 15,544 | 1,706,758 | 通信機器 |
| CLOROX COMPANY | 108.85 | 98.76 | 1,627 | 178,739 | 家庭用品 |
| COCA-COLA CO/THE | 3,520.46 | 3,147.58 | 18,869 | 2,071,897 | 飲料 |
| COPART INC | 189.44 | 167.49 | 1,729 | 189,880 | 商業サービス・用品 |
| COGNEX CORP | 152.91 | 122.84 | 660 | 72,510 | 電子装置・機器・部品 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 710 | 627.79 | 4,814 | 528,634 | 家庭用品 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 263.13 | 221.45 | 3,208 | 352,327 | ホテル・レストラン・レジャー |
| COMERICA INC | 149.31 | 119.85 | 752 | 82,589 | 銀行 |
| NRG ENERGY, INC. | 256.31 | 210.39 | 842 | 92,541 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| COMCAST CORP-CL A | 3,943.84 | 3,511.08 | 16,182 | 1,776,845 | メディア |
| CONAGRA BRANDS INC | 405.73 | 358.02 | 1,170 | 128,506 | 食品 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 267.33 | 252.2 | 2,378 | 261,131 | 総合公益事業 |
| CMS ENERGY CORP | 236.16 | 229.37 | 1,571 | 172,541 | 総合公益事業 |
| COOPER COS INC | 44.84 | 39.36 | 1,390 | 152,690 | ヘルスケア機器・用品 |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO | 162 | 132.2 | 730 | 80,198 | 飲料 |
| CORNING INC | 686.91 | 583.76 | 1,668 | 183,252 | 電子装置・機器・部品 |
| SEALED AIR CORP | 138.7 | 138.7 | 482 | 52,952 | 容器・包装 |
| HEICO CORP-CL A | — | 52.92 | 545 | 59,942 | 航空宇宙・防衛 |
| CUMMINS INC | 131.93 | 119.63 | 1,995 | 219,071 | 機械 |
| DR HORTON INC | 321.52 | 283.55 | 1,752 | 192,437 | 家庭用耐久財 |
| DANAHER CORP | 552.86 | 482.99 | 8,015 | 880,071 | ヘルスケア機器・用品 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|--------------------------------|----------|----------|----------|-----|-----------|--------|-------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 千株 | 千ドル | | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | | | | |
| MOODY'S CORP | 154.93 | 129.22 | 3,590 | | 394,195 | | 資本市場 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 503.31 | 423.7 | 2,898 | | 318,305 | | 情報技術サービス |
| TARGET CORP | 436.5 | 394.21 | 4,597 | | 504,824 | | 複合小売り |
| DEERE & CO | 262.37 | 238.24 | 4,004 | | 439,650 | | 機械 |
| MORGAN STANLEY | 1,132.17 | 951.98 | 5,315 | | 583,681 | | 資本市場 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 198.91 | 180.81 | 1,815 | | 199,383 | | 商業サービス・用品 |
| COSTAR GROUP INC | 29.94 | 27.85 | 2,036 | | 223,647 | | 専門サービス |
| THE WALT DISNEY CO | 1,280.37 | 1,394.4 | 19,457 | | 2,136,428 | | 娯楽 |
| DOLLAR TREE INC | 200.78 | 186.97 | 1,658 | | 182,053 | | 複合小売り |
| DOVER CORP | 126.35 | 111.13 | 1,332 | | 146,254 | | 機械 |
| OMNICOM GROUP | 193.25 | 173.65 | 1,356 | | 148,987 | | メディア |
| DTE ENERGY CO | 160.34 | 148.17 | 1,985 | | 218,038 | | 総合公益事業 |
| DUKE ENERGY CORP | 611.77 | 568.01 | 5,752 | | 631,658 | | 電力 |
| FLOWERVE CORP | 131.39 | 98.82 | 458 | | 50,356 | | 機械 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 109.9 | 97 | 1,180 | | 129,628 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| EBAY INC | 832.27 | 637.71 | 2,432 | | 267,058 | | インターネット販売・通信販売 |
| BANK OF AMERICA CORP | 8,277.12 | 6,844.79 | 23,854 | | 2,619,179 | | 銀行 |
| CITIGROUP INC | 2,166.9 | 1,746.72 | 13,762 | | 1,511,112 | | 銀行 |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 130.09 | 94.23 | 704 | | 77,319 | | 化学 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 216.24 | 171.04 | 755 | | 82,989 | | 資本市場 |
| EATON CORP PLC | 384.09 | 318.18 | 3,294 | | 361,763 | | 電気設備 |
| EATON VANCE CORP | 91.84 | 91.84 | 451 | | 49,563 | | 資本市場 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 249.22 | 226.28 | 1,782 | | 195,683 | | ソフトウェア |
| DISH NETWORK CORP | 217.62 | 177.49 | 709 | | 77,895 | | メディア |
| ECOLAB INC | 221.92 | 204.79 | 4,245 | | 466,156 | | 化学 |
| PERKINELMER INC | - | 83.38 | 796 | | 87,486 | | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| ELECTRONIC ARTS INC | 272.14 | 224.91 | 2,467 | | 270,880 | | 娯楽 |
| SALESFORCE.COM INC | 624.35 | 644.04 | 12,233 | | 1,343,242 | | ソフトウェア |
| ERIE INDEMNITY CO | - | 22.43 | 366 | | 40,281 | | 保険 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 543.24 | 467.05 | 3,433 | | 376,974 | | 電気設備 |
| ATMOS ENERGY CORP | 102.2 | 86.5 | 1,041 | | 114,399 | | ガス |
| ENERGY CORP | 162.59 | 150.31 | 2,016 | | 221,368 | | 電力 |
| EOG RESOURCES INC | 507.26 | 446.03 | 3,341 | | 366,913 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EQUIFAX INC | 102.31 | 91.61 | 1,492 | | 163,917 | | 専門サービス |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE | 194.24 | 173.46 | 3,729 | | 409,506 | | パーソナル用品 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL | 147.92 | 125.15 | 918 | | 100,848 | | 航空貨物・物流サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 3,696.52 | 3,276.09 | 19,869 | | 2,181,669 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FMC CORP | 126.34 | 102.09 | 1,076 | | 118,226 | | 化学 |
| NEXTERA ENERGY INC | 412.34 | 374.04 | 10,417 | | 1,143,870 | | 電力 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | - | 28.75 | 861 | | 94,557 | | 資本市場 |
| ASSURANT INC | 40.89 | 45.94 | 654 | | 71,890 | | 保険 |
| FASTENAL CO | 254.18 | 458.91 | 1,758 | | 193,088 | | 商社・流通業 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 600.5 | 581.44 | 1,721 | | 188,972 | | 銀行 |
| M&T BANK CORP | 124.94 | 99.99 | 1,697 | | 186,399 | | 銀行 |
| FISERV INC | 357.37 | 443.49 | 5,424 | | 595,639 | | 情報技術サービス |
| FLIR SYSTEMS INC | 116.23 | 116.23 | 668 | | 73,394 | | 電子装置・機器・部品 |
| MACY'S INC | 247.41 | - | - | | - | | 複合小売り |
| FORD MOTOR CO | 3,243.91 | 3,108.36 | 2,517 | | 276,451 | | 自動車 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 285.48 | 237.13 | 577 | | 63,425 | | 資本市場 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 1,172.69 | 1,149.93 | 1,407 | | 154,545 | | 金属・鉱業 |
| FLEX LTD | 676.69 | 351.27 | 477 | | 52,377 | | 電子装置・機器・部品 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 164.78 | 142.7 | 1,557 | | 171,036 | | 保険 |
| GAP INC/THE | 182.95 | 182.95 | 331 | | 36,439 | | 専門小売り |
| DENTSPLY SIRONA INC | 174.77 | 183.86 | 1,063 | | 116,786 | | ヘルスケア機器・用品 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 221.43 | 188.21 | 3,539 | | 388,634 | | 航空宇宙・防衛 |
| GENERAL MILLS INC | 527.09 | 461.41 | 2,459 | | 270,083 | | 食品 |
| GENUINE PARTS CO | 134.32 | 116.05 | 1,119 | | 122,924 | | 販売 |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-------------------------------|----------|----------|----------|------------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| BLACKROCK INC/NEW YORK | 103.26 | 89.29 | 5,053 | 554,849 | 資本市場 |
| KOHL'S CORP | 149.1 | 119.1 | 529 | 58,154 | 複合小売り |
| KROGER CO | 666.1 | 639.44 | 1,805 | 198,204 | 食品・生活必需品小売り |
| LAM RESEARCH CORP | 137.25 | 111.39 | 3,779 | 414,985 | 半導体・半導体製造装置 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | - | 27.16 | 1,057 | 116,149 | 航空宇宙・防衛 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 89.82 | 71.43 | 706 | 77,598 | 容器・包装 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 154.52 | 132.54 | 1,321 | 145,048 | 情報技術サービス |
| LEGGETT & PLATT INC | 95.88 | 109.28 | 498 | 54,715 | 家庭用耐久財 |
| LENNAR CORP | 260.65 | 227.53 | 1,600 | 175,753 | 家庭用耐久財 |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC | 298.62 | 207.95 | 488 | 53,588 | 各種金融サービス |
| ELI LILLY & CO | 845.73 | 672.42 | 9,489 | 1,041,913 | 医薬品 |
| L BRANDS INC | 216.98 | - | - | - | 専門小売り |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 188.9 | 153.44 | 937 | 102,956 | 保険 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 605.55 | 539.13 | 5,712 | 627,186 | 航空貨物・物流サービス |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 281.67 | 236.62 | 2,030 | 222,967 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 225.6 | 196.76 | 8,615 | 945,941 | 航空宇宙・防衛 |
| LOEWS CORP | 213.46 | 217.59 | 1,179 | 129,467 | 保険 |
| LOWE'S COS INC | 710.7 | 599.41 | 7,517 | 825,454 | 専門小売り |
| DOMINION ENERGY INC | 654.73 | 637.96 | 5,579 | 612,639 | 総合公益事業 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 464.14 | 385.73 | 1,215 | 133,497 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MCCORMICK & CO INC | 109.52 | 99.35 | 1,657 | 181,999 | 食品 |
| MCDONALD'S CORPORATION | 675.89 | 587.12 | 12,745 | 1,399,487 | ホテル・レストラン・レジャー |
| S&P GLOBAL INC | 215.99 | 190.18 | 5,850 | 642,427 | 資本市場 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 37.51 | 31.14 | 907 | 99,624 | 保険 |
| MANPOWERGROUP INC | 62.65 | 45.55 | 422 | 46,362 | 専門サービス |
| MARKEL CORPORATION | 12.22 | 10.65 | 1,409 | 154,782 | 保険 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 185.26 | 165.61 | 3,818 | 419,231 | ヘルスケア機器・用品 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 435.93 | 388.72 | 4,617 | 506,970 | 保険 |
| MASCO CORP | 286.38 | 212.16 | 967 | 106,249 | 建設関連製品 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 53.82 | 47.86 | 1,261 | 138,459 | 建設資材 |
| MATTEL INC | 240.03 | - | - | - | レジャー用品 |
| METLIFE INC | 702.51 | 612.6 | 3,202 | 351,653 | 保険 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 243.23 | 213.86 | 1,359 | 149,250 | 半導体・半導体製造装置 |
| MEDTRONIC PLC | 1,179.47 | 1,037.71 | 12,175 | 1,336,864 | ヘルスケア機器・用品 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 629.53 | 602.43 | 3,826 | 420,164 | 娯楽 |
| CVS HEALTH CORP | 1,131.5 | 1,004.51 | 7,169 | 787,176 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MERCK & CO.INC. | 2,319.3 | 1,983.19 | 16,391 | 1,799,738 | 医薬品 |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 398.97 | 326.86 | 700 | 76,946 | 半導体・半導体製造装置 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 89.94 | 80.49 | 1,571 | 172,584 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MICROSOFT CORP | 6,344.42 | 5,617.88 | 104,127 | 11,433,189 | ソフトウェア |
| MICRON TECH INC | 1,016.04 | 847.94 | 4,960 | 544,657 | 半導体・半導体製造装置 |
| MIDDLEBY CORP | 41 | 41.88 | 476 | 52,297 | 機械 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 202.69 | 184.73 | 2,020 | 221,818 | 半導体・半導体製造装置 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 552.42 | 487.15 | 1,223 | 134,364 | 半導体・半導体製造装置 |
| 3M CO | 505.59 | 442.96 | 7,132 | 783,104 | コンプロマリット |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 60.93 | 49.76 | 686 | 75,387 | 家庭用耐久財 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 146.8 | 125.93 | 2,322 | 254,985 | 通信機器 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 88.56 | 76.14 | 1,322 | 145,166 | 陸運・鉄道 |
| MYLAN NV | 435.74 | 435.74 | 954 | 104,778 | 医薬品 |
| ILLUMINA INC | 126.9 | 116.19 | 3,473 | 381,352 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| XCEL ENERGY INC | 447.02 | 389.63 | 2,737 | 300,581 | 電力 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | - | 65.45 | 682 | 74,954 | バイオテクノロジー |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 334.68 | 271.94 | 622 | 68,347 | エネルギー設備・サービス |
| NETAPP INC | 231.04 | 179.63 | 974 | 106,979 | コンピュータ・周辺機器 |
| NEWELL BRANDS INC | 433.8 | 333.17 | 669 | 73,529 | 家庭用耐久財 |
| NEWMONT CORP | 455.65 | 638.69 | 2,814 | 309,054 | 金属・鉱業 |
| NVR INC | 3.07 | 2.63 | 1,050 | 115,325 | 家庭用耐久財 |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|--|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 371.25 | 315 | 1,501 | 164,910 | 保険 |
| ROSS STORES INC | 328.58 | 288.14 | 3,508 | 385,284 | 専門小売り |
| ROLLINS INC | 123.78 | 123.78 | 492 | 54,119 | 商業サービス・用品 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 92.48 | 79.49 | 3,121 | 342,774 | コンピュータリット |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 104.39 | 92.51 | 1,856 | 203,842 | 電気設備 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 141.21 | 140.75 | 1,592 | 174,881 | ホテル・レストラン・レジャー |
| RPM INTERNATIONAL INC | - | 111.41 | 840 | 92,284 | 化学 |
| RAYTHEON COMPANY | 246.16 | 219.72 | 4,991 | 548,077 | 航空宇宙・防衛 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 38.48 | 38.48 | 395 | 43,446 | 情報技術サービス |
| ACCENTURE PLC-CL A | 558.07 | 493.57 | 10,481 | 1,150,917 | 情報技術サービス |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 1,256.93 | 1,113.85 | 6,647 | 729,890 | 食品 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 110.16 | 101.9 | 2,177 | 239,067 | 保険 |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC | 231.27 | 195.63 | 2,694 | 295,910 | 保険 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 293.13 | 474.12 | 7,464 | 819,607 | 情報技術サービス |
| BOOKING HOLDINGS INC | 41.54 | 32.83 | 6,536 | 717,688 | インターネット販売・通信販売 |
| SCHLUMBERGER LTD | 1,211.22 | 1,065.93 | 3,668 | 402,848 | エネルギー設備・サービス |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 1,052.64 | 898.67 | 4,244 | 466,037 | 資本市場 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 181.38 | 155.9 | 2,500 | 274,569 | ヘルスケア機器・用品 |
| BUNGE LTD | 103.34 | 106.22 | 575 | 63,236 | 食品 |
| SEI INVESTMENTS CO | 122.94 | 106.53 | 730 | 80,171 | 資本市場 |
| ANTHEM INC | 227.8 | 197.28 | 5,875 | 645,118 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 147.24 | 127.49 | 1,202 | 132,088 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 260.93 | 221.75 | 1,249 | 137,226 | 保険 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 73.97 | 63.67 | 3,727 | 409,286 | 化学 |
| CENTENE CORP | 342.56 | 461.24 | 2,995 | 328,883 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SVB FINANCIAL GROUP | 48.52 | 40.44 | 1,073 | 117,854 | 銀行 |
| IAC INTERACTIVE CORP | 69.38 | 62.52 | 1,487 | 163,345 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SMITH (A.O.) CORP | 146.99 | 113.51 | 498 | 54,751 | 建設関連製品 |
| ACUITY BRANDS INC | 30.87 | 30.87 | 360 | 39,623 | 電気設備 |
| SNAP-ON INC | 49.35 | 39.81 | 622 | 68,303 | 機械 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 350.83 | 313.88 | 2,965 | 325,616 | 保険 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 63.3 | 52.97 | 707 | 77,697 | 専門小売り |
| EDISON INTERNATIONAL | 295.04 | 266.52 | 2,055 | 225,741 | 電力 |
| SOUTHERN CO | 865.24 | 800.67 | 5,526 | 606,779 | 電力 |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 677.81 | 1,036.81 | 5,696 | 625,446 | 銀行 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 113.52 | 113.52 | 658 | 72,256 | 旅客航空輸送業 |
| AT&T INC | 6,330.05 | 5,656.86 | 21,637 | 2,375,796 | 各種電気通信サービス |
| CHEVRON CORP | 1,647.12 | 1,471.08 | 16,193 | 1,778,062 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 130.77 | 117.76 | 1,966 | 215,893 | 機械 |
| STATE STREET CORP | 336.8 | 295.9 | 2,303 | 252,933 | 資本市場 |
| STARBUCKS CORP | 1,179.2 | 923.12 | 8,241 | 904,929 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STEEL DYNAMICS INC | 190.3 | 175.47 | 499 | 54,794 | 金属・鋳業 |
| STRYKER CORP | 296.38 | 258.5 | 5,726 | 628,803 | ヘルスケア機器・用品 |
| NETFLIX INC | 380.42 | 338.6 | 12,880 | 1,414,261 | 娯楽 |
| SUNTRUST BANKS INC | 408.38 | - | - | - | 銀行 |
| NORTONLIFELOCK INC | 553.68 | 489.55 | 1,011 | 111,052 | ソフトウェア |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 97.93 | 97.93 | 382 | 42,000 | 陸運・鉄道 |
| SYNOPSIS INC | 132.39 | 118.55 | 1,936 | 212,629 | ソフトウェア |
| SYSCO CORP | 430.43 | 382.29 | 2,989 | 328,289 | 食品・生活必需品小売り |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 99.01 | 88.5 | 5,339 | 586,303 | ヘルスケア機器・用品 |
| TELEFLEX INC | 39.05 | 34.55 | 1,335 | 146,679 | ヘルスケア機器・用品 |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 805.53 | 883.22 | 1,079 | 118,506 | 医薬品 |
| TERADYNE INC | - | 121.62 | 853 | 93,690 | 半導体・半導体製造装置 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 846.28 | 720.56 | 9,526 | 1,046,012 | 半導体・半導体製造装置 |
| TEXTRON INC | 221.99 | 163.04 | 783 | 86,071 | 航空宇宙・防衛 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 353.36 | 309.95 | 10,513 | 1,154,348 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| TIFFANY & CO | 87.33 | 87.33 | 1,172 | 128,749 | 専門小売り |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 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 | |
| GLOBE LIFE INC | 106.61 | 72.82 | 807 | 88,711 | 保険 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 143.84 | — | — | — | 情報技術サービス |
| DAVITA INC | 108.78 | 81.59 | 701 | 77,025 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| TRACTOR SUPPLY CO | 110.88 | 95.73 | 939 | 103,187 | 専門小売り |
| TRIMBLE INC | 200.73 | 200.73 | 910 | 99,974 | 電子装置・機器・部品 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | — | 28.51 | 964 | 105,885 | ソフトウェア |
| TYSON FOODS INC | 246.07 | 227.36 | 1,830 | 200,986 | 食品 |
| UGI CORP | 147.25 | 147.97 | 617 | 67,750 | ガス |
| MARATHON OIL CORP | 718.46 | 584.18 | 621 | 68,248 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| UNION PACIFIC CORP | 638.7 | 544.82 | 10,024 | 1,100,710 | 陸運・鉄道 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 709.43 | 634.51 | 9,737 | 1,069,143 | 航空宇宙・防衛 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 839.99 | 733.07 | 21,902 | 2,404,912 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 77.43 | 61.53 | 860 | 94,536 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 84.38 | 72.26 | 1,061 | 116,568 | ヘルスケア機器・用品 |
| VF CORP | 300.57 | 267.5 | 2,237 | 245,721 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VIACOMCBS INC | 307.11 | 453.61 | 1,586 | 174,222 | メディア |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 223.69 | 198.29 | 4,834 | 530,850 | バイオテクノロジー |
| VULCAN MATERIALS CO | 121.42 | 97.94 | 1,439 | 158,048 | 建設資材 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 719.45 | 602.5 | 3,184 | 349,626 | 食品・生活必需品小売り |
| WALMART INC | 1,270.54 | 1,104.64 | 13,022 | 1,429,881 | 食品・生活必需品小売り |
| WASTE MANAGEMENT INC | 369.86 | 323 | 4,061 | 445,977 | 商業サービス・用品 |
| WATERS CORP | 69.53 | 54.68 | 1,181 | 129,719 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| ALLERGAN PLC | 296.2 | 252.62 | 5,009 | 550,093 | 医薬品 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | — | 52.4 | 914 | 100,439 | ヘルスケア機器・用品 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 104.59 | 91.76 | 1,009 | 110,827 | 食品 |
| VAIL RESORTS INC | 37.73 | 31.09 | 775 | 85,140 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESTERN DIGITAL CORP | 260.76 | 225.67 | 1,562 | 171,591 | コンピュータ・周辺機器 |
| WABTEC CORP | 75.3 | 149.64 | 1,152 | 126,596 | 機械 |
| WHIRLPOOL CORP | 55.53 | 46.14 | 702 | 77,086 | 家庭用耐久財 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 162.96 | 139.02 | 1,654 | 181,631 | 半導体・半導体製造装置 |
| WYNN RESORTS LTD | 92.4 | 79.7 | 1,053 | 115,636 | ホテル・レストラン・レジャー |
| NASDAQ INC | 91.32 | 90.2 | 1,048 | 115,084 | 資本市場 |
| CME GROUP INC | 304.37 | 276.73 | 5,897 | 647,594 | 資本市場 |
| WILLIAMS COS INC | 1,061.74 | 907.18 | 1,954 | 214,556 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LKQ CORP | 266.9 | 221.96 | 736 | 80,912 | 販売 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 199.1 | 172.21 | 1,028 | 112,960 | 電力 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 280.63 | 238.39 | 2,428 | 266,646 | 総合公益事業 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 256.64 | 218.2 | 1,080 | 118,689 | 資本市場 |
| CARMAX INC | 159.79 | 120.81 | 1,193 | 131,070 | 専門小売り |
| XEROX CORP | 174.55 | — | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| XILINX INC | 210.93 | 189.97 | 1,712 | 188,082 | 半導体・半導体製造装置 |
| CIMAREX ENERGY CO | 92.53 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TJX COMPANIES INC | 1,073.99 | 930.1 | 5,894 | 647,268 | 専門小売り |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP | — | 41.28 | 985 | 108,223 | 電子装置・機器・部品 |
| ZIONS BANCORP NA | 165.84 | 131.42 | 607 | 66,752 | 銀行 |
| DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS | 274 | 274 | 147 | 16,246 | 食品・生活必需品小売り |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 764 | 764 | 420 | 46,221 | 不動産管理・開発 |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 157 | 157 | 911 | 100,104 | コンゴロマリット |
| JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD | 171 | 171 | 545 | 59,876 | コンゴロマリット |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 81.92 | 81.78 | 1,052 | 115,565 | バイオテクノロジー |
| SIGNATURE BANK | 41.71 | 41.71 | 602 | 66,113 | 銀行 |
| CBRE GROUP INC | 294.99 | 236.13 | 1,510 | 165,829 | 不動産管理・開発 |
| LIBERTY GLOBAL PLC | 198.35 | 127.32 | 258 | 28,420 | メディア |
| WELLCARE HEALTH PLANS INC | 43.5 | — | — | — | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 929.92 | 764.8 | 1,264 | 138,894 | 銀行 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 32.56 | 32.56 | 949 | 104,249 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 30 | 30 | 194 | 21,358 | 化学 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| T-MOBILE US INC | 302.13 | 256.75 | 2,477 | 271,988 | 無線通信サービス |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 333.32 | 277.59 | 1,889 | 207,473 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MOSAIC CO/THE | 314.33 | 282.49 | 529 | 58,157 | 化学 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS | 390.26 | — | — | — | 娯楽 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC | 917.84 | — | — | — | 娯楽 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | — | 28.92 | 999 | 109,770 | 資本市場 |
| CELANESE CORP | 118.8 | 103.26 | 1,136 | 124,740 | 化学 |
| DEXCOM INC | 76.65 | 72.16 | 2,048 | 224,946 | ヘルスケア機器・用品 |
| DISCOVERY INC-A | 104.23 | 104.23 | 314 | 34,573 | メディア |
| EXPEDIA GROUP INC | 103.73 | 115.27 | 1,415 | 155,423 | インターネット販売・通信販売 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 184.75 | 184.75 | 707 | 77,693 | 化学 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 124.93 | 103.12 | 1,843 | 202,470 | 資本市場 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 418.18 | 340.23 | 661 | 72,659 | メディア |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 494.25 | 442.48 | 4,285 | 470,587 | 資本市場 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 146.96 | 146.96 | 252 | 27,738 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VIACOM INC-CLASS B | 302.82 | — | — | — | 娯楽 |
| LIVE NATION | 136.82 | 113.39 | 839 | 92,156 | 娯楽 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 22.24 | 20.4 | 1,880 | 206,507 | ホテル・レストラン・レジャー |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 61.91 | 45.08 | 358 | 39,375 | 旅客航空輸送業 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 43.12 | 36.81 | 2,380 | 261,399 | 航空宇宙・防衛 |
| MASTERCARD INC | 806.15 | 699.14 | 23,837 | 2,617,322 | 情報技術サービス |
| QURATE RETAIL INC | 357.33 | — | — | — | インターネット販売・通信販売 |
| HANESBRANDS INC | 276.19 | 276.19 | 394 | 43,365 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| WESTERN UNION CO | 352.22 | 352.22 | 924 | 101,479 | 情報技術サービス |
| OWENS CORNING | 105.91 | 77.56 | 494 | 54,349 | 建設関連製品 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 131.82 | 111.13 | 1,253 | 137,651 | 情報技術サービス |
| AERCAP HOLDINGS NV | 115.86 | 88.07 | 550 | 60,457 | 商社・流通業 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC | 91.75 | 70.67 | 479 | 52,695 | 航空宇宙・防衛 |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR | 180.99 | 173.5 | 371 | 40,767 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 105.19 | 91.76 | 1,122 | 123,200 | 情報技術サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 296.53 | 295.45 | 480 | 52,715 | 銀行 |
| DELTA AIR LINES INC | 138.98 | 111.58 | 657 | 72,161 | 旅客航空輸送業 |
| INSULET CORP | — | 47.81 | 1,015 | 111,458 | ヘルスケア機器・用品 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 63.54 | 60.38 | 158 | 17,369 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DISCOVER FINANCIAL | 290.57 | 239.78 | 1,832 | 201,197 | 消費者金融 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 296.1 | 256.41 | 2,392 | 262,675 | 電子装置・機器・部品 |
| CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX | 178.07 | 159.7 | 1,244 | 136,650 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WABCO HOLDING INC | 40.76 | 40.76 | 554 | 60,870 | 機械 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 90.8 | 82.55 | 2,100 | 230,596 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VMWARE INC | 66.48 | 65.32 | 1,057 | 116,059 | ソフトウェア |
| MERCADOLIBRE INC | 37.5 | 35 | 2,572 | 282,464 | インターネット販売・通信販売 |
| ULTA BEAUTY INC | 50.2 | 45.77 | 1,348 | 148,037 | 専門小売り |
| INVESCO LTD | 421.25 | 334.43 | 594 | 65,288 | 資本市場 |
| MSCI INC | 75.37 | 67.14 | 2,165 | 237,790 | 資本市場 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,360.77 | 1,203.48 | 10,650 | 1,169,457 | タバコ |
| VISA INC | 1,551.28 | 1,337.71 | 28,130 | 3,088,751 | 情報技術サービス |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 159.33 | 145.36 | 2,025 | 222,362 | 水道 |
| DISCOVERY INC-C | 294.84 | 304.21 | 873 | 95,964 | メディア |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 599.29 | 514.74 | 3,002 | 329,672 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 116.24 | 116.24 | 848 | 93,158 | 建設関連製品 |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE | 1,769.14 | 1,600.64 | 3,521 | 386,650 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| XYLEM INC | 151.11 | 132.37 | 1,166 | 128,104 | 機械 |
| ALKERMES PLC | 120.53 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | 289.87 | 208.76 | 1,724 | 189,334 | 化学 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 34.79 | 34.79 | 856 | 94,050 | 航空宇宙・防衛 |
| SPLUNK INC | 122.4 | 111.94 | 1,931 | 212,044 | ソフトウェア |
| EPAM SYSTEMS INC | — | 40.23 | 952 | 104,578 | 情報技術サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|--------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 金額 | |
| | | | 千円 | 千円 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 241.78 | 206.49 | 3,088 | 339,114 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VERISK ANALYTICS INC | 134.05 | 123.2 | 2,111 | 231,831 | 専門サービス |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 54.74 | 42.73 | 601 | 66,083 | 医薬品 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 74.43 | 68.85 | 2,192 | 240,724 | 情報技術サービス |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 136.76 | 124.53 | 1,466 | 160,976 | 銀行 |
| CIT GROUP INC | 92.87 | — | — | — | 銀行 |
| NXP SEMICONDUCTOR NV | 306 | 213.18 | 2,922 | 320,865 | 半導体・半導体製造装置 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP | — | 98.33 | 753 | 82,756 | 情報技術サービス |
| TARGA RESOURCES CORP | 178.11 | 190.38 | 702 | 77,113 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LEAR CORP | 61.72 | 46.81 | 574 | 63,095 | 自動車部品 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 100.84 | 86.22 | 1,083 | 118,933 | 資本市場 |
| S&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 170 | 172.68 | 1,144 | 125,630 | ソフトウェア |
| DOLLAR GENERAL CORP | 222.91 | 202.52 | 3,200 | 351,406 | 複合小売り |
| FORTINET INC | 113.99 | 111.5 | 1,328 | 145,920 | ソフトウェア |
| AON PLC | 209.42 | 181.89 | 4,287 | 470,788 | 保険 |
| TESLA INC | 109.91 | 105.48 | 8,438 | 926,571 | 自動車 |
| GENERAL MOTORS CO | 1,100.5 | 1,006.95 | 3,500 | 384,317 | 自動車 |
| WORLDPAY INC | 265.92 | — | — | — | 情報技術サービス |
| XPO LOGISTICS INC | 128.25 | 76.14 | 724 | 79,588 | 航空貨物・物流サービス |
| TRIPADVISOR INC | 92.63 | 92.63 | 274 | 30,156 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ALLY FINANCIAL INC | 398.19 | 318.71 | 1,046 | 114,956 | 消費者金融 |
| CAPRI HOLDINGS LTD | 121.38 | 121.38 | 347 | 38,143 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VOYA FINANCIAL INC | 135.25 | 102.73 | 642 | 70,588 | 各種金融サービス |
| APTIV PLC | 225.71 | 189.2 | 1,671 | 183,477 | 自動車部品 |
| PHILLIPS 66 | 381.15 | 342.35 | 3,063 | 336,317 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | — | 58.85 | 720 | 79,104 | ソフトウェア |
| FACEBOOK INC | 2,102.8 | 1,861.56 | 39,870 | 4,377,823 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| IQVIA HOLDINGS INC | 134.26 | 134.53 | 2,210 | 242,723 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 131.09 | 114.24 | 856 | 94,039 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SERVINOW INC | 150.71 | 144.06 | 5,130 | 563,366 | ソフトウェア |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 79.35 | 72.72 | 1,798 | 197,420 | ソフトウェア |
| WORKDAY INC | 123.76 | 122.24 | 2,408 | 264,399 | ソフトウェア |
| ABBVIE INC | 1,319.76 | 1,144.34 | 10,762 | 1,181,724 | バイオテクノロジー |
| ZOETIS INC | 422.09 | 368.25 | 5,309 | 582,934 | 医薬品 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD | 198.21 | 168.99 | 886 | 97,340 | ホテル・レストラン・レジャー |
| COTY INC | 385.41 | 238.13 | 271 | 29,833 | パーソナル用品 |
| NEWS CORP/NEW-CL A | 302.63 | 302.63 | 441 | 48,514 | メディア |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 128.91 | 140.75 | 590 | 64,784 | 商社・流通業 |
| CDW CORP | 130.4 | 114.06 | 1,577 | 173,191 | 電子装置・機器・部品 |
| SPRINT CORP | 638.82 | 638.82 | 555 | 60,953 | 無線通信サービス |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 101.99 | 101.99 | 297 | 32,699 | 旅客航空輸送業 |
| ARCONIC INC | 367.61 | 307.49 | 1,025 | 112,631 | 航空宇宙・防衛 |
| TWILIO INC | — | 91.9 | 1,173 | 128,897 | 情報技術サービス |
| SNAP INC | — | 571.3 | 1,003 | 110,151 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 178.52 | 143.04 | 670 | 73,581 | 娯楽 |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 50.06 | 50.06 | 247 | 27,125 | メディア |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C | 179.31 | 142.05 | 706 | 77,548 | メディア |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 154.1 | 154.1 | 238 | 26,141 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OKTA INC | — | 88.16 | 1,208 | 132,644 | 情報技術サービス |
| BLACK KNIGHT INC | — | 127 | 944 | 103,733 | 情報技術サービス |
| BAKER HUGHES CO | 434.04 | 510.05 | 1,121 | 123,095 | エネルギー設備・サービス |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 126.11 | 106.69 | 1,015 | 111,487 | 食品 |
| ALTICE USA INC-A | — | 138.87 | 398 | 43,776 | メディア |
| TECHNIPFMC LTD | 387.24 | 312.57 | 539 | 59,236 | エネルギー設備・サービス |
| BROADCOM INC | 376.55 | 307.62 | 9,775 | 1,073,321 | 半導体・半導体製造装置 |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | — | 57.25 | 1,387 | 152,367 | ソフトウェア |
| MONGODB INC | — | 34.23 | 586 | 64,393 | 情報技術サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|----------------------------------|----------|--------|-------|---------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| BURLINGTON STORES INC | 60.07 | 50.95 | 1,251 | 137,441 | 専門小売り |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC | 99.85 | — | — | — | 保険 |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | — | 295.78 | 916 | 100,612 | 医薬品 |
| ANTERO RESOURCES CORP | 131.63 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VEEVA SYSTEMS INC | 108.52 | 97.33 | 1,546 | 169,781 | ヘルスケア・テクノロジー |
| TWITTER INC | 562.56 | 575.62 | 2,124 | 233,282 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | 171.81 | 132.14 | 645 | 70,919 | 電気設備 |
| EVERGY INC | 244.27 | 183.88 | 1,330 | 146,054 | 電力 |
| PLAINS GP HOLDINGS LP | 149.35 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC | 129.2 | — | — | — | 通信機器 |
| ALLEGION PLC | 73.25 | 74.69 | 1,037 | 113,911 | 建設関連製品 |
| STERIS PLC | — | 66.58 | 1,121 | 123,188 | ヘルスケア機器・用品 |
| DOCUSIGN INC | — | 72.2 | 645 | 70,880 | ソフトウェア |
| WIX.COM LTD | 40 | 40 | 593 | 65,115 | 情報技術サービス |
| DROPBOX INC | — | 175.73 | 325 | 35,753 | ソフトウェア |
| KKR & CO INC | — | 373.07 | 1,251 | 137,390 | 資本市場 |
| PERRIGO CO PLC | 105.53 | 105.53 | 609 | 66,869 | 医薬品 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 239.27 | 206.55 | 2,338 | 256,796 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ARAMARK | 217.72 | 181.44 | 770 | 84,629 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CIGNA CORP | 328.31 | 290.83 | 6,408 | 703,614 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DELL TECHNOLOGIES INC | 129.6 | 129.6 | 685 | 75,248 | コンピュータ・周辺機器 |
| DOW INC | — | 564.34 | 2,744 | 301,333 | 化学 |
| AMCOR PLC | — | 1,300 | 1,327 | 145,737 | 容器・包装 |
| PINTEREST INC | — | 131.83 | 306 | 33,610 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| XEROX HOLDINGS CORP | — | 174.55 | 660 | 72,484 | コンピュータ・周辺機器 |
| FOX CORP-A | — | 262.57 | 992 | 108,978 | メディア |
| FOX CORP-B | — | 130.09 | 485 | 53,293 | メディア |
| UBER TECHNOLOGIES INC | — | 133.12 | 527 | 57,969 | 陸運・鉄道 |
| CORTEVA INC | — | 593.22 | 1,821 | 200,031 | 化学 |
| BLACKSTONE GROUP INC | — | 508.89 | 3,203 | 351,740 | 資本市場 |
| GRUBHUB INC | 81.58 | 81.58 | 411 | 45,136 | インターネット販売・通信販売 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | — | 39.23 | 1,233 | 135,439 | ソフトウェア |
| SABRE CORP | 258.26 | 198.09 | 436 | 47,937 | 情報技術サービス |
| PARSLEY ENERGY INC | 174.54 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ARISTA NETWORKS INC | 44.41 | 44.41 | 992 | 108,968 | 通信機器 |
| IHS MARKIT LTD | 349.91 | 297.96 | 2,406 | 264,214 | 専門サービス |
| FNF GROUP | 253.11 | 213.72 | 963 | 105,786 | 保険 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 605.68 | 439.86 | 1,484 | 163,001 | 消費者金融 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | 403.2 | 358.2 | 1,385 | 152,090 | 銀行 |
| CYBERARK SOFTWARE LTD | — | 34.57 | 411 | 45,147 | ソフトウェア |
| CDK GLOBAL INC | 127.15 | 99.69 | 519 | 57,028 | ソフトウェア |
| WAYFAIR INC | 50.91 | 50.91 | 419 | 46,094 | インターネット販売・通信販売 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 155.15 | 139.54 | 1,369 | 150,395 | 電子装置・機器・部品 |
| QORVO INC | 108.87 | 88.71 | 940 | 103,267 | 半導体・半導体製造装置 |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 160.89 | 168.88 | 589 | 64,733 | 各種電気通信サービス |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I | 100.18 | 83.07 | 1,138 | 125,022 | メディア |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 231.55 | 170.18 | 508 | 55,851 | 化学 |
| GODADDY INC | 146.41 | 123.28 | 966 | 106,109 | 情報技術サービス |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 328.27 | 262.04 | 560 | 61,543 | 専門サービス |
| TRANSUNION | 172.08 | 150 | 1,471 | 161,620 | 専門サービス |
| SQUARE INC | 268.2 | 264.87 | 2,168 | 238,071 | 情報技術サービス |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 1,993.38 | 587.57 | 3,119 | 342,575 | 化学 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC | 171 | 193.21 | 1,065 | 116,997 | 飲料 |
| WESTROCK CO | 223.94 | 182.84 | 741 | 81,367 | 容器・包装 |
| KRAFT HEINZ CO | 546.03 | 511.63 | 1,375 | 151,003 | 食品 |
| FORTIVE CORP | 267.79 | 225 | 1,750 | 192,229 | 機械 |
| MATCH GROUP INC | — | 45.99 | 351 | 38,630 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 234.91 | 204.17 | 2,119 | 232,719 | 商業サービス・用品 |
| ALPHABET INC-CL A | 260.79 | 231.32 | 35,131 | 3,857,412 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | 1,256.08 | 1,040.4 | 1,502 | 164,956 | コンピュータ・周辺機器 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 986.55 | 864.04 | 10,626 | 1,166,825 | 情報技術サービス |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 232.2 | 354.71 | 953 | 104,728 | 各種金融サービス |
| FIRST DATA CORP | 444.87 | — | — | — | 情報技術サービス |
| DXC TECHNOLOGY CO | 237.34 | 208.48 | 642 | 70,550 | 情報技術サービス |
| ZILLOW GROUP INC-C | 81.34 | 81.66 | 423 | 46,490 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ALPHABET INC-CL C | 273.82 | 242.52 | 36,880 | 4,049,532 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| BEIGENE LTD ADR | 31.59 | 31.59 | 540 | 59,343 | バイオテクノロジー |
| L3 TECHNOLOGIES INC | 67.52 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| CHEMOURS CO | 127.23 | — | — | — | 化学 |
| LINDE PLC | 481.71 | 417.98 | 9,305 | 1,021,788 | 化学 |
| ATHENE HOLDING LTD | 117.84 | 118.47 | 571 | 62,802 | 保険 |
| ROKU INC | — | 66.74 | 869 | 95,447 | 娯楽 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC | 142.27 | 119.86 | 6,411 | 703,948 | メディア |
| VISTRA ENERGY CORP | 300 | 300 | 698 | 76,717 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計 | 株数 銘柄数<比率> | 株数 銘柄数 | 2,232,683 | 245,148,645 | |
| | 263,700.87 593銘柄 | 232,877.56 608銘柄 | — | <66.2%> | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 202.81 | 163.02 | 1,076 | 89,232 | 金属・鉱業 |
| ALIMENTATION COUCHE TARD INC | 397.22 | 684.96 | 3,017 | 250,065 | 食品・生活必需品小売り |
| BARRICK GOLD CORP | 1,507.26 | 1,409.53 | 3,681 | 305,065 | 金属・鉱業 |
| ATCO LTD | 71.93 | 71.93 | 389 | 32,268 | 総合公益事業 |
| BANK OF MONTREAL | 550.83 | 502.86 | 5,119 | 424,211 | 銀行 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 1,049.73 | 945.61 | 7,066 | 585,533 | 銀行 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 285.53 | 255.48 | 1,884 | 156,143 | 銀行 |
| BCE INC | 115.68 | 116.73 | 750 | 62,221 | 各種電気通信サービス |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT | 740.72 | 687.51 | 6,192 | 513,102 | 資本市場 |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 258.19 | 204.15 | 750 | 62,199 | 医薬品 |
| BOMBARDIER INC 'B' | 1,516.15 | 1,516.15 | 250 | 20,728 | 航空宇宙・防衛 |
| SAPUTO INC | 186.01 | 186.01 | 770 | 63,808 | 食品 |
| BLACKBERRY LTD | 396.52 | 396.52 | 306 | 25,397 | ソフトウェア |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO | — | 363.21 | 792 | 65,698 | 総合公益事業 |
| CGI INC | 227.36 | 186.86 | 1,923 | 159,384 | 情報技術サービス |
| CCL INDUSTRIES INC | 113.4 | 113.4 | 665 | 55,147 | 容器・包装 |
| CAE INC | 230 | 230 | 930 | 77,107 | 航空宇宙・防衛 |
| CAMECO CORP | 326.27 | 326.27 | 399 | 33,117 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROGERS COMM-CL B | 308.22 | 276.96 | 1,819 | 150,797 | 無線通信サービス |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 385.86 | 341.11 | 3,753 | 311,049 | 銀行 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 1,080.4 | 914.93 | 3,550 | 294,222 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN TIRE CORP-CL A | 48.62 | 48.62 | 724 | 59,990 | 複合小売り |
| CANADIAN UTILITIES LTD | 91.19 | 91.19 | 382 | 31,667 | 総合公益事業 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 637.81 | 554.93 | 6,908 | 572,469 | 陸運・鉄道 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 114.17 | — | — | — | エケイティブ不動産投資信託 (REITs) |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 201.76 | 159.11 | 586 | 48,635 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OPEN TEXT CORP | 257.88 | 217.95 | 1,379 | 114,279 | ソフトウェア |
| EMPIRE CO LTD | 150.93 | 150.93 | 476 | 39,481 | 食品・生活必需品小売り |
| KINROSS GOLD CORP | 997.41 | 997.41 | 667 | 55,289 | 金属・鉱業 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 98.92 | — | — | — | 商社・流通業 |
| FORTIS INC | 360 | 323.12 | 1,885 | 156,251 | 電力 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 552.96 | 552.96 | 673 | 55,806 | 金属・鉱業 |
| TELUS CORP | 159.45 | 159.45 | 856 | 70,988 | 各種電気通信サービス |
| GREAT WEST LIFECO INC | 277.66 | 207.22 | 720 | 59,666 | 保険 |
| IMPERIAL OIL LTD | 215.42 | 215.42 | 685 | 56,762 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENBRIDGE INC | 1,771.76 | 1,565.99 | 8,774 | 727,033 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| IGM FINANCIAL INC | 84.26 | 29.53 | 116 | 9,643 | 資本市場 |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 額 | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| HYDRO ONE LTD | 273.4 | 273.4 | 801 | 66,375 | 電力 |
| 小 計 | 株 数 : 36,595.21 銘柄 数 <比率> : 88銘柄 | 株 数 : 30,926.62 銘柄 数 <比率> : 85銘柄 | 157,018 | 13,010,568 | <3.5%> |
| (オーストラリア) | 百株 | 百株 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 111.15 | 124.32 | 991 | 73,099 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 2,516.48 | 2,181.8 | 5,805 | 428,059 | 銀行 |
| AMCOR LTD | 1,101.42 | — | — | — | 容器・包装 |
| WESTPAC BANKING CORPORATION | 2,932.6 | 2,654.07 | 6,820 | 502,909 | 銀行 |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 305.69 | — | — | — | 銀行 |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 1,141.25 | 1,156.62 | 1,271 | 93,720 | 金属・鉱業 |
| TELSTRA CORP LTD | 3,606.54 | 2,969.65 | 1,119 | 82,545 | 各種電気通信サービス |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 390.14 | 390.14 | 412 | 30,404 | 銀行 |
| AMP LTD | 3,024.14 | 3,024.14 | 551 | 40,691 | 各種金融サービス |
| ASX LTD | 155.73 | 155.73 | 1,280 | 94,439 | 資本市場 |
| BHP GROUP LTD | 2,596.25 | 2,281.36 | 8,817 | 650,111 | 金属・鉱業 |
| CALTEX AUSTRALIA LTD | 209.46 | 209.46 | 702 | 51,812 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 221.82 | 148.67 | 71 | 5,261 | 複合小売り |
| COMPUTERSHARE LT | 380.4 | 380.4 | 663 | 48,885 | 情報技術サービス |
| CSL LIMITED | 396.08 | 351.66 | 11,646 | 858,705 | バイオテクノロジー |
| REA GROUP LTD | 41.19 | 41.19 | 468 | 34,539 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| TRANSURBAN GROUP | 2,233.54 | 2,064.75 | 3,379 | 249,207 | 運送インフラ |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 486.01 | 486.01 | 578 | 42,677 | 飲料 |
| COCHLEAR LTD | 53.74 | 43.81 | 1,020 | 75,261 | ヘルスケア機器・用品 |
| ORIGIN ENERGY LTD | 1,630.57 | 1,328.6 | 1,030 | 76,015 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 1,535.19 | 1,370.26 | 12,467 | 919,265 | 銀行 |
| BORAL LIMITED | 861.01 | 861.01 | 406 | 29,963 | 建設資材 |
| RIO TINTO LIMITED | 325.62 | 280.81 | 2,742 | 202,175 | 金属・鉱業 |
| APA GROUP | 1,161.93 | 941.06 | 1,079 | 79,583 | ガス |
| ARISTOCRAT LEISU | 531.68 | 453.23 | 1,683 | 124,142 | ホテル・レストラン・レジャー |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 2,067.89 | 1,805.73 | 1,226 | 90,399 | 保険 |
| TPG TELECOM LTD | 287.19 | 287.19 | 231 | 17,066 | 各種電気通信サービス |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 32.75 | 32.75 | 127 | 9,409 | ホテル・レストラン・レジャー |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 460.91 | 339.26 | 1,034 | 76,291 | 建設資材 |
| ORICA LTD | 253.08 | 278.65 | 625 | 46,082 | 化学 |
| CIMIC GROUP LTD | 87.09 | 87.09 | 238 | 17,587 | 建設・土木 |
| LEND LEASE CORP LTD | — | 429.74 | 766 | 56,493 | 不動産管理・開発 |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 369.41 | 369.41 | 522 | 38,539 | 金属・鉱業 |
| SYDNEY AIRPORT | 851.3 | 851.3 | 730 | 53,853 | 運送インフラ |
| MACQUARIE GROUP LTD | 282.5 | 247.65 | 3,679 | 271,295 | 資本市場 |
| WORLEY LTD | 358.28 | 277.72 | 392 | 28,953 | エネルギー設備・サービス |
| SUNCORP GROUP LTD | 1,079.13 | 1,047.83 | 1,317 | 97,111 | 保険 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 2,341.96 | 2,264.21 | 6,192 | 456,581 | 銀行 |
| NEWCREST MINING LTD | 696.38 | 620.8 | 1,737 | 128,114 | 金属・鉱業 |
| OIL SEARCH LTD | 1,388.06 | 1,054.7 | 682 | 50,312 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INCITEC PIVOT LTD | 1,364.26 | 1,364.26 | 421 | 31,081 | 化学 |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | — | 622.82 | 400 | 29,526 | 旅客航空輸送業 |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 1,294.36 | 1,078.2 | 1,525 | 112,486 | 保険 |
| CHALLENGER FINANCIAL SERVICES | 457.07 | 457.07 | 461 | 34,036 | 各種金融サービス |
| SANTOS LTD | 1,338.62 | 1,328.62 | 1,088 | 80,228 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SONIC HEALTHCARE | 430.41 | 346.84 | 1,097 | 80,885 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD | 50 | 44.66 | 99 | 7,356 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 1,942.74 | 1,485.35 | 690 | 50,924 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESFARMERS LTD | 968.21 | 860.51 | 3,928 | 289,628 | 複合小売り |
| ALUMINA LIMITED | 1,846.13 | 1,846.13 | 407 | 30,081 | 金属・鉱業 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 791.15 | 759.44 | 2,493 | 183,826 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 1,175.57 | 956.47 | 4,126 | 304,225 | 食品・生活必需品小売り |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | — | 99.95 | 736 | 54,289 | 資本市場 |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|-------------------|-------------------|--------------|---------------------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | 百株 | 百株 | 千シンガポール・ドル | 千円 | |
| SINGAPORE TECH ENG | 1,250 | 1,250 | 537 | 42,419 | 航空宇宙・防衛 |
| SENBCORP INDUSTRIES | 814 | 814 | 166 | 13,105 | コングロマリット |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 1,237 | 1,237 | 253 | 20,012 | メディア |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 6,921.4 | — | — | — | 食品 |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 1,581 | 1,419 | 3,625 | 286,128 | 銀行 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 290 | 364 | 406 | 32,087 | 不動産管理・開発 |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 59.44 | 59.44 | 173 | 13,678 | 販売 |
| SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD | 901 | 478 | 211 | 16,711 | 運送インフラ |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 689 | 689 | 635 | 50,134 | 資本市場 |
| CAPITALAND LTD | 1,924.15 | 2,045.15 | 760 | 60,042 | 不動産管理・開発 |
| GENTING SINGAPORE LTD | 4,164 | 4,164 | 368 | 29,083 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KEPPEL CORP LTD | 1,684 | 1,011 | 679 | 53,617 | コングロマリット |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 1,779 | 1,779 | 387 | 30,606 | 陸連・鉄道 |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 2,670.53 | 2,515.53 | 2,782 | 219,569 | 銀行 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 7,343.22 | 6,071.22 | 1,954 | 154,283 | 各種電気通信サービス |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 475 | 475 | 409 | 32,313 | 旅客航空輸送業 |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 1,205 | 952 | 2,499 | 197,221 | 銀行 |
| UOL GROUP LIMITED | 405 | 405 | 333 | 26,305 | 不動産管理・開発 |
| VENTURE CORP LTD | 210 | 210 | 358 | 28,307 | 電子装置・機器・部品 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 1,423 | 1,423 | 583 | 46,044 | 食品 |
| YANGZJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 1,888 | 1,888 | 187 | 14,825 | 機械 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | |
| | 38,913.74 21銘柄 | 29,249.34 20銘柄 | 17,314 — | 1,366,497 <0.4%> | |
| (ニュージーランド) | 百株 | 百株 | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 1,145.5 | 852.45 | 711 | 50,259 | 運送インフラ |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | 298.94 | 298.94 | 509 | 36,010 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| A2 MILK CO LTD | 550.91 | 550.91 | 876 | 61,889 | 食品 |
| FISHER & PAYKEL | 426.78 | 431.84 | 1,048 | 74,035 | ヘルスケア機器・用品 |
| FLETCHER BUILDING LTD | 641.04 | 641.04 | 335 | 23,672 | 建設資材 |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 1,596.23 | 1,596.23 | 760 | 53,706 | 各種電気通信サービス |
| MIGHTY RIVER POWER LTD | — | 617.34 | 329 | 23,233 | 電力 |
| MERIDIAN ENERGY LTD | 901.73 | 756.56 | 422 | 29,808 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | |
| | 5,561.13 7銘柄 | 5,745.31 8銘柄 | 4,993 — | 352,616 <0.1%> | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| ANTOFAGASTA PLC | 463.24 | 317.98 | 276 | 39,524 | 金属・鉱業 |
| ASHTREAD GROUP | 421.54 | 366.89 | 982 | 140,751 | 商社・流通業 |
| SEVERN TRENT PLC | 255.3 | 182.17 | 475 | 68,060 | 水道 |
| BHP GROUP PLC | 1,823.43 | 1,612.84 | 2,701 | 386,901 | 金属・鉱業 |
| BARCLAYS PLC | 15,069.06 | 13,428.31 | 2,362 | 338,244 | 銀行 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 1,037.64 | 822.83 | 716 | 102,582 | 家庭用耐久財 |
| BT GROUP PLC | 7,604.43 | 6,307.77 | 968 | 138,652 | 各種電気通信サービス |
| BUNZL PLC | 278.38 | 278.38 | 538 | 77,136 | 商社・流通業 |
| EASYJET PLC | 136.28 | 136.28 | 204 | 29,243 | 旅客航空輸送業 |
| AVIVA PLC | 3,504.51 | 3,146.91 | 1,293 | 185,166 | 保険 |
| CRODA INTERNATIONAL | 106.45 | 103.91 | 525 | 75,292 | 化学 |
| DIAGEO PLC | 2,129.15 | 1,828.12 | 5,629 | 806,172 | 飲料 |
| SCHRODERS PLC | 109.32 | 109.32 | 369 | 52,928 | 資本市場 |
| DCC PLC | 97.53 | 78.98 | 493 | 70,709 | コングロマリット |
| NATIONAL GRID PLC | 2,937.75 | 2,646.42 | 2,752 | 394,126 | 総合公益事業 |
| KINGFISHER PLC | 1,656.8 | 1,656.8 | 359 | 51,412 | 専門小売り |
| BAE SYSTEMS PLC | 2,689.2 | 2,486.72 | 1,599 | 229,042 | 航空宇宙・防衛 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 2,009.84 | 1,772.72 | 5,933 | 849,647 | タバコ |
| HALMA PLC | — | 279.01 | 613 | 87,819 | 電子装置・機器・部品 |
| NEXT PLC | 120.64 | 100.18 | 714 | 102,256 | 複合小売り |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 843.12 | 716.56 | 1,307 | 187,265 | タバコ |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 150.17 | 150.17 | 397 | 56,900 | 化学 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| ANGLO AMERICAN PLC | 967.27 | 789.81 | 1,653 | 236,776 | 金属・鉱業 |
| COMPASS GROUP PLC | 1,394.09 | 1,195.6 | 2,320 | 332,318 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HSBC HOLDINGS PLC | 17,450.53 | 15,612.12 | 9,125 | 1,306,740 | 銀行 |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 5,084.63 | 4,527.58 | 1,441 | 206,434 | 保険 |
| CENTRICA PLC | 4,713.4 | 4,713.4 | 335 | 48,057 | 総合公益事業 |
| UNILEVER PLC | 1,003.06 | 855.86 | 3,941 | 564,446 | パーソナル用品 |
| MEGGITT PLC | 621.81 | 621.81 | 401 | 57,521 | 航空宇宙・防衛 |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS | 2,305.51 | 1,686.76 | 306 | 43,888 | 食品・生活必需品小売り |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 544.87 | 544.87 | 551 | 78,961 | 水道 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC GRP | 808.64 | 808.64 | 464 | 66,537 | 保険 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 302.4 | 255.47 | 681 | 97,640 | 食品 |
| PEARSON PLC | 650.09 | 650.09 | 370 | 53,081 | メディア |
| PERSIMMON PLC | 260.85 | 260.85 | 842 | 120,652 | 家庭用耐久財 |
| PRUDENTIAL PLC | 2,219.79 | 2,049.4 | 3,025 | 433,314 | 保険 |
| RIO TINTO PLC | 996.24 | 874.36 | 3,669 | 525,499 | 金属・鉱業 |
| VODAFONE GROUP PLC | 23,320.41 | 20,437.18 | 3,065 | 438,990 | 無線通信サービス |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 582.78 | 544.64 | 3,451 | 494,316 | 家庭用品 |
| RELX PLC | 1,736.66 | 1,475.23 | 3,058 | 437,927 | 専門サービス |
| RENTOKIL INITIAL PLC | - | 1,406.17 | 691 | 99,010 | 商業サービス・用品 |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC | 1,389.93 | 1,392.68 | 943 | 135,055 | 航空宇宙・防衛 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 4,494.43 | 3,974.34 | 846 | 121,280 | 銀行 |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 611.91 | 376.85 | 447 | 64,110 | 資本市場 |
| SSE PLC | 844.79 | 746.84 | 1,239 | 177,425 | 電力 |
| BP PLC | 17,559.46 | 15,740.09 | 7,190 | 1,029,618 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SAGE GROUP PLC(THE) | 852.71 | 871.11 | 682 | 97,773 | ソフトウェア |
| SMITHS GROUP PLC | 317.2 | 317.2 | 551 | 78,945 | コングロメリット |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | - | 55.18 | 511 | 73,288 | 機械 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 2,583.66 | 2,183.29 | 1,386 | 198,593 | 銀行 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 61,338.35 | 53,939.91 | 3,052 | 437,189 | 銀行 |
| TAYLOR WIMPLEY PLC | 2,530.22 | 2,522.87 | 584 | 83,743 | 家庭用耐久財 |
| TESCO PLC | 8,771.57 | 7,573.16 | 1,937 | 277,409 | 食品・生活必需品小売り |
| 3I GROUP PLC | 886.62 | 766.43 | 893 | 127,971 | 資本市場 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 749.03 | 680.27 | 1,237 | 177,197 | ヘルスケア機器・用品 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 4,360.21 | 3,862.19 | 6,444 | 922,845 | 医薬品 |
| WEIR GROUP | 183.36 | 191.61 | 264 | 37,878 | 機械 |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 262.66 | 246.6 | 2,027 | 290,273 | 資本市場 |
| BABCOCK INT'L GROUP | 213.02 | - | - | - | 商業サービス・用品 |
| WPP PLC | 1,074.94 | 951.48 | 929 | 133,145 | メディア |
| FERGUSON PLC | 210.79 | - | - | - | 商社・流通業 |
| ASTRAZENECA PLC | 1,112.61 | 1,015.56 | 7,413 | 1,061,625 | 医薬品 |
| WHITBREAD PLC | 156.39 | 98.14 | 467 | 66,979 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CARNIVAL PLC | 164.92 | 133.5 | 413 | 59,186 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 1,202.9 | 1,767.3 | 324 | 46,515 | 複合小売り |
| JOHN WOOD GROUP PLC | 489.88 | - | - | - | エネルギー設備・サービス |
| INTERTEK GROUP PLC | 143.35 | 120.83 | 712 | 102,017 | 専門サービス |
| BURBERRY GROUP PLC | 387.27 | 316.86 | 633 | 90,680 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| INVESTEC PLC | 506.55 | - | - | - | 資本市場 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 151.25 | 124.6 | 595 | 85,270 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ITV PLC | 3,709.08 | 2,543.08 | 345 | 49,526 | メディア |
| SAINSBURY (J) PLC | 1,372.15 | 1,372.15 | 282 | 40,477 | 食品・生活必需品小売り |
| G4S PLC | 1,222.5 | 1,222.5 | 245 | 35,187 | 商業サービス・用品 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 158.93 | 158.93 | 369 | 52,936 | 保険 |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 107.26 | 82.33 | 438 | 62,768 | 家庭用耐久財 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 4,047.66 | 3,336.87 | 6,420 | 919,363 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 3,247.53 | 2,863.67 | 5,518 | 790,219 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TUI AG-DI | 450.43 | 298.24 | 267 | 38,326 | ホテル・レストラン・レジャー |
| AVEVA GROUP PLC | - | 57.04 | 301 | 43,168 | ソフトウェア |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|------------------|--------------------|--------------------|--------------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 2,147.15 | 2,011.44 | 654 | 93,785 | 資本市場 |
| EXPERIAN PLC | 803.95 | 698.42 | 1,971 | 282,338 | 専門サービス |
| MONDI PLC | 283.18 | 397.67 | 661 | 94,673 | 紙製品・林産品 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 212.9 | 209.27 | 353 | 50,630 | 資本市場 |
| FRESNILLO PLC NPR | 156.39 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| OCADO GROUP PLC | — | 310.11 | 361 | 51,801 | インターネット販売・通信販売 |
| INFORMA PLC | 1,024.75 | 1,024.75 | 797 | 114,196 | メディア |
| GLENCORE PLC | 9,828.06 | 8,664.21 | 2,026 | 290,203 | 金属・鉱業 |
| GVC HOLDINGS PLC | 496.18 | 496.18 | 415 | 59,442 | ホテル・レストラン・レジャー |
| EVRAZ PLC | — | 487.65 | 187 | 26,920 | 金属・鉱業 |
| NMC HEALTH PLC | 81.49 | 81.49 | 63 | 9,043 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | 1,126.94 | 1,126.94 | 392 | 56,159 | 保険 |
| COCA-COLA HBC AG | 194.47 | 152.08 | 431 | 61,849 | 飲料 |
| CONVATEC GROUP PLC | 1,184 | — | — | — | ヘルスケア機器・用品 |
| ROYAL MAIL PLC | 550.6 | — | — | — | 航空貨物・物流サービス |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC | 500.37 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| FERGUSON PLC | — | 171.28 | 1,294 | 185,328 | 商社・流通業 |
| M&G PLC | — | 2,049.4 | 510 | 73,075 | 各種金融サービス |
| JD SPORTS FASHION PLC | — | 320.86 | 278 | 39,854 | 専門小売り |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC | 323.42 | 261 | 209 | 29,974 | ソフトウェア |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 763.48 | 763.48 | 449 | 64,395 | インターネット・メディアおよびサービス |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 4,176.2 | 3,647.35 | 866 | 124,046 | 電気設備 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 260,125.86 92銘柄 | 232,616.39 93銘柄 | 138,461 — | 19,827,669 <5.4%> |
| (イスラエル) | 百株 | 百株 | 千イスラエル・シケル | 千円 | |
| BANK HAPOALIM BM | 784.28 | 797.54 | 2,280 | 72,965 | 銀行 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL BM | 1,280.49 | 1,063.99 | 2,597 | 83,110 | 銀行 |
| BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 1,882.3 | — | — | — | 各種電気通信サービス |
| ELBIT SYSTEMS LTD | 17.6 | 17.6 | 952 | 30,486 | 航空宇宙・防衛 |
| ISRAEL DISCOUNT BANK LTD | — | 1,021.34 | 1,581 | 50,593 | 銀行 |
| ISRAEL CHEMICALS LTD | 494.11 | 494.11 | 684 | 21,898 | 化学 |
| NICE LTD | 60.65 | 49.02 | 3,015 | 96,487 | ソフトウェア |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 104.44 | 104.44 | 994 | 31,816 | 銀行 |
| AZRIELI GROUP | 44.28 | 22.91 | 641 | 20,527 | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 4,668.15 8銘柄 | 3,570.95 8銘柄 | 12,746 — | 407,884 <0.1%> |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG | 2,180.4 | 1,914.83 | 2,576 | 288,067 | 資本市場 |
| NESTLE SA-REGISTERED | 2,679.67 | 2,303.64 | 24,777 | 2,770,422 | 食品 |
| CIE FINANCIER RICHEMONT | 465.47 | 409.15 | 3,047 | 340,724 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 613.98 | 544.32 | 18,539 | 2,072,905 | 医薬品 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 36.07 | 28.96 | 701 | 78,392 | 機械 |
| SIKA INHABER | 112.91 | 102.09 | 1,903 | 212,883 | 化学 |
| SGS SA-REG | 4.84 | 4.24 | 1,125 | 125,819 | 専門サービス |
| NOVARTIS AG-REG SHS | 1,875.05 | 1,662.22 | 15,894 | 1,777,124 | 医薬品 |
| BALOISE HOLDING AG -R | 41.27 | 32.52 | 590 | 66,030 | 保険 |
| BARRY CALLEBAUT AG | 1.44 | 2.65 | 581 | 65,066 | 食品 |
| CLARIANT AG-REG | 194.96 | 122.82 | 290 | 32,532 | 化学 |
| SWISSCOM AG-REG | 22.8 | 19.6 | 1,119 | 125,133 | 各種電気通信サービス |
| ABB LTD | 1,623.58 | 1,408.52 | 3,350 | 374,660 | 電気設備 |
| ADECCO GROUP AG-REG | 123.41 | 129.44 | 755 | 84,433 | 専門サービス |
| GEBERIT AG | 32.43 | 29.01 | 1,520 | 170,029 | 建設関連製品 |
| LONZA GROUP AG-REG | 62.28 | 57.93 | 2,415 | 270,032 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| LINDT & SPRUENGLI PART | 1.05 | 0.79 | 661 | 73,976 | 食品 |
| LINDT & SPRUENGLI NAMEN | 0.09 | 0.09 | 822 | 91,974 | 食品 |
| GIVAUDAN-REG | 7.71 | 7.42 | 2,470 | 276,266 | 化学 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 130.46 | 115.58 | 5,005 | 559,695 | 保険 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|------------------|--------------|------------|-------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | |
| LAFARGEHOLCIM LTD | 406.15 | 379.97 | 1,888 | 211,147 | 建設資材 |
| TEMENOS GROUP | 45.21 | 47.3 | 792 | 88,610 | ソフトウェア |
| SONOVA HOLDING AG | 53.19 | 45.84 | 1,172 | 131,055 | ヘルスケア機器・用品 |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG | 51.05 | 40.18 | 638 | 71,363 | 海運業 |
| STRAUMANN HOLDING AG | 7.82 | 7.94 | 766 | 85,723 | ヘルスケア機器・用品 |
| THE SWATCH GROUP AG-B | 26.91 | 21.34 | 539 | 60,366 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | 45.92 | 45.92 | 221 | 24,819 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SCHINDLER NAMEN | 16.63 | 16.63 | 390 | 43,621 | 機械 |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 31.19 | 24.58 | 1,270 | 142,086 | 保険 |
| VIFOR PHARMA AG | 45.83 | 34.65 | 652 | 73,009 | 医薬品 |
| EMS-CHEMIE HOLDING | 9.04 | 6.33 | 407 | 45,614 | 化学 |
| SWISS PRIME SITE AG | 59.9 | 59.9 | 739 | 82,646 | 不動産管理・開発 |
| PARGESA HOLDING PORTEUR | 30 | 30 | 242 | 27,085 | 各種金融サービス |
| DUFREY GROUP | 23.9 | 31.38 | 268 | 30,033 | 専門小売り |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 15.05 | 15.05 | 1,419 | 158,716 | 資本市場 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 178.49 | 178.49 | 897 | 100,303 | 資本市場 |
| SWISS RE LTD | 276.09 | 225.97 | 2,607 | 291,566 | 保険 |
| ALCON INC | - | 320.32 | 1,969 | 220,154 | ヘルスケア機器・用品 |
| UBS GROUP AG | 3,364.64 | 3,016.86 | 3,911 | 437,329 | 資本市場 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 108,947 | 12,181,428 | |
| (デンマーク) | 百株 | 百株 | 千デンマーク・クローネ | 千円 | |
| CARLSBERG AS-B | 96.44 | 84.41 | 8,656 | 137,807 | 飲料 |
| A P MOLLER A/S | 6.04 | 4.91 | 4,212 | 67,067 | 海運業 |
| AP MOLLER MAERSK A | 2.73 | 2.73 | 2,200 | 35,030 | 海運業 |
| DANSKE BANK A/S | 611.14 | 510.34 | 6,203 | 98,754 | 銀行 |
| GENMAB A/S | 56.22 | 50.14 | 8,187 | 130,350 | バイオテクノロジー |
| NOVOZYMES-B SHS | 191.11 | 155.33 | 5,874 | 93,523 | 化学 |
| NOVO NORDISK A/S-B | 1,596.6 | 1,369.25 | 59,706 | 950,521 | 医薬品 |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 158.08 | 139.63 | 9,723 | 154,803 | 電気設備 |
| COLOPLAST-B | 112.12 | 97.29 | 9,230 | 146,955 | ヘルスケア機器・用品 |
| DSV PANALPINA A S | 171.23 | 176.26 | 13,713 | 218,311 | 航空貨物・物流サービス |
| DEMANT A/S | 65.37 | 72.44 | 1,682 | 26,778 | ヘルスケア機器・用品 |
| H LUNDBECK A/S | 48.4 | 48.4 | 1,260 | 20,072 | 医薬品 |
| TRYG A/S | 111.07 | 111.07 | 2,303 | 36,673 | 保険 |
| PANDORA A/S | 82.51 | 82.51 | 2,813 | 44,792 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 77.08 | 75.39 | 4,108 | 65,411 | 化学 |
| ISS A/S | 162.4 | 111.07 | 1,882 | 29,971 | 商業サービス・用品 |
| ORSTED A/S | 172.49 | 150.9 | 11,211 | 178,492 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 152,972 | 2,435,317 | |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| MOWI ASA | 330 | 351.83 | 7,895 | 93,714 | 食品 |
| DNB ASA | 797.83 | 713.52 | 12,504 | 148,427 | 銀行 |
| NORSK HYDRO ASA | 1,371.9 | 931.39 | 2,748 | 32,625 | 金属・鉱業 |
| TELENOR ASA | 620.76 | 547.66 | 8,883 | 105,441 | 各種電気通信サービス |
| ORKLA ASA | 848.09 | 649.38 | 5,747 | 68,217 | 食品 |
| EQUINOR ASA | 983.97 | 810.22 | 13,028 | 154,646 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 160 | 121.71 | 4,607 | 54,696 | 化学 |
| AKER BP ASA | 85.52 | 85.52 | 2,197 | 26,078 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 166.83 | 166.83 | 3,461 | 41,090 | 保険 |
| SCHIBSTED ASA | 74.45 | 74.45 | 1,935 | 22,976 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 63,008 | 747,914 | |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 571.91 | 522.84 | 19,679 | 222,577 | 機械 |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 383.14 | 287.68 | 9,525 | 107,728 | 機械 |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|-----------|-------------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 額 | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (ユーロ…オランダ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| VOPAK (KON.) | 53.64 | 53.64 | 272 | 32,428 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 2,910.29 | 2,910.29 | 727 | 86,586 | 各種電気通信サービス |
| HEINEKEN HOLDING NV-A | 97.91 | 97.91 | 907 | 107,971 | 飲料 |
| UNILEVER NV | — | 1,131.34 | 6,205 | 738,194 | パーソナル用品 |
| FERRARI NV | 108.95 | 89.34 | 1,427 | 169,780 | 自動車 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 943.17 | 779.51 | 683 | 81,306 | 機械 |
| PROSUS NV | — | 368.71 | 2,651 | 315,365 | インターネット販売・通信販売 |
| NN GROUP NV | 285.28 | 217.2 | 784 | 93,301 | 保険 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 899.77 | 790.84 | 969 | 115,358 | 自動車 |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV | — | 90 | 846 | 100,693 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ABN AMRO BANK NV | 342.51 | 342.51 | 520 | 61,871 | 銀行 |
| EXOR NV | 77.26 | 79.71 | 595 | 70,870 | 各種金融サービス |
| ALTICE EUROPE NV | — | 567.63 | 370 | 44,107 | メディア |
| ADYEN NV | — | 8.18 | 722 | 85,982 | 情報技術サービス |
| 小 計 | 株 数 : 16,459.79 銘柄 数 < 比率 > : 23銘柄 | 株 数 : 16,007.99 銘柄 数 : 27銘柄 | 51,646 | 6,143,817 | <1.7%> |
| (ユーロ…ベルギー) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| UMICORE | 191.09 | 141.15 | 635 | 75,543 | 化学 |
| KBC GROUPE | 208.03 | 185.77 | 1,346 | 160,130 | 銀行 |
| SOLVAY SA | 70.86 | 55.63 | 542 | 64,536 | 化学 |
| AGEAS | 179.04 | 143.65 | 756 | 89,954 | 保険 |
| UCB SA | 112.67 | 90.95 | 816 | 97,093 | 医薬品 |
| COLRUYT NV | 46.73 | 46.73 | 216 | 25,793 | 食品・生活必需品小売り |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 84.48 | 66.89 | 627 | 74,638 | 各種金融サービス |
| PROXIMUS | 142.83 | 142.83 | 376 | 44,805 | 各種電気通信サービス |
| GALAPAGOS NV | — | 34.26 | 820 | 97,650 | バイオテクノロジー |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 36.34 | 36.34 | 150 | 17,845 | メディア |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 658.58 | 587.31 | 3,979 | 473,344 | 飲料 |
| 小 計 | 株 数 : 1,730.65 銘柄 数 < 比率 > : 10銘柄 | 株 数 : 1,531.51 銘柄 数 : 11銘柄 | 10,266 | 1,221,337 | <0.3%> |
| (ユーロ…ルクセンブルグ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ARCELOR MITTAL (NL) | 581.89 | 467.14 | 748 | 89,046 | 金属・鉱業 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 7.94 | 8.99 | 423 | 50,371 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| TENARIS SA | 369.59 | 369.59 | 355 | 42,339 | エネルギー設備・サービス |
| SES FDR | 342.68 | 288.47 | 318 | 37,919 | メディア |
| RTL GROUP SA | 34.46 | — | — | — | メディア |
| AROUNDTOWN SA | 717.83 | 717.83 | 630 | 74,975 | 不動産管理・開発 |
| 小 計 | 株 数 : 2,054.39 銘柄 数 < 比率 > : 6銘柄 | 株 数 : 1,852.02 銘柄 数 : 5銘柄 | 2,476 | 294,652 | <0.1%> |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| AIR LIQUIDE | 370.92 | 363.17 | 5,040 | 599,653 | 化学 |
| AXA | 1,652.52 | 1,481.6 | 3,772 | 448,735 | 保険 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 496.32 | 444.49 | 1,246 | 148,318 | 総合公益事業 |
| DASSAULT AVIATION SA | 2.74 | 1.63 | 177 | 21,174 | 航空宇宙・防衛 |
| DANONE | 540.23 | 488.33 | 3,541 | 421,281 | 食品 |
| SAFRAN SA | 292.68 | 258.98 | 3,755 | 446,719 | 航空宇宙・防衛 |
| ACCOR SA | 160 | 122.77 | 472 | 56,242 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BOUYGUES | 222.76 | 175.72 | 678 | 80,729 | 建設・土木 |
| BNP PARIBAS | 969.88 | 864.34 | 4,639 | 551,947 | 銀行 |
| THALES SA | 98.83 | 85.49 | 820 | 97,630 | 航空宇宙・防衛 |
| CAPGEMINI SA | 137.59 | 125.15 | 1,438 | 171,135 | 情報技術サービス |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 42.64 | 42.64 | 157 | 18,676 | 食品・生活必需品小売り |
| INGENICO GROUP | 43.34 | 43.34 | 593 | 70,633 | 電子装置・機器・部品 |
| NATIXIS | 701.66 | 701.66 | 305 | 36,317 | 資本市場 |
| EIFFAGE | 59.49 | 64.61 | 713 | 84,930 | 建設・土木 |
| PUBLICIS GROUPE | 182.22 | 151.98 | 621 | 73,981 | メディア |
| FAURECIA | 61.17 | 61.17 | 263 | 31,304 | 自動車部品 |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-----------------------------------|----------|----------|-------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 303.04 | 252.51 | 1,663 | 197,834 | 自動車 |
| COMMERZBANK AG | 831.18 | 831.18 | 549 | 65,357 | 銀行 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 346.4 | 314.63 | 1,529 | 181,901 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNITED INTERNET | 98.82 | 98.82 | 305 | 36,289 | 各種電気通信サービス |
| FUCHS PETROLUB SE PREF | 55.46 | 55.46 | 233 | 27,735 | 化学 |
| HANNOVER RUECK SE | 48.68 | 48.68 | 934 | 111,186 | 保険 |
| GEA GROUP AG | 118.38 | 118.38 | 328 | 39,121 | 機械 |
| CONTINENTAL AG | 95.28 | 83.12 | 920 | 109,558 | 自動車部品 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 866.63 | 760.32 | 2,528 | 300,783 | 航空貨物・物流サービス |
| AXEL SPRINGER SE | 77.92 | - | - | - | メディア |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD | 132.49 | 126.49 | 822 | 97,807 | 自動車 |
| MERCK KGAA | 111.93 | 98.5 | 1,205 | 143,364 | 医薬品 |
| RWE AG | 459.05 | 464.89 | 1,550 | 184,436 | 総合公益事業 |
| SAP SE | 864.71 | 760.71 | 9,671 | 1,150,541 | ソフトウェア |
| E.ON SE | 1,974.27 | 1,813.17 | 2,013 | 239,507 | 総合公益事業 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 93 | 75.85 | 629 | 74,936 | 家庭用品 |
| SIEMENS AG-REG | 671.82 | 591.13 | 6,304 | 750,041 | コンプロマリット |
| PUMA AG | 6 | 73.51 | 528 | 62,918 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BAYER AG | 817.67 | 720.11 | 5,571 | 662,784 | 医薬品 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 153.5 | 137.59 | 1,283 | 152,710 | 家庭用品 |
| DAIMLER AG | 807.58 | 694.81 | 2,992 | 355,952 | 自動車 |
| BASF SE | 798.36 | 705.54 | 4,410 | 524,652 | 化学 |
| BEIERSDORF AG | 83.71 | 83.71 | 885 | 105,357 | パーソナル用品 |
| HOCHTIEF AG | 17.07 | 17.07 | 192 | 22,905 | 建設・土木 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 141.26 | 120.31 | 764 | 90,967 | 建設資材 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 184.94 | 162.14 | 1,207 | 143,658 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE | 374.94 | 329.44 | 7,618 | 906,272 | 保険 |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | 176.02 | - | - | - | メディア |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 249.26 | 160.96 | 244 | 29,123 | 旅客航空輸送業 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 129.66 | 110.91 | 3,130 | 372,462 | 保険 |
| VOLKSWAGEN AG | 35.45 | 26.45 | 453 | 53,899 | 自動車 |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 153.82 | 144.01 | 2,454 | 292,022 | 自動車 |
| THYSSENKRUPP AG | 378.94 | 271.1 | 303 | 36,087 | 金属・鉱業 |
| 1&1 DRILLISCH AG | 31.49 | - | - | - | 無線通信サービス |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 1,719.85 | 1,493.84 | 1,521 | 181,012 | 資本市場 |
| BMW VORZUG | 41.16 | 41.16 | 215 | 25,583 | 自動車 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 2,887.79 | 2,635.92 | 4,119 | 490,108 | 各種電気通信サービス |
| SARTORIUS AG | 27.12 | 27.12 | 627 | 74,589 | ヘルスケア機器・用品 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 990.68 | 990.68 | 2,235 | 265,990 | 半導体・半導体製造装置 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG | - | 37.71 | 410 | 48,852 | ヘルスケア機器・用品 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 169.13 | 145.25 | 2,235 | 265,922 | 資本市場 |
| FRAPORT AG | 31.49 | 31.49 | 217 | 25,930 | 運送インフラ |
| WIRECARD AG | 98.91 | 89.63 | 1,244 | 148,100 | 情報技術サービス |
| LANXESS AG | 68.56 | 68.56 | 392 | 46,700 | 化学 |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG | 48.59 | 41.68 | 1,172 | 139,525 | 航空宇宙・防衛 |
| DEUTSCHE WOHNEN | 306.89 | 269.47 | 1,048 | 124,698 | 不動産管理・開発 |
| SYMRISE AG | 115.48 | 99.88 | 987 | 117,462 | 化学 |
| BRENTAG AG | 123.53 | 123.53 | 614 | 73,108 | 商社・流通業 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 227.84 | 171.16 | 463 | 55,138 | 化学 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 615.41 | 615.41 | 158 | 18,909 | 各種電気通信サービス |
| HUGO BOSS AG -ORD | 52.18 | - | - | - | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OSRAM LICHT AG | 70.17 | - | - | - | 電気設備 |
| KION GROUP AG | 46.86 | 45.67 | 271 | 32,347 | 機械 |
| VONOVIA SE | 407.75 | 386.17 | 2,053 | 244,302 | 不動産管理・開発 |
| KNORR-BREMSE AG | - | 44.92 | 443 | 52,816 | 機械 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 152.54 | 114.68 | 459 | 54,644 | ヘルスケア機器・用品 |
| METRO AG | 107.74 | 107.74 | 135 | 16,117 | 食品・生活必需品小売り |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 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…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| INNOGY SE-TEMPORARY | 97.69 | — | — | — | 総合公益事業 |
| ZALANDO SE | 143.53 | 99.64 | 472 | 56,267 | インターネット販売・通信販売 |
| COVESTRO AG | 158.02 | 127.08 | 496 | 59,109 | 化学 |
| UNIPER SE | 138.97 | 142.52 | 420 | 50,048 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| DELIVERY HERO SE | 72.38 | 80.81 | 640 | 76,193 | インターネット販売・通信販売 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | |
| | 20,772.55 61銘柄 | 18,422.22 57銘柄 | 90,303 — | 10,742,544 <2.9%> | |
| (ユーロ…ポルトガル) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| JERONIMO MARTINS | 195.17 | 195.17 | 329 | 39,156 | 食品・生活必需品小売り |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 2,420.94 | 2,016.06 | 950 | 113,032 | 電力 |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 522.32 | 400.88 | 560 | 66,621 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | |
| | 3,138.43 3銘柄 | 2,612.11 3銘柄 | 1,839 — | 218,809 <0.1%> | |
| (ユーロ…スペイン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| IBERDROLA SA | 5,323.01 | 4,772.67 | 5,180 | 616,300 | 電力 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 144.26 | 158.85 | 247 | 29,393 | 電気設備 |
| REPSOL SA | 1,267.23 | 1,149.98 | 1,454 | 173,054 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TELEFONICA S.A | 4,153.79 | 3,677.55 | 2,297 | 273,294 | 各種電気通信サービス |
| ENDESA S.A. | 293.14 | 234.17 | 587 | 69,920 | 電力 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 232.16 | 201.37 | 629 | 74,883 | 建設・土木 |
| BANKINTER S.A. | 579.6 | 579.6 | 363 | 43,189 | 銀行 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 5,956.67 | 5,235.94 | 2,745 | 326,569 | 銀行 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 290.1 | 236.12 | 564 | 67,188 | ガス |
| BANCO SANTANDER SA | 14,112.32 | 12,640.63 | 4,958 | 589,913 | 銀行 |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 345.96 | 345.96 | 658 | 78,277 | 電力 |
| BANCO SABADELL | 5,633.71 | 4,136.31 | 352 | 41,923 | 銀行 |
| INDITEX | 967.34 | 838.83 | 2,636 | 313,631 | 専門小売り |
| MAPFRE SA | 844.74 | 844.74 | 204 | 24,308 | 保険 |
| ENAGAS | 180.95 | 180.95 | 463 | 55,170 | ガス |
| GRIFOLS SA | 235.18 | 235.18 | 776 | 92,352 | バイオテクノロジー |
| FERROVIAL SA | 468.31 | 386.66 | 1,154 | 137,393 | 建設・土木 |
| CAIXABANK | 2,972.24 | 2,972.24 | 834 | 99,249 | 銀行 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 384.92 | 338.91 | 2,468 | 293,667 | 情報技術サービス |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA | 447.47 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| BANKIA SA | 1,006.75 | 1,006.75 | 169 | 20,180 | 銀行 |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION-RTS | 231.8 | — | — | — | 建設・土木 |
| AENA SME SA | 61.75 | 53.38 | 898 | 106,903 | 運送インフラ |
| CELLNEX TELECOM SAU | — | 197.8 | 937 | 111,557 | 各種電気通信サービス |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | |
| | 46,133.4 23銘柄 | 40,424.59 22銘柄 | 30,584 — | 3,638,321 <1.0%> | |
| (ユーロ…イタリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 1,040.14 | 870.3 | 1,629 | 193,809 | 保険 |
| INTESA SANPAOLO | 13,499.21 | 11,576.31 | 2,902 | 345,243 | 銀行 |
| UNICREDIT SPA | 1,701.44 | 1,557.18 | 2,162 | 257,227 | 銀行 |
| ENI SPA | 2,222.05 | 1,978.38 | 2,550 | 303,410 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MEDIOBANCA SPA | 620.22 | 416.39 | 399 | 47,582 | 銀行 |
| ENEL SPA | 6,744.93 | 6,323.33 | 5,233 | 622,615 | 電力 |
| LEONARDO SPA | 262.69 | 283.16 | 324 | 38,653 | 航空宇宙・防衛 |
| SNAM SPA | 1,997.02 | 1,691.63 | 844 | 100,517 | ガス |
| TELECOM ITALIA SPA | 11,584.73 | 7,626.75 | 394 | 46,906 | 各種電気通信サービス |
| TELECOM ITALIA-RNC | 4,975.96 | 4,975.96 | 254 | 30,248 | 各種電気通信サービス |
| ATLANTIA SPA | 436.88 | 373.65 | 853 | 101,477 | 運送インフラ |
| TERNA SPA | 1,126.86 | 1,136.54 | 738 | 87,800 | 電力 |
| RECORDATI SPA | 68.59 | 68.59 | 276 | 32,923 | 医薬品 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | 557.25 | 397.52 | 356 | 42,370 | 飲料 |
| PRYSMIAN SPA | 294.18 | 214.52 | 509 | 60,659 | 電気設備 |
| MONCLER SPA | 143.53 | 143.53 | 546 | 65,053 | 繊維・アパレル・贅沢品 |

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

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

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

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|---------------------------------|---------|---------|----------|---------|-----|--|
| | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | |
| 不動産ファンド (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % | |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 9.644 | 8.646 | 1,512 | 166,066 | 0.0 | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 13.309 | 12.027 | 1,770 | 194,426 | 0.1 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | - | 17.771 | 787 | 86,479 | 0.0 | |
| SL GREEN | 7.097 | 7.097 | 674 | 74,059 | 0.0 | |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 125.554 | 108.247 | 1,127 | 123,847 | 0.0 | |
| PROLOGIS INC | 55.164 | 56.079 | 5,470 | 600,661 | 0.2 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 12.353 | 10.491 | 2,387 | 262,094 | 0.1 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 8.062 | 8.062 | 958 | 105,242 | 0.0 | |
| EQUINIX INC | 6.964 | 6.522 | 4,230 | 464,508 | 0.1 | |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 13.649 | 13.649 | 778 | 85,483 | 0.0 | |
| DUKE REALTY TRUST | 32.954 | 27.278 | 1,049 | 115,252 | 0.0 | |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 35.534 | 31.583 | 5,241 | 575,552 | 0.2 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 5.653 | 5.075 | 1,645 | 180,638 | 0.0 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 32.976 | 27.869 | 2,409 | 264,569 | 0.1 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 6 | 6 | 763 | 83,819 | 0.0 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | | |
|----------------------------------|---------------|---------------|------------------|------------------|--------|-----------|----------|
| | □数 | □数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 | |
| (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | | % | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 39,277 | 40,162 | 1,498 | 164,529 | | 0.0 | |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 10,277 | 8,778 | 2,586 | 283,952 | | 0.1 | |
| WELLTOWER INC | 33,309 | 32,099 | 2,867 | 314,805 | | 0.1 | |
| KIMCO REALTY | 32.98 | 32.98 | 635 | 69,744 | | 0.0 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 11,649 | — | — | — | | — | |
| IRON MOUNTAIN INC | 23,977 | 23,977 | 794 | 87,246 | | 0.0 | |
| THE MACERICH COMPANY | 9,014 | — | — | — | | — | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | — | 13,626 | 1,025 | 112,569 | | 0.0 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 64,001 | 55,116 | 932 | 102,334 | | 0.0 | |
| MID AMERICA | 10,258 | 8,834 | 1,285 | 141,140 | | 0.0 | |
| REALTY INCOME CORP | 26,616 | 23,491 | 1,885 | 206,989 | | 0.1 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 13,023 | 11,403 | 730 | 80,156 | | 0.0 | |
| UDR INC | 21,658 | 22,345 | 1,124 | 123,459 | | 0.0 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 26.5 | 23,306 | 3,237 | 355,496 | | 0.1 | |
| PUBLIC STORAGE | 13,721 | 12,188 | 2,837 | 311,569 | | 0.1 | |
| SUN COMMUNITIES INC | — | 7,418 | 1,246 | 136,827 | | 0.0 | |
| VENTAS INC | 30,244 | 29,505 | 1,762 | 193,569 | | 0.1 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 15,346 | 12,472 | 846 | 92,970 | | 0.0 | |
| WEYERHAEUSER CO | 63,699 | 57,621 | 1,766 | 193,979 | | 0.1 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 11,885 | 9,261 | 1,068 | 117,375 | | 0.0 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 18,388 | 15,605 | 2,052 | 225,315 | | 0.1 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | — | 39,953 | 962 | 105,635 | | 0.0 | |
| AGNC INVESTMENT CORP | 44,741 | 44,741 | 865 | 95,008 | | 0.0 | |
| VEREIT INC | 93,429 | 82,604 | 828 | 90,971 | | 0.0 | |
| AMERICAN TOWER CORP | 38,497 | 34,213 | 8,767 | 962,625 | | 0.3 | |
| WP CAREY INC | 15,148 | 13,039 | 1,119 | 122,881 | | 0.0 | |
| INVITATION HOMES INC | 30,427 | 42,384 | 1,379 | 151,479 | | 0.0 | |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 19,124 | — | — | — | | — | |
| VICI PROPERTIES INC | — | 34.2 | 961 | 105,557 | | 0.0 | |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | □数 銘柄数<比率> | 金額 39銘柄<2.1%> | 金額 41銘柄<2.2%> | 75,873 | 8,330,894 | — 2.2 |
| (カナダ) | 千□ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千円 | | % | |
| SMARTCENTRES REIT | 9,288 | 3,067 | 96 | 7,989 | | 0.0 | |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | — | 7,819 | 459 | 38,082 | | 0.0 | |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 10,748 | 10,748 | 230 | 19,129 | | 0.0 | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST | — | 17,676 | 385 | 31,972 | | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 9,675 | 13,467 | 372 | 30,876 | | 0.0 | |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | □数 銘柄数<比率> | 金額 3銘柄<0.0%> | 金額 5銘柄<0.0%> | 1,545 | 128,051 | — 0.0 |
| (オーストラリア) | 千□ | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | % | |
| MIRVAC GROUP | 295,783 | 329,418 | 1,083 | 79,907 | | 0.0 | |
| GPT GROUP | 144,955 | 158,232 | 987 | 72,798 | | 0.0 | |
| LENDLEASE GROUP | 60,871 | — | — | — | | — | |
| STOCKLAND | 194,018 | 194,018 | 975 | 71,953 | | 0.0 | |
| DEXUS | 80,596 | 84,575 | 1,114 | 82,186 | | 0.0 | |
| GOODMAN GROUP | 147,572 | 132,051 | 2,170 | 160,061 | | 0.0 | |
| VICINITY CENTRES | 270,443 | 270,443 | 673 | 49,650 | | 0.0 | |
| SCENTRE GROUP | 476,956 | 420,268 | 1,584 | 116,818 | | 0.0 | |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | □数 銘柄数<比率> | 金額 8銘柄<0.2%> | 金額 7銘柄<0.2%> | 8,590 | 633,377 | — 0.2 |
| (香港) | 千□ | 千□ | 千香港・ドル | 千円 | | % | |
| LINK REIT | 185.5 | 157.9 | 12,426 | 175,589 | | 0.0 | |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | □数 銘柄数<比率> | 金額 1銘柄<0.1%> | 金額 1銘柄<0.0%> | 12,426 | 175,589 | — 0.0 |
| (シンガポール) | 千□ | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千円 | | % | |
| CAPITALAND MALL TRUST | 199 | 199 | 501 | 39,576 | | 0.0 | |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVNT | 200,806 | 200,806 | 662 | 52,297 | | 0.0 | |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 206.3 | 206.3 | 429 | 33,864 | | 0.0 | |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 192.1 | 192.1 | 345 | 27,288 | | 0.0 | |

| 銘 | 柄 | 期 | | | | 末 |
|-----------------------------|-------------------|-------------------------|-------------------------|------------|------------|-----|
| | | 首(前期末) | 当 | 期 | 末 | |
| | | □ 数 | □ 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (シンガポール) | | 千口 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST | | — | 192.3 | 449 | 35,512 | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | 798.206 4銘柄<0.0%> | 990.506 5銘柄<0.1%> | 2,389 | 188,540 | — |
| (イギリス) | | 千口 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| BRITISH LAND CO PLC | | 71.871 | 69.819 | 410 | 58,768 | 0.0 |
| HAMMERSON PLC | | 58.616 | — | — | — | — |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 59.062 | 55.843 | 556 | 79,631 | 0.0 |
| SEGRO PLC | | 82.914 | 87.247 | 815 | 116,816 | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | 272.463 4銘柄<0.1%> | 212.909 3銘柄<0.1%> | 1,782 | 255,216 | — |
| (オランダ) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | | 12.061 | 10.898 | 1,383 | 164,581 | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | 12.061 1銘柄<0.1%> | 10.898 1銘柄<0.0%> | 1,383 | 164,581 | — |
| (フランス) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| GECINA SA | | 3.67 | 3.67 | 666 | 79,239 | 0.0 |
| ICADE | | 2.234 | 2.234 | 234 | 27,877 | 0.0 |
| KLEPIERRE | | 17.042 | 17.042 | 532 | 63,313 | 0.0 |
| COVIVIO | | 4.675 | 4.265 | 472 | 56,266 | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | 27.621 4銘柄<0.1%> | 27.211 4銘柄<0.1%> | 1,905 | 226,697 | — |
| 合計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | 4,078.857 64銘柄<2.6%> | 4,118.923 67銘柄<2.7%> | — | 10,102,948 | — |
| | | | | | | 2.7 |

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

■投資信託財産の構成

2020年2月17日現在

| 項 | 目 | 当 | | 末 |
|---------------|---|-------------|-------|---|
| | | 評 価 額 | 比 率 | |
| 株 | 式 | 千円 | % | |
| | | 350,796,430 | 94.6 | |
| 投資信託受益証券、投資証券 | | 10,102,948 | 2.7 | |
| コール・ローン等、その他 | | 9,740,489 | 2.6 | |
| 投資信託財産総額 | | 370,639,867 | 100.0 | |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、370,367,645千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年2月17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.80円、1カナダ・ドル=82.86円、1オーストラリア・ドル=73.73円、1香港・ドル=14.13円、1シンガポール・ドル=78.92円、1ニュージーランド・ドル=70.61円、1イギリス・ポンド=143.20円、1イスラエル・シェケル=32.00円、1スイス・フラン=111.81円、1デンマーク・クローネ=15.92円、1ノルウェー・クローネ=11.87円、1スウェーデン・クローナ=11.31円、1ユーロ=118.96円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月17日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|----------------------------|
| (A) 資 産 | 371,336,825,866円 |
| 株 式 | 6,549,317,097 |
| 債 券 | 350,796,430,193 |
| 信 託 受 益 証 券 | 821,917,447 |
| 資 信 託 受 益 証 券 | 9,281,030,671 |
| 未 収 入 金 | 981,917,778 |
| 未 収 入 委 託 証 拠 | 425,800,789 |
| (B) 負 債 | 2,480,411,891 |
| 未 払 金 | 916,378,668 |
| 未 払 金 | 704,679,668 |
| 未 払 金 | 211,699,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 370,420,447,198 |
| 元 本 | 88,590,932,378 |
| 次 期 繰 越 損 益 | 281,829,514,820 |
| (D) 受 取 万 益 当 たり 基 準 価 額(C/D) | 88,590,932,378円 41,812円 |

(注1) 期首元本額 101,602,311,525円
追加設定元本額 23,968,777,744円
一部解約元本額 36,980,156,891円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|----------------------------------|-----------------|
| D I A M 外国株式パッシブ・ファンド | 3,405,331,645円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 2,265,172円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 6,568,890円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 9,804,082円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 31,959,861円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 25,017,559円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 13,341,477円 |
| たわらノーロード 先進国株式 | 12,358,698,257円 |
| たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け> | 181,844,047円 |
| たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり> | 1,666,506,602円 |
| たわらノーロード パランス (8資産均等型) | 215,144,281円 |
| たわらノーロード パランス (堅実型) | 21,417,034円 |
| たわらノーロード パランス (標準型) | 170,820,437円 |
| たわらノーロード パランス (積極型) | 210,567,034円 |
| たわらノーロード スマートグローバルパランス (保守型) | 679,207円 |
| たわらノーロード スマートグローバルパランス (安定型) | 87,148,596円 |
| たわらノーロード スマートグローバルパランス (安定成長型) | 220,238,898円 |
| たわらノーロード スマートグローバルパランス (成長型) | 147,447,694円 |
| たわらノーロード スマートグローバルパランス (積極型) | 270,535,285円 |
| たわらノーロード 最適化パランス (保守型) | 64,582円 |
| たわらノーロード 最適化パランス (安定型) | 1,015,608円 |
| たわらノーロード 最適化パランス (安定成長型) | 2,220,065円 |
| たわらノーロード 最適化パランス (成長型) | 1,516,202円 |
| たわらノーロード 最適化パランス (積極型) | 4,637,207円 |
| たわらノーロード 全世界株式 | 43,988,328円 |
| D I A M 外国株式インデックスファンド<DC年金> | 42,514,197,886円 |
| One D C 先進国株式インデックスファンド | 189,412,832円 |
| D I A M パランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 | 176,623,075円 |
| D I A M パランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 | 878,800,098円 |
| D I A M パランス・ファンド<DC年金> 3 成長型 | 1,066,933,587円 |
| D I A M DC パランス30インデックスファンド | 117,048,457円 |
| D I A M DC パランス50インデックスファンド | 341,782,574円 |
| D I A M DC パランス70インデックスファンド | 300,493,482円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 27,606,178円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 792,953,460円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリレーション | 186,919,230円 |
| D I A M DC 8資産パランスファンド (新興国10) | 206,435,395円 |
| D I A M DC 8資産パランスファンド (新興国20) | 158,994,799円 |
| D I A M DC 8資産パランスファンド (新興国30) | 277,906,766円 |
| 投資のソムリエ | 1,161,944,551円 |
| クルーズコントロール | 194,095,583円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 110,373,729円 |
| D I A M 8資産パランスファンドN<DC年金> | 175,641,805円 |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 100,302,518円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 196,533円 |
| D I A M コア資産設計ファンド (堅実型) | 553,382円 |
| D I A M コア資産設計ファンド (積極型) | 2,320,962円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 63,170,120円 |

| | |
|---|-----------------|
| リスク抑制世界8資産パランスファンド | 668,936,157円 |
| ワールドアセットパランス (基本コース) | 439,823,625円 |
| ワールドアセットパランス (リスク抑制コース) | 1,662,660,975円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 1,709,520円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 1,370,366円 |
| リスク抑制世界8資産パランスファンド (D C) | 565,992円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 1,592,751円 |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 11,750,393円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 563,321,995円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 144,219,671円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) | 261,455円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) | 222,668円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) | 257,387円 |
| 4資産分散投資・マイルクラス<DC年金> | 65,132円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 25,533,156円 |
| M S C コクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定) | 259,123,350円 |
| D I A M 外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用) | 85,286,421円 |
| D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 2,001,550,769円 |
| D I A M 先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定) | 9,249,815,085円 |
| 外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定) | 205,960,997円 |
| D I A M ワールドパランス25V A (適格機関投資家限定) | 14,470,386円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 17,813,512円 |
| D I A M グローバル・パランスファンド25V A (適格機関投資家限定) | 59,958,854円 |
| D I A M グローバル・パランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 135,238,394円 |
| D I A M 国際分散パランスファンド30V A (適格機関投資家限定) | 8,631,553円 |
| D I A M 国際分散パランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 48,605,100円 |
| D I A M 国内重視パランスファンド30V A (適格機関投資家限定) | 4,643,533円 |
| D I A M 国内重視パランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 4,877,279円 |
| D I A M 世界パランスファンド40V A (適格機関投資家限定) | 17,536,269円 |
| D I A M 世界パランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 54,685,027円 |
| D I A M パランスファンド25V A (適格機関投資家限定) | 375,124,662円 |
| D I A M パランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定) | 492,768,252円 |
| D I A M パランスファンド50V A (適格機関投資家限定) | 1,604,220,114円 |
| D I A M グローバル・アセット・パランスV A (適格機関投資家限定) | 579,217,915円 |
| D I A M グローバル・アセット・パランスV A 2 (適格機関投資家限定) | 95,885,349円 |
| D I A M アフタ グローバル パランスファンド30V A (適格機関投資家限定) | 618,117,607円 |
| D I A M 世界アセットパランスファンドV A (適格機関投資家向け) | 27,550,457円 |
| D I A M 世界パランスファンド55V A (適格機関投資家限定) | 6,905,718円 |
| D I A M 世界パランスファンド35V A (適格機関投資家限定) | 9,443,862円 |
| D I A M 世界アセットパランスファンド2V A (適格機関投資家限定) | 214,153,029円 |
| D I A M 世界アセットパランスファンド40V A (適格機関投資家限定) | 24,495,642円 |
| D I A M 世界アセットパランスファンド25V A (適格機関投資家限定) | 88,530,403円 |
| D I A M 世界アセットパランスファンド3V A (適格機関投資家限定) | 152,767,521円 |
| D I A M 世界アセットパランスファンド4V A (適格機関投資家限定) | 444,738,720円 |
| D I A M パランス20V A (適格機関投資家限定) | 22,591,432円 |
| D I A M パランス40V A (適格機関投資家限定) | 206,560円 |
| D I A M パランス60V A (適格機関投資家限定) | 242,312円 |
| 期末元本合計 | 88,590,932,378円 |

■損益の状況

当期 自2019年2月16日 至2020年2月17日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-------|------------------|---|-----------------|
| (A) 配 | 当 等 収 益 | | 7,745,119,922円 |
| 受 | 取 配 当 | | 7,694,676,622 |
| 受 | 取 利 | | 12,104,811 |
| そ | の 他 収 益 | | 38,840,064 |
| 支 | 払 利 | | △501,575 |
| (B) 有 | 価 証 券 売 買 損 益 | | 59,213,874,771 |
| 売 | 買 益 | | 74,270,892,711 |
| 売 | 買 損 | | △15,057,017,940 |
| (C) 先 | 物 取 引 等 取 引 損 益 | | 1,575,644,220 |
| 取 | 引 益 | | 1,915,607,176 |
| 取 | 引 損 | | △339,962,956 |
| (D) そ | の 他 費 用 | | △122,413,484 |
| (E) 当 | 期 損 益 金(A+B+C+D) | | 68,412,225,429 |
| (F) 前 | 期 繰 越 損 益 金 | | 248,087,509,699 |
| (G) 解 | 約 差 損 益 金 | | △99,035,323,364 |
| (H) 追 | 加 信 託 差 損 益 金 | | 64,365,103,056 |
| (I) 合 | 計(E+F+G+H) | | 281,829,514,820 |
| 次 | 期 繰 越 損 益 金(I) | | 281,829,514,820 |

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第13期 (決算日 2020年6月22日)

(計算期間 2019年6月25日～2020年6月22日)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 2008年1月16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、為替ヘッジあり)」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 | | FTSE世界国債インデックス | | 債券組入率 | 債券先物率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|------|-----------------------------|----------|-----------|--------|----------------|
| | 円 | % | (除く日本、円ベース、為替ヘッジあり)(ベンチマーク) | 期中騰落率 | | | |
| 9期(2016年6月22日) | 13,626 | 5.4 | ポイント 391.61 | % 5.5 | % 92.9 | % - | 百万円 164,686 |
| 10期(2017年6月22日) | 13,477 | △1.1 | 387.96 | △0.9 | 97.9 | - | 177,029 |
| 11期(2018年6月22日) | 13,246 | △1.7 | 381.67 | △1.6 | 98.0 | - | 290,732 |
| 12期(2019年6月24日) | 13,888 | 4.8 | 400.89 | 5.0 | 96.9 | - | 454,858 |
| 13期(2020年6月22日) | 14,658 | 5.5 | 424.77 | 6.0 | 100.6 | - | 337,333 |

(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、為替ヘッジあり)です(以下同じ)。

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

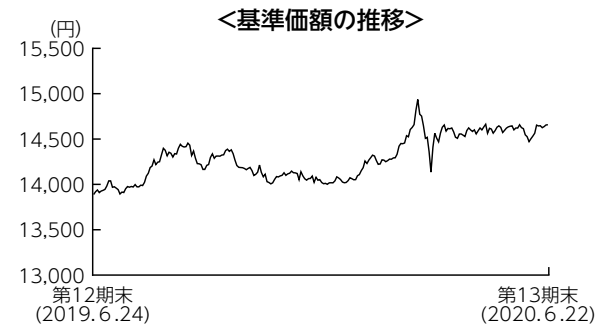
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | F T S E 世界国債 イ ン デ ッ ク ス | | 債券組入 比 率 | 債券先物 比 率 |
|--------------------------|-------------|--------|---|--------|-------------|-------------|
| | 騰 落 率 | | (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2019 年 6 月 24 日 | 円 13,888 | % - | ポイント 400.89 | % - | % 96.9 | % - |
| 6 月 末 | 13,926 | 0.3 | 401.98 | 0.3 | 97.6 | - |
| 7 月 末 | 13,987 | 0.7 | 403.79 | 0.7 | 96.8 | - |
| 8 月 末 | 14,420 | 3.8 | 416.34 | 3.9 | 95.2 | - |
| 9 月 末 | 14,313 | 3.1 | 413.28 | 3.1 | 97.4 | - |
| 10 月 末 | 14,134 | 1.8 | 408.17 | 1.8 | 99.3 | - |
| 11 月 末 | 14,127 | 1.7 | 407.93 | 1.8 | 96.1 | - |
| 12 月 末 | 14,039 | 1.1 | 405.42 | 1.1 | 98.8 | - |
| 2020 年 1 月 末 | 14,294 | 2.9 | 412.91 | 3.0 | 96.8 | - |
| 2 月 末 | 14,456 | 4.1 | 417.52 | 4.1 | 107.6 | - |
| 3 月 末 | 14,655 | 5.5 | 423.40 | 5.6 | 97.3 | - |
| 4 月 末 | 14,634 | 5.4 | 423.84 | 5.7 | 95.0 | - |
| 5 月 末 | 14,621 | 5.3 | 423.57 | 5.7 | 98.0 | - |
| (期 末) 2020 年 6 月 22 日 | 14,658 | 5.5 | 424.77 | 6.0 | 100.6 | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2019年6月25日から2020年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は14,658円となり、前期末比で5.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念により、F R B（米連邦準備理事会）による緊急利下げや、原油価格の大幅下落等のリスク回避姿勢が高まり、米国債やドイツ国債の利回りが低下（価格は上昇）したことが基準価額の上昇要因となりました。



投資環境

外国債券市場では、米国債やドイツ国債の利回りは低下する展開となりました。新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念により、各中央銀行による大幅な金融緩和政策への期待感やリスク回避姿勢の高まりから債券が買われる展開となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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。

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6.0%上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.4%下回りましたが、債券時価の採用基準が異なることを除くと、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------------|-----------|-------------------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) その他費用 (保管費用) | 1円 (1) | 0.010% (0.010) |
| (その他) | (0) | (0.000) |
| 合 計 | 1 | 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(14,296円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2019年6月25日から2020年6月22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 1,961,406 | 千アメリカ・ドル 2,651,381 (-) | | | |
| | カ | ナ | ダ | | 国 債 証 券 | 千カナダ・ドル 103,417 | 千カナダ・ドル 129,463 (-) | | | |
| | オ | ー | ス | ト | ラ | リ | ア | 国 債 証 券 | 千オーストラリア・ドル 156,999 | 千オーストラリア・ドル 176,305 (-) |
| | シ | ン | ガ | ポ | ー | ル | | 国 債 証 券 | 千シンガポール・ドル 17,234 | 千シンガポール・ドル 18,993 (-) |
| | イ | ギ | リ | ス | | | | 国 債 証 券 | 千イギリス・ポンド 196,982 | 千イギリス・ポンド 249,658 (-) |
| | イ | ス | ラ | エ | ル | | | 国 債 証 券 | 千イスラエル・シュケル 32,434 | 千イスラエル・シュケル - |
| | デ | ン | マ | ー | ク | | | 国 債 証 券 | 千デンマーク・クローネ 157,233 | 千デンマーク・クローネ 156,019 (-) |
| | ノ | ル | ウ | ェ | ー | | | 国 債 証 券 | 千ノルウェー・クローネ 60,553 | 千ノルウェー・クローネ 61,084 (-) |
| | ス | ウ | ェ | ー | デ | ン | | 国 債 証 券 | 千スウェーデン・クローナ 61,184 | 千スウェーデン・クローナ 94,435 (-) |
| | メ | キ | シ | コ | | | | 国 債 証 券 | 千メキシコ・ペソ 557,818 | 千メキシコ・ペソ 632,491 (-) |
| マ | レ | ー | シ | ア | | | 国 債 証 券 | 千マレーシア・リンギット 16,678 | 千マレーシア・リンギット - | |
| 国 | | | | | | | | | (-) | |

| | | | 買付額 | 売付額 | |
|---|------------------|--------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------|
| 外 | 南アフリカ | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド 298,935 | 千南アフリカ・ランド 508,754 (-) | |
| | | ポーランド | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ 70,663 | 千ポーランド・ズロチ 93,130 (-) |
| 国 | ユ ー ロ 区 | アイルランド | 国債証券 | 千ユーロ 55,148 | 千ユーロ 67,143 (-) |
| | | オランダ | 国債証券 | 53,327 | 77,853 (-) |
| | | ベルギー | 国債証券 | 99,674 | 121,080 (-) |
| | | フランス | 国債証券 | 362,239 | 426,114 (-) |
| | | ドイツ | 国債証券 | 219,448 | 236,364 (-) |
| | | スペイン | 国債証券 | 181,640 | 218,437 (-) |
| | | イタリア | 国債証券 | 312,325 | 352,628 (-) |
| | | フィンランド | 国債証券 | 44,313 | 58,887 (-) |
| | | オーストリア | 国債証券 | 72,996 | 86,368 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2019年6月25日から2020年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

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 1,299,750 | 千アメリカ・ドル 1,450,949 | 千円 154,917,910 | % 45.9 | % - | % 20.4 | % 17.6 | % 7.9 | |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 73,980 | 千カナダ・ドル 84,974 | 千円 6,659,420 | 2.0 | - | 0.9 | 0.7 | 0.4 | |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 87,340 | 千オーストラリア・ドル 101,044 | 千円 7,362,104 | 2.2 | - | 1.5 | 0.7 | - | |
| シンガポール | 千シンガポール・ドル 17,430 | 千シンガポール・ドル 19,719 | 千円 1,506,137 | 0.4 | - | 0.2 | 0.2 | 0.0 | |
| イギリス | 千イギリス・ポンド 121,440 | 千イギリス・ポンド 168,926 | 千円 22,261,093 | 6.6 | - | 5.2 | 1.4 | - | |
| イスラエル | 千イスラエル・シケル 26,270 | 千イスラエル・シケル 32,633 | 千円 1,008,704 | 0.3 | - | 0.2 | 0.1 | - | |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 86,680 | 千デンマーク・クローネ 109,914 | 千円 1,759,723 | 0.5 | - | 0.4 | 0.1 | - | |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 58,420 | 千ノルウェー・クローネ 63,153 | 千円 697,851 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | - | |
| スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ 63,830 | 千スウェーデン・クローナ 72,925 | 千円 822,600 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | 0.0 | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 499,011 | 千メキシコ・ペソ 554,711 | 千円 2,618,237 | 0.8 | - | 0.4 | 0.3 | 0.1 | |
| マレーシア | 千マレーシア・リングギット 57,530 | 千マレーシア・リングギット 62,250 | 千円 1,553,765 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | - | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 70,050 | 千ポーランド・ズロチ 76,665 | 千円 2,048,493 | 0.6 | - | 0.3 | 0.3 | 0.0 | |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | | | | |
| アイルランド | 19,230 | 21,816 | 2,604,264 | 0.8 | - | 0.6 | 0.2 | 0.0 | |
| オランダ | 46,640 | 55,891 | 6,671,821 | 2.0 | - | 1.3 | 0.5 | 0.2 | |
| ベルギー | 58,880 | 72,640 | 8,671,119 | 2.6 | - | 2.0 | 0.3 | 0.3 | |
| フランス | 237,240 | 287,269 | 34,291,413 | 10.2 | - | 6.9 | 2.3 | 0.9 | |
| ドイツ | 178,790 | 214,538 | 25,609,478 | 7.6 | - | 4.5 | 2.4 | 0.7 | |
| スペイン | 138,830 | 168,809 | 20,150,842 | 6.0 | - | 4.2 | 1.3 | 0.5 | |
| イタリア | 227,440 | 259,095 | 30,928,195 | 9.2 | - | 5.4 | 3.0 | 0.8 | |
| フィンランド | 14,750 | 16,900 | 2,017,364 | 0.6 | - | 0.4 | 0.1 | 0.0 | |
| オーストリア | 36,220 | 44,139 | 5,268,925 | 1.6 | - | 1.0 | 0.4 | 0.2 | |
| 合 計 | - | - | 千円 339,429,470 | 100.6 | - | 56.3 | 32.3 | 12.1 | |

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|-------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| US T N/B 2.625 01/31/26 | 国債証券 | 2.6250 | 8,050 | 9,043 | 965,592 | | 2026/01/31 |
| US T N/B 2.5 01/31/25 | 国債証券 | 2.5000 | 5,160 | 5,676 | 606,069 | | 2025/01/31 |
| US T N/B 2.25 01/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 3,780 | 4,050 | 432,472 | | 2024/01/31 |
| US T N/B 1.75 01/31/23 | 国債証券 | 1.7500 | 8,180 | 8,508 | 908,450 | | 2023/01/31 |
| US T N/B 2.5 01/31/24 | 国債証券 | 2.5000 | 10,750 | 11,616 | 1,240,317 | | 2024/01/31 |
| US T N/B 1.875 01/31/22 | 国債証券 | 1.8750 | 6,840 | 7,024 | 749,990 | | 2022/01/31 |
| US T N/B 2.5 01/15/22 | 国債証券 | 2.5000 | 14,320 | 14,832 | 1,583,713 | | 2022/01/15 |
| US T N/B 2.375 01/31/23 | 国債証券 | 2.3750 | 2,760 | 2,915 | 311,307 | | 2023/01/31 |
| US T N/B 1.5 01/31/27 | 国債証券 | 1.5000 | 8,790 | 9,362 | 999,657 | | 2027/01/31 |
| US T N/B 1.375 01/31/25 | 国債証券 | 1.3750 | 960 | 1,006 | 107,472 | | 2025/01/31 |
| US T N/B 6.0 02/15/26 | 国債証券 | 6.0000 | 800 | 1,049 | 112,081 | | 2026/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 国債証券 | 3.1250 | 2,960 | 3,978 | 424,776 | | 2042/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 国債証券 | 3.1250 | 4,760 | 6,389 | 682,252 | | 2043/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 4,320 | 5,293 | 565,134 | | 2046/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/39 | 国債証券 | 3.5000 | 3,170 | 4,455 | 475,696 | | 2039/02/15 |
| US T N/B 5.25 02/15/29 | 国債証券 | 5.2500 | 830 | 1,155 | 123,402 | | 2029/02/15 |
| US T N/B 5.375 02/15/31 | 国債証券 | 5.3750 | 2,300 | 3,409 | 364,020 | | 2031/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/36 | 国債証券 | 4.5000 | 2,320 | 3,530 | 376,997 | | 2036/02/15 |
| US T N/B 4.75 02/15/41 | 国債証券 | 4.7500 | 1,470 | 2,419 | 258,283 | | 2041/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 国債証券 | 3.6250 | 6,540 | 9,489 | 1,013,209 | | 2044/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/49 | 国債証券 | 3.0000 | 7,830 | 10,686 | 1,141,021 | | 2049/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/22 | 国債証券 | 2.0000 | 10,000 | 10,296 | 1,099,355 | | 2022/02/15 |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 国債証券 | 4.3750 | 1,210 | 1,868 | 199,490 | | 2038/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 国債証券 | 4.6250 | 2,790 | 4,493 | 479,763 | | 2040/02/15 |
| US T N/B 1.625 02/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 12,850 | 13,726 | 1,465,568 | | 2026/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/45 | 国債証券 | 2.5000 | 5,690 | 6,945 | 741,603 | | 2045/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 6,460 | 8,703 | 929,255 | | 2047/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | 6,600 | 8,936 | 954,128 | | 2048/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/24 | 国債証券 | 2.7500 | 11,930 | 13,013 | 1,389,400 | | 2024/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 12,140 | 13,081 | 1,396,743 | | 2025/02/15 |
| US T N/B 2.625 02/15/29 | 国債証券 | 2.6250 | 7,260 | 8,487 | 906,259 | | 2029/02/15 |
| US T N/B 1.75 02/28/22 | 国債証券 | 1.7500 | 10,500 | 10,774 | 1,150,425 | | 2022/02/28 |
| US T N/B 2.75 02/15/28 | 国債証券 | 2.7500 | 6,640 | 7,726 | 824,988 | | 2028/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 9,070 | 9,499 | 1,014,251 | | 2023/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 6,690 | 7,454 | 795,876 | | 2027/02/15 |
| US T N/B 2.125 02/29/24 | 国債証券 | 2.1250 | 3,330 | 3,559 | 380,043 | | 2024/02/29 |
| US T N/B 1.5 02/28/23 | 国債証券 | 1.5000 | 7,620 | 7,884 | 841,872 | | 2023/02/28 |
| US T N/B 2.5 02/28/26 | 国債証券 | 2.5000 | 5,520 | 6,168 | 658,621 | | 2026/02/28 |
| US T N/B 2.75 02/28/25 | 国債証券 | 2.7500 | 6,290 | 7,000 | 747,451 | | 2025/02/28 |
| US T N/B 1.875 02/28/22 | 国債証券 | 1.8750 | 2,440 | 2,508 | 267,845 | | 2022/02/28 |
| US T N/B 2.5 02/15/22 | 国債証券 | 2.5000 | 7,160 | 7,429 | 793,290 | | 2022/02/15 |
| US T N/B 2.375 02/29/24 | 国債証券 | 2.3750 | 5,800 | 6,251 | 667,452 | | 2024/02/29 |
| US T N/B 2.625 02/28/23 | 国債証券 | 2.6250 | 1,370 | 1,458 | 155,759 | | 2023/02/28 |
| US T N/B 2.0 02/15/50 | 国債証券 | 2.0000 | 7,850 | 8,871 | 947,234 | | 2050/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/28/22 | 国債証券 | 1.1250 | 10,000 | 10,158 | 1,084,591 | | 2022/02/28 |
| US T N/B 1.375 02/15/23 | 国債証券 | 1.3750 | 2,870 | 2,958 | 315,922 | | 2023/02/15 |
| US T N/B 1.5 02/15/30 | 国債証券 | 1.5000 | 11,550 | 12,437 | 1,327,995 | | 2030/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/28/25 | 国債証券 | 1.1250 | 7,790 | 8,086 | 863,383 | | 2025/02/28 |
| US T N/B 2.125 03/31/24 | 国債証券 | 2.1250 | 3,400 | 3,638 | 388,485 | | 2024/03/31 |
| US T N/B 1.75 03/31/22 | 国債証券 | 1.7500 | 5,290 | 5,436 | 580,433 | | 2022/03/31 |
| US T N/B 1.5 03/31/23 | 国債証券 | 1.5000 | 3,810 | 3,946 | 421,349 | | 2023/03/31 |
| US T N/B 2.625 03/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 4,430 | 4,912 | 524,465 | | 2025/03/31 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|--------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
| (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 03/31/26 | 国債証券 | 2.2500 | 1,450 | 1,601 | 170,999 | | 2026/03/31 |
| US T N/B 2.5 03/31/23 | 国債証券 | 2.5000 | 6,720 | 7,145 | 762,898 | | 2023/03/31 |
| US T N/B 0.625 03/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 2,740 | 2,761 | 294,823 | | 2027/03/31 |
| US T N/B 0.375 03/31/22 | 国債証券 | 0.3750 | 14,270 | 14,317 | 1,528,726 | | 2022/03/31 |
| US T N/B 0.5 03/15/23 | 国債証券 | 0.5000 | 7,000 | 7,055 | 753,272 | | 2023/03/15 |
| US T N/B 2.875 04/30/25 | 国債証券 | 2.8750 | 4,220 | 4,736 | 505,728 | | 2025/04/30 |
| US T N/B 2.0 04/30/24 | 国債証券 | 2.0000 | 2,060 | 2,197 | 234,620 | | 2024/04/30 |
| US T N/B 1.875 04/30/22 | 国債証券 | 1.8750 | 10,390 | 10,711 | 1,143,660 | | 2022/04/30 |
| US T N/B 2.375 04/30/26 | 国債証券 | 2.3750 | 8,680 | 9,658 | 1,031,241 | | 2026/04/30 |
| US T N/B 2.25 04/15/22 | 国債証券 | 2.2500 | 8,560 | 8,877 | 947,903 | | 2022/04/15 |
| US T N/B 2.75 04/30/23 | 国債証券 | 2.7500 | 10,670 | 11,441 | 1,221,563 | | 2023/04/30 |
| US T N/B 2.25 04/30/24 | 国債証券 | 2.2500 | 8,000 | 8,608 | 919,089 | | 2024/04/30 |
| US T N/B 0.125 04/30/22 | 国債証券 | 0.1250 | 5,670 | 5,663 | 604,711 | | 2022/04/30 |
| US T N/B 0.25 04/15/23 | 国債証券 | 0.2500 | 8,130 | 8,139 | 869,074 | | 2023/04/15 |
| US T N/B 0.375 04/30/25 | 国債証券 | 0.3750 | 1,230 | 1,232 | 131,622 | | 2025/04/30 |
| US T N/B 6.25 05/15/30 | 国債証券 | 6.2500 | 1,210 | 1,860 | 198,601 | | 2030/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 国債証券 | 4.3750 | 1,840 | 2,884 | 307,976 | | 2040/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 国債証券 | 4.3750 | 3,150 | 4,968 | 530,500 | | 2041/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/42 | 国債証券 | 3.0000 | 2,310 | 3,045 | 325,139 | | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.25 05/15/39 | 国債証券 | 4.2500 | 690 | 1,059 | 113,096 | | 2039/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 国債証券 | 2.8750 | 8,730 | 11,297 | 1,206,198 | | 2043/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 国債証券 | 3.3750 | 6,110 | 8,559 | 913,922 | | 2044/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 4,560 | 6,061 | 647,158 | | 2045/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 6,000 | 8,088 | 863,585 | | 2047/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 5,890 | 7,225 | 771,502 | | 2046/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/48 | 国債証券 | 3.1250 | 6,660 | 9,229 | 985,468 | | 2048/05/15 |
| US T N/B 1.75 05/15/22 | 国債証券 | 1.7500 | 1,250 | 1,286 | 137,388 | | 2022/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/49 | 国債証券 | 2.8750 | 8,200 | 10,963 | 1,170,589 | | 2049/05/15 |
| US T N/B 4.5 05/15/38 | 国債証券 | 4.5000 | 2,250 | 3,526 | 376,508 | | 2038/05/15 |
| US T N/B 1.75 05/15/23 | 国債証券 | 1.7500 | 20,000 | 20,890 | 2,230,492 | | 2023/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/24 | 国債証券 | 2.5000 | 12,970 | 14,093 | 1,504,787 | | 2024/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | 国債証券 | 2.1250 | 7,190 | 7,814 | 834,308 | | 2025/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 13,300 | 15,655 | 1,671,543 | | 2028/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 10,760 | 12,386 | 1,322,518 | | 2029/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 国債証券 | 2.3750 | 8,430 | 9,489 | 1,013,212 | | 2027/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/37 | 国債証券 | 5.0000 | 890 | 1,451 | 154,965 | | 2037/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 14,030 | 15,002 | 1,601,788 | | 2026/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/31/23 | 国債証券 | 1.6250 | 1,460 | 1,520 | 162,326 | | 2023/05/31 |
| US T N/B 2.0 05/31/24 | 国債証券 | 2.0000 | 6,910 | 7,378 | 787,811 | | 2024/05/31 |
| US T N/B 1.25 05/15/50 | 国債証券 | 1.2500 | 6,000 | 5,683 | 606,799 | | 2050/05/15 |
| US T N/B 1.75 05/31/22 | 国債証券 | 1.7500 | 9,490 | 9,775 | 1,043,723 | | 2022/05/31 |
| US T N/B 2.125 05/31/26 | 国債証券 | 2.1250 | 6,070 | 6,669 | 712,093 | | 2026/05/31 |
| US T N/B 2.75 05/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | 3,880 | 4,168 | 445,046 | | 2023/05/31 |
| US T N/B 2.875 05/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 4,550 | 5,114 | 546,111 | | 2025/05/31 |
| US T N/B 0.125 05/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 8,630 | 8,608 | 919,085 | | 2023/05/15 |
| US T N/B 1.375 06/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 1,390 | 1,438 | 153,593 | | 2023/06/30 |
| US T N/B 2.0 06/30/24 | 国債証券 | 2.0000 | 7,540 | 8,060 | 860,644 | | 2024/06/30 |
| US T N/B 2.125 06/30/22 | 国債証券 | 2.1250 | 3,820 | 3,968 | 423,729 | | 2022/06/30 |
| US T N/B 2.75 06/30/25 | 国債証券 | 2.7500 | 8,100 | 9,068 | 968,279 | | 2025/06/30 |
| US T N/B 1.875 06/30/26 | 国債証券 | 1.8750 | 6,470 | 7,014 | 748,980 | | 2026/06/30 |
| US T N/B 2.625 06/30/23 | 国債証券 | 2.6250 | 8,780 | 9,415 | 1,005,331 | | 2023/06/30 |
| US T N/B 1.75 06/30/24 | 国債証券 | 1.7500 | 7,510 | 7,953 | 849,201 | | 2024/06/30 |
| US T N/B 1.75 06/30/22 | 国債証券 | 1.7500 | 5,160 | 5,320 | 568,106 | | 2022/06/30 |
| US T N/B 1.75 06/15/22 | 国債証券 | 1.7500 | 3,700 | 3,814 | 407,224 | | 2022/06/15 |
| US T N/B 2.125 07/31/24 | 国債証券 | 2.1250 | 3,520 | 3,786 | 404,281 | | 2024/07/31 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 金額 | 償還年月日 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| US T N/B 1.25 07/31/23 | 国債証券 | 1.2500 | 8,400 | 8,667 | 925,455 | 2023/07/31 | |
| US T N/B 2.875 07/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 2,990 | 3,371 | 359,945 | 2025/07/31 | |
| US T N/B 1.875 07/31/22 | 国債証券 | 1.8750 | 10,290 | 10,651 | 1,137,288 | 2022/07/31 | |
| US T N/B 2.75 07/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | 10,070 | 10,858 | 1,159,339 | 2023/07/31 | |
| US T N/B 1.75 07/15/22 | 国債証券 | 1.7500 | 2,940 | 3,033 | 323,921 | 2022/07/15 | |
| US T N/B 6.25 08/15/23 | 国債証券 | 6.2500 | 1,200 | 1,427 | 152,437 | 2023/08/15 | |
| US T N/B 3.75 08/15/41 | 国債証券 | 3.7500 | 1,170 | 1,708 | 182,433 | 2041/08/15 | |
| US T N/B 5.5 08/15/28 | 国債証券 | 5.5000 | 930 | 1,295 | 138,277 | 2028/08/15 | |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 国債証券 | 3.8750 | 1,460 | 2,159 | 230,562 | 2040/08/15 | |
| US T N/B 2.75 08/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 4,000 | 5,075 | 541,924 | 2042/08/15 | |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 国債証券 | 3.1250 | 3,930 | 5,308 | 566,796 | 2044/08/15 | |
| US T N/B 4.5 08/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | 2,510 | 3,971 | 423,993 | 2039/08/15 | |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | 4,350 | 6,293 | 671,964 | 2043/08/15 | |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | 6,340 | 8,269 | 882,906 | 2045/08/15 | |
| US T N/B 2.0 08/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 9,350 | 10,131 | 1,081,751 | 2025/08/15 | |
| US T N/B 2.75 08/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 8,980 | 11,608 | 1,239,391 | 2047/08/15 | |
| US T N/B 2.25 08/15/49 | 国債証券 | 2.2500 | 7,730 | 9,178 | 980,017 | 2049/08/15 | |
| US T N/B 2.5 08/15/23 | 国債証券 | 2.5000 | 6,700 | 7,179 | 766,607 | 2023/08/15 | |
| US T N/B 2.375 08/15/24 | 国債証券 | 2.3750 | 14,120 | 15,338 | 1,637,740 | 2024/08/15 | |
| US T N/B 2.25 08/15/46 | 国債証券 | 2.2500 | 4,060 | 4,759 | 508,127 | 2046/08/15 | |
| US T N/B 3.0 08/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | 7,030 | 9,557 | 1,020,454 | 2048/08/15 | |
| US T N/B 2.25 08/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 9,290 | 10,407 | 1,111,230 | 2027/08/15 | |
| US T N/B 1.5 08/15/26 | 国債証券 | 1.5000 | 8,500 | 9,035 | 964,691 | 2026/08/15 | |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 10,270 | 12,130 | 1,295,187 | 2028/08/15 | |
| US T N/B 2.75 08/31/25 | 国債証券 | 2.7500 | 8,140 | 9,139 | 975,845 | 2025/08/31 | |
| US T N/B 1.375 08/31/23 | 国債証券 | 1.3750 | 9,500 | 9,848 | 1,051,559 | 2023/08/31 | |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 国債証券 | 1.6250 | 9,900 | 10,763 | 1,149,182 | 2029/08/15 | |
| US T N/B 1.875 08/31/24 | 国債証券 | 1.8750 | 7,320 | 7,806 | 833,517 | 2024/08/31 | |
| US T N/B 2.75 08/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | 7,030 | 7,594 | 810,816 | 2023/08/31 | |
| US T N/B 1.625 08/31/22 | 国債証券 | 1.6250 | 3,280 | 3,382 | 361,122 | 2022/08/31 | |
| US T N/B 1.5 08/15/22 | 国債証券 | 1.5000 | 11,300 | 11,616 | 1,240,292 | 2022/08/15 | |
| US T N/B 1.5 08/31/21 | 国債証券 | 1.5000 | 13,560 | 13,773 | 1,470,592 | 2021/08/31 | |
| US T N/B 1.375 08/31/26 | 国債証券 | 1.3750 | 6,000 | 6,331 | 676,054 | 2026/08/31 | |
| US T N/B 3.0 09/30/25 | 国債証券 | 3.0000 | 7,430 | 8,451 | 902,380 | 2025/09/30 | |
| US T N/B 2.125 09/30/21 | 国債証券 | 2.1250 | 9,800 | 10,042 | 1,072,259 | 2021/09/30 | |
| US T N/B 1.375 09/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 9,000 | 9,338 | 997,039 | 2023/09/30 | |
| US T N/B 1.75 09/30/22 | 国債証券 | 1.7500 | 5,360 | 5,548 | 592,406 | 2022/09/30 | |
| US T N/B 1.125 09/30/21 | 国債証券 | 1.1250 | 430 | 435 | 46,463 | 2021/09/30 | |
| US T N/B 1.875 09/30/22 | 国債証券 | 1.8750 | 8,860 | 9,197 | 981,973 | 2022/09/30 | |
| US T N/B 2.875 09/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 7,810 | 8,484 | 905,925 | 2023/09/30 | |
| US T N/B 2.75 09/15/21 | 国債証券 | 2.7500 | 2,960 | 3,053 | 326,026 | 2021/09/15 | |
| US T N/B 1.5 09/15/22 | 国債証券 | 1.5000 | 8,410 | 8,653 | 923,926 | 2022/09/15 | |
| US T N/B 1.5 09/30/21 | 国債証券 | 1.5000 | 20,880 | 21,229 | 2,266,716 | 2021/09/30 | |
| US T N/B 1.625 09/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 820 | 878 | 93,789 | 2026/09/30 | |
| US T N/B 2.25 10/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 4,560 | 4,944 | 527,950 | 2024/10/31 | |
| US T N/B 3.0 10/31/25 | 国債証券 | 3.0000 | 6,560 | 7,472 | 797,812 | 2025/10/31 | |
| US T N/B 1.25 10/31/21 | 国債証券 | 1.2500 | 10,500 | 10,650 | 1,137,200 | 2021/10/31 | |
| US T N/B 2.875 10/15/21 | 国債証券 | 2.8750 | 13,100 | 13,559 | 1,447,695 | 2021/10/15 | |
| US T N/B 1.625 10/31/23 | 国債証券 | 1.6250 | 1,780 | 1,862 | 198,884 | 2023/10/31 | |
| US T N/B 2.0 10/31/22 | 国債証券 | 2.0000 | 4,280 | 4,461 | 476,325 | 2022/10/31 | |
| US T N/B 2.875 10/31/23 | 国債証券 | 2.8750 | 9,290 | 10,108 | 1,079,303 | 2023/10/31 | |
| US T N/B 1.5 10/31/21 | 国債証券 | 1.5000 | 9,100 | 9,262 | 988,951 | 2021/10/31 | |
| US T N/B 1.625 10/31/26 | 国債証券 | 1.6250 | 100 | 107 | 11,442 | 2026/10/31 | |
| US T N/B 8.0 11/15/21 | 国債証券 | 8.0000 | 2,100 | 2,328 | 248,661 | 2021/11/15 | |
| US T N/B 5.25 11/15/28 | 国債証券 | 5.2500 | 1,700 | 2,350 | 250,936 | 2028/11/15 | |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|-------------------------|------|--------|-----------|-----------|-------------|--------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 国債証券 | 6.1250 | 2,050 | 2,884 | 308,003 | | 2027/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/44 | 国債証券 | 3.0000 | 4,400 | 5,833 | 622,872 | | 2044/11/15 |
| US T N/B 4.25 11/15/40 | 国債証券 | 4.2500 | 1,040 | 1,612 | 172,199 | | 2040/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 4,620 | 5,856 | 625,344 | | 2042/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 2,350 | 3,152 | 336,591 | | 2041/11/15 |
| US T N/B 3.75 11/15/43 | 国債証券 | 3.7500 | 4,190 | 6,179 | 659,795 | | 2043/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 4,650 | 6,015 | 642,244 | | 2047/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 4,950 | 6,605 | 705,232 | | 2045/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 5,750 | 7,564 | 807,650 | | 2046/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/24 | 国債証券 | 2.2500 | 13,850 | 15,028 | 1,604,575 | | 2024/11/15 |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 620 | 967 | 103,350 | | 2039/11/15 |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 国債証券 | 3.3750 | 7,560 | 10,982 | 1,172,556 | | 2048/11/15 |
| US T N/B 2.375 11/15/49 | 国債証券 | 2.3750 | 7,470 | 9,108 | 972,476 | | 2049/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/21 | 国債証券 | 2.0000 | 7,900 | 8,099 | 864,734 | | 2021/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/25 | 国債証券 | 2.2500 | 3,890 | 4,279 | 456,868 | | 2025/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 国債証券 | 3.1250 | 9,770 | 11,782 | 1,258,046 | | 2028/11/15 |
| US T N/B 1.625 11/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 20,000 | 20,678 | 2,207,886 | | 2022/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/23 | 国債証券 | 2.7500 | 13,330 | 14,457 | 1,543,663 | | 2023/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/26 | 国債証券 | 2.0000 | 8,900 | 9,750 | 1,041,046 | | 2026/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/30/22 | 国債証券 | 2.0000 | 12,020 | 12,544 | 1,339,422 | | 2022/11/30 |
| US T N/B 2.25 11/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 12,060 | 13,543 | 1,446,087 | | 2027/11/15 |
| US T N/B 2.125 11/30/24 | 国債証券 | 2.1250 | 3,970 | 4,288 | 457,853 | | 2024/11/30 |
| US T N/B 2.875 11/30/25 | 国債証券 | 2.8750 | 6,780 | 7,685 | 820,552 | | 2025/11/30 |
| US T N/B 2.875 11/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 9,810 | 10,689 | 1,141,353 | | 2023/11/30 |
| US T N/B 1.75 11/30/21 | 国債証券 | 1.7500 | 1,380 | 1,410 | 150,646 | | 2021/11/30 |
| US T N/B 2.875 11/15/21 | 国債証券 | 2.8750 | 8,440 | 8,754 | 934,755 | | 2021/11/15 |
| US T N/B 1.5 11/30/21 | 国債証券 | 1.5000 | 2,460 | 2,506 | 267,630 | | 2021/11/30 |
| US T N/B 1.625 11/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 310 | 332 | 35,482 | | 2026/11/30 |
| US T N/B 1.75 11/15/29 | 国債証券 | 1.7500 | 13,240 | 14,565 | 1,555,108 | | 2029/11/15 |
| US T N/B 1.5 11/30/24 | 国債証券 | 1.5000 | 1,510 | 1,590 | 169,775 | | 2024/11/30 |
| US T N/B 2.625 12/31/23 | 国債証券 | 2.6250 | 9,670 | 10,472 | 1,118,128 | | 2023/12/31 |
| US T N/B 2.625 12/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 7,300 | 8,187 | 874,230 | | 2025/12/31 |
| US T N/B 2.125 12/31/21 | 国債証券 | 2.1250 | 7,000 | 7,201 | 768,935 | | 2021/12/31 |
| US T N/B 2.25 12/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 4,530 | 4,926 | 525,989 | | 2024/12/31 |
| US T N/B 2.125 12/31/22 | 国債証券 | 2.1250 | 13,500 | 14,150 | 1,510,874 | | 2022/12/31 |
| US T N/B 2.625 12/15/21 | 国債証券 | 2.6250 | 11,320 | 11,727 | 1,252,118 | | 2021/12/15 |
| US T N/B 1.625 12/31/21 | 国債証券 | 1.6250 | 3,070 | 3,137 | 334,998 | | 2021/12/31 |
| US T N/B 1.75 12/31/26 | 国債証券 | 1.7500 | 4,990 | 5,391 | 575,696 | | 2026/12/31 |
| US T N/B 1.625 12/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 8,600 | 8,903 | 950,610 | | 2022/12/15 |
| US T N/B 1.75 12/31/24 | 国債証券 | 1.7500 | 600 | 638 | 68,221 | | 2024/12/31 |
| 小計 | - | - | 1,299,750 | 1,450,949 | 154,917,910 | | - |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| CANADA 1.5 02/01/22 | 国債証券 | 1.5000 | 3,050 | 3,112 | 243,895 | | 2022/02/01 |
| CANADA 2.25 03/01/24 | 国債証券 | 2.2500 | 3,190 | 3,414 | 267,600 | | 2024/03/01 |
| CANADA 0.5 03/01/22 | 国債証券 | 0.5000 | 4,170 | 4,188 | 328,257 | | 2022/03/01 |
| CANADA 1.75 03/01/23 | 国債証券 | 1.7500 | 5,070 | 5,266 | 412,772 | | 2023/03/01 |
| CANADA 1.25 03/01/25 | 国債証券 | 1.2500 | 2,060 | 2,145 | 168,161 | | 2025/03/01 |
| CANADA 1.5 05/01/22 | 国債証券 | 1.5000 | 1,580 | 1,616 | 126,699 | | 2022/05/01 |
| CANADA 1.5 06/01/26 | 国債証券 | 1.5000 | 2,450 | 2,610 | 204,552 | | 2026/06/01 |
| CANADA 8.0 06/01/27 | 国債証券 | 8.0000 | 920 | 1,393 | 109,241 | | 2027/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,230 | 1,794 | 140,602 | | 2029/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 1,860 | 3,019 | 236,676 | | 2033/06/01 |
| CANADA 5.0 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 1,950 | 3,228 | 253,025 | | 2037/06/01 |
| CANADA 2.5 06/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 3,600 | 3,905 | 306,037 | | 2024/06/01 |
| CANADA 4.0 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 2,450 | 3,874 | 303,637 | | 2041/06/01 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|--------------------------|------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 価額 | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| CANADA 2.75 06/01/22 | 国債証券 | 2.7500 | 3,350 | 3,511 | 275,225 | 2022/06/01 | |
| CANADA 1.5 06/01/23 | 国債証券 | 1.5000 | 3,130 | 3,238 | 253,807 | 2023/06/01 | |
| CANADA 2.0 06/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 1,060 | 1,187 | 93,029 | 2028/06/01 | |
| CANADA 2.25 06/01/25 | 国債証券 | 2.2500 | 1,840 | 2,009 | 157,490 | 2025/06/01 | |
| CANADA 1.0 06/01/27 | 国債証券 | 1.0000 | 2,620 | 2,721 | 213,257 | 2027/06/01 | |
| CANADA 2.25 06/01/29 | 国債証券 | 2.2500 | 1,480 | 1,707 | 133,794 | 2029/06/01 | |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 3,320 | 3,548 | 278,089 | 2030/06/01 | |
| CANADA 0.25 08/01/22 | 国債証券 | 0.2500 | 1,600 | 1,598 | 125,254 | 2022/08/01 | |
| CANADA 1.5 09/01/24 | 国債証券 | 1.5000 | 1,410 | 1,478 | 115,836 | 2024/09/01 | |
| CANADA 2.0 09/01/23 | 国債証券 | 2.0000 | 3,080 | 3,244 | 254,235 | 2023/09/01 | |
| CANADA 1.0 09/01/22 | 国債証券 | 1.0000 | 3,180 | 3,230 | 253,194 | 2022/09/01 | |
| CANADA 0.5 09/01/25 | 国債証券 | 0.5000 | 2,220 | 2,233 | 175,007 | 2025/09/01 | |
| CANADA 1.25 11/01/21 | 国債証券 | 1.2500 | 4,300 | 4,360 | 341,742 | 2021/11/01 | |
| CANADA 3.5 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 2,510 | 3,918 | 307,107 | 2045/12/01 | |
| CANADA 2.75 12/01/48 | 国債証券 | 2.7500 | 2,840 | 4,062 | 318,403 | 2048/12/01 | |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 1,790 | 2,267 | 177,694 | 2051/12/01 | |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 670 | 1,085 | 85,093 | 2064/12/01 | |
| 小計 | - | - | 73,980 | 84,974 | 6,659,420 | - | |
| (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 | 2,120 | 2,705 | 197,131 | 2047/03/21 | |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 | 国債証券 | 3.2500 | 3,880 | 4,412 | 321,526 | 2025/04/21 | |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 5,540 | 7,088 | 516,479 | 2027/04/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 国債証券 | 2.7500 | 5,220 | 5,706 | 415,766 | 2024/04/21 | |
| AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 国債証券 | 4.2500 | 5,200 | 6,327 | 461,034 | 2026/04/21 | |
| AUSTRALIAN 5.5 04/21/23 | 国債証券 | 5.5000 | 7,140 | 8,196 | 597,173 | 2023/04/21 | |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 4,680 | 5,661 | 412,492 | 2029/04/21 | |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33 | 国債証券 | 4.5000 | 2,890 | 4,111 | 299,544 | 2033/04/21 | |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 2,050 | 2,789 | 203,206 | 2037/04/21 | |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 4,340 | 4,848 | 353,240 | 2028/05/21 | |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 国債証券 | 2.5000 | 4,050 | 4,679 | 340,954 | 2030/05/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 国債証券 | 2.7500 | 950 | 1,143 | 83,345 | 2041/05/21 | |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 1,000 | 1,031 | 75,167 | 2032/05/21 | |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 1,370 | 1,763 | 128,484 | 2039/06/21 | |
| AUSTRALIAN 1.5 06/21/31 | 国債証券 | 1.5000 | 3,520 | 3,730 | 271,794 | 2031/06/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 2,620 | 3,177 | 231,532 | 2035/06/21 | |
| AUSTRALIAN 5.75 07/15/22 | 国債証券 | 5.7500 | 4,040 | 4,495 | 327,538 | 2022/07/15 | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28 | 国債証券 | 2.7500 | 5,590 | 6,497 | 473,413 | 2028/11/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27 | 国債証券 | 2.7500 | 4,270 | 4,914 | 358,059 | 2027/11/21 | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 3,430 | 4,021 | 292,994 | 2029/11/21 | |
| AUSTRALIAN 2.25 11/21/22 | 国債証券 | 2.2500 | 5,730 | 6,005 | 437,561 | 2022/11/21 | |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/24 | 国債証券 | 0.2500 | 3,210 | 3,195 | 232,817 | 2024/11/21 | |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30 | 国債証券 | 1.0000 | 4,500 | 4,540 | 330,846 | 2030/12/21 | |
| 小計 | - | - | 87,340 | 101,044 | 7,362,104 | - | |
| (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 2.0 02/01/24 | 国債証券 | 2.0000 | 580 | 612 | 46,816 | 2024/02/01 | |
| SINGAPORE 1.75 02/01/23 | 国債証券 | 1.7500 | 1,700 | 1,762 | 134,585 | 2023/02/01 | |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27 | 国債証券 | 3.5000 | 1,130 | 1,336 | 102,060 | 2027/03/01 | |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46 | 国債証券 | 2.7500 | 1,100 | 1,437 | 109,811 | 2046/03/01 | |
| SINGAPORE 1.875 03/01/50 | 国債証券 | 1.8750 | 330 | 374 | 28,582 | 2050/03/01 | |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42 | 国債証券 | 2.7500 | 730 | 935 | 71,425 | 2042/04/01 | |
| SINGAPORE 1.75 04/01/22 | 国債証券 | 1.7500 | 1,740 | 1,784 | 136,335 | 2022/04/01 | |
| SINGAPORE 2.625 05/01/28 | 国債証券 | 2.6250 | 1,020 | 1,161 | 88,697 | 2028/05/01 | |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25 | 国債証券 | 2.3750 | 920 | 1,001 | 76,523 | 2025/06/01 | |
| SINGAPORE 2.125 06/01/26 | 国債証券 | 2.1250 | 570 | 619 | 47,337 | 2026/06/01 | |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29 | 国債証券 | 2.8750 | 1,070 | 1,254 | 95,784 | 2029/07/01 | |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|---------------------------------|------|--------|-------------|-------------|------------|--------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
| (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 2.375 07/01/39 | 国債証券 | 2.3750 | 470 | 560 | 42,785 | | 2039/07/01 |
| SINGAPORE 2.75 07/01/23 | 国債証券 | 2.7500 | 370 | 396 | 30,264 | | 2023/07/01 |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 510 | 588 | 44,913 | | 2036/08/01 |
| SINGAPORE 3.0 09/01/24 | 国債証券 | 3.0000 | 1,970 | 2,176 | 166,239 | | 2024/09/01 |
| SINGAPORE 3.125 09/01/22 | 国債証券 | 3.1250 | 1,670 | 1,772 | 135,373 | | 2022/09/01 |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30 | 国債証券 | 2.8750 | 450 | 533 | 40,764 | | 2030/09/01 |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33 | 国債証券 | 3.3750 | 1,100 | 1,411 | 107,837 | | 2033/09/01 |
| 小計 | - | - | 17,430 | 19,719 | 1,506,137 | | - |
| (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 | 4,380 | 6,787 | 894,423 | | 2044/01/22 |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45 | 国債証券 | 3.5000 | 3,190 | 5,190 | 684,039 | | 2045/01/22 |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60 | 国債証券 | 4.0000 | 2,480 | 5,424 | 714,841 | | 2060/01/22 |
| UK TREASURY 1.75 01/22/49 | 国債証券 | 1.7500 | 2,720 | 3,452 | 454,969 | | 2049/01/22 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/23 | 国債証券 | 0.1250 | 3,000 | 3,008 | 396,502 | | 2023/01/31 |
| UK TREASURY 5.0 03/07/25 | 国債証券 | 5.0000 | 2,780 | 3,433 | 452,458 | | 2025/03/07 |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 国債証券 | 4.2500 | 3,260 | 5,083 | 669,922 | | 2036/03/07 |
| UK TREASURY 1.0 04/22/24 | 国債証券 | 1.0000 | 6,690 | 6,952 | 916,202 | | 2024/04/22 |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 国債証券 | 4.2500 | 3,580 | 5,212 | 686,853 | | 2032/06/07 |
| UK TREASURY 0.625 06/07/25 | 国債証券 | 0.6250 | 2,080 | 2,143 | 282,503 | | 2025/06/07 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47 | 国債証券 | 1.5000 | 2,890 | 3,454 | 455,184 | | 2047/07/22 |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 国債証券 | 3.7500 | 2,280 | 4,304 | 567,265 | | 2052/07/22 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57 | 国債証券 | 1.7500 | 2,680 | 3,665 | 483,066 | | 2057/07/22 |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65 | 国債証券 | 2.5000 | 2,670 | 4,651 | 613,001 | | 2065/07/22 |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68 | 国債証券 | 3.5000 | 2,400 | 5,297 | 698,107 | | 2068/07/22 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/26 | 国債証券 | 1.5000 | 2,390 | 2,607 | 343,570 | | 2026/07/22 |
| UK TREASURY 1.25 07/22/27 | 国債証券 | 1.2500 | 3,860 | 4,181 | 551,063 | | 2027/07/22 |
| UK TREASURY 0.5 07/22/22 | 国債証券 | 0.5000 | 2,680 | 2,710 | 357,210 | | 2022/07/22 |
| UK TREASURY 0.75 07/22/23 | 国債証券 | 0.7500 | 2,090 | 2,139 | 282,002 | | 2023/07/22 |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,930 | 3,192 | 420,721 | | 2039/09/07 |
| UK TREASURY 2.25 09/07/23 | 国債証券 | 2.2500 | 3,830 | 4,110 | 541,644 | | 2023/09/07 |
| UK TREASURY 2.75 09/07/24 | 国債証券 | 2.7500 | 2,500 | 2,792 | 367,995 | | 2024/09/07 |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25 | 国債証券 | 2.0000 | 4,330 | 4,791 | 631,452 | | 2025/09/07 |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34 | 国債証券 | 4.5000 | 3,320 | 5,160 | 680,108 | | 2034/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37 | 国債証券 | 1.7500 | 3,560 | 4,226 | 556,959 | | 2037/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/22 | 国債証券 | 1.7500 | 7,000 | 7,277 | 958,998 | | 2022/09/07 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/54 | 国債証券 | 1.6250 | 1,600 | 2,067 | 272,399 | | 2054/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/71 | 国債証券 | 1.6250 | 1,920 | 2,841 | 374,423 | | 2071/10/22 |
| UK TREASURY 1.25 10/22/41 | 国債証券 | 1.2500 | 1,000 | 1,112 | 146,631 | | 2041/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/28 | 国債証券 | 1.6250 | 3,240 | 3,648 | 480,862 | | 2028/10/22 |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 国債証券 | 0.8750 | 4,140 | 4,403 | 580,293 | | 2029/10/22 |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28 | 国債証券 | 6.0000 | 1,450 | 2,161 | 284,810 | | 2028/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 国債証券 | 4.7500 | 1,980 | 3,416 | 450,198 | | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42 | 国債証券 | 4.5000 | 3,310 | 5,937 | 782,397 | | 2042/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46 | 国債証券 | 4.2500 | 3,520 | 6,519 | 859,125 | | 2046/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 国債証券 | 4.2500 | 4,020 | 8,589 | 1,131,981 | | 2055/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27 | 国債証券 | 4.2500 | 2,280 | 2,986 | 393,516 | | 2027/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40 | 国債証券 | 4.2500 | 3,360 | 5,665 | 746,572 | | 2040/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30 | 国債証券 | 4.7500 | 3,120 | 4,575 | 602,915 | | 2030/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49 | 国債証券 | 4.2500 | 1,930 | 3,747 | 493,893 | | 2049/12/07 |
| 小計 | - | - | 121,440 | 168,926 | 22,261,093 | | - |
| (イスラエル) | | % | 千イスラエル・シェケル | 千イスラエル・シェケル | 千円 | | |
| ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42 | 国債証券 | 5.5000 | 4,670 | 8,253 | 255,103 | | 2042/01/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47 | 国債証券 | 3.7500 | 1,730 | 2,529 | 78,194 | | 2047/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27 | 国債証券 | 2.0000 | 6,700 | 7,393 | 228,526 | | 2027/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23 | 国債証券 | 4.2500 | 7,960 | 8,868 | 274,139 | | 2023/03/31 |

| 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 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (イスラエル) | | % | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | 千円 | | |
| ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25 | 国債証券 | 1.7500 | 5,210 | 5,588 | 172,741 | 2025/08/31 | |
| 小計 | — | — | 26,270 | 32,633 | 1,008,704 | — | |
| (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 | 21,050 | 39,448 | 631,573 | 2039/11/15 | |
| DENMARK 1.75 11/15/25 | 国債証券 | 1.7500 | 14,100 | 15,828 | 253,414 | 2025/11/15 | |
| DENMARK 1.5 11/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 15,100 | 16,168 | 258,853 | 2023/11/15 | |
| DENMARK 0.5 11/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 16,390 | 17,476 | 279,794 | 2027/11/15 | |
| DENMARK 0.5 11/15/29 | 国債証券 | 0.5000 | 10,040 | 10,792 | 172,784 | 2029/11/15 | |
| DENMARK 0.25 11/15/22 | 国債証券 | 0.2500 | 10,000 | 10,200 | 163,302 | 2022/11/15 | |
| 小計 | — | — | 86,680 | 109,914 | 1,759,723 | — | |
| (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 | 8,270 | 8,769 | 96,908 | 2026/02/19 | |
| NORWAY 1.75 02/17/27 | 国債証券 | 1.7500 | 2,870 | 3,106 | 34,331 | 2027/02/17 | |
| NORWAY 3.0 03/14/24 | 国債証券 | 3.0000 | 11,760 | 12,937 | 142,956 | 2024/03/14 | |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国債証券 | 1.7500 | 10,070 | 10,722 | 118,487 | 2025/03/13 | |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | 2.0000 | 10,510 | 11,676 | 129,026 | 2028/04/26 | |
| NORWAY 2.0 05/24/23 | 国債証券 | 2.0000 | 5,560 | 5,845 | 64,594 | 2023/05/24 | |
| NORWAY 1.375 08/19/30 | 国債証券 | 1.3750 | 7,410 | 7,926 | 87,583 | 2030/08/19 | |
| NORWAY 1.75 09/06/29 | 国債証券 | 1.7500 | 1,970 | 2,168 | 23,963 | 2029/09/06 | |
| 小計 | — | — | 58,420 | 63,153 | 697,851 | — | |
| (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 | 7,780 | 11,889 | 134,113 | 2039/03/30 | |
| SWEDEN 0.75 05/12/28 | 国債証券 | 0.7500 | 11,710 | 12,491 | 140,907 | 2028/05/12 | |
| SWEDEN 2.5 05/12/25 | 国債証券 | 2.5000 | 17,950 | 20,397 | 230,087 | 2025/05/12 | |
| SWEDEN 3.5 06/01/22 | 国債証券 | 3.5000 | 10 | 10 | 121 | 2022/06/01 | |
| SWEDEN 1.5 11/13/23 | 国債証券 | 1.5000 | 15,060 | 16,003 | 180,517 | 2023/11/13 | |
| SWEDEN 1.0 11/12/26 | 国債証券 | 1.0000 | 4,010 | 4,314 | 48,662 | 2026/11/12 | |
| SWEDEN 0.75 11/12/29 | 国債証券 | 0.7500 | 7,310 | 7,818 | 88,192 | 2029/11/12 | |
| 小計 | — | — | 63,830 | 72,925 | 822,600 | — | |
| (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 | 38,064 | 38,727 | 182,795 | 2026/03/05 | |
| MEXICAN BONDS 03/09/23 | 国債証券 | 6.7500 | 62,560 | 65,532 | 309,315 | 2023/03/09 | |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 国債証券 | 8.5000 | 48,201 | 56,763 | 267,925 | 2029/05/31 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 国債証券 | 7.7500 | 2,315 | 2,606 | 12,301 | 2031/05/29 | |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 43,175 | 47,701 | 225,150 | 2027/06/03 | |
| MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22 | 国債証券 | 6.5000 | 57,079 | 58,835 | 277,702 | 2022/06/09 | |
| MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24 | 国債証券 | 8.0000 | 40,030 | 44,431 | 209,715 | 2024/09/05 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 国債証券 | 7.7500 | 26,328 | 28,593 | 134,962 | 2042/11/13 | |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47 | 国債証券 | 8.0000 | 33,666 | 37,536 | 177,174 | 2047/11/07 | |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 国債証券 | 8.5000 | 37,143 | 43,742 | 206,466 | 2038/11/18 | |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 国債証券 | 10.0000 | 21,473 | 28,848 | 136,164 | 2036/11/20 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 国債証券 | 7.7500 | 20,241 | 22,885 | 108,020 | 2034/11/23 | |
| MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 国債証券 | 10.0000 | 31,873 | 38,071 | 179,698 | 2024/12/05 | |
| MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23 | 国債証券 | 8.0000 | 36,863 | 40,433 | 190,844 | 2023/12/07 | |
| 小計 | — | — | 499,011 | 554,711 | 2,618,237 | — | |
| (マレーシア) | | % | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円 | | |
| MALAYSIA 4.736 03/15/46 | 国債証券 | 4.7360 | 3,500 | 3,893 | 97,176 | 2046/03/15 | |
| MALAYSIA 3.48 03/15/23 | 国債証券 | 3.4800 | 3,910 | 4,033 | 100,675 | 2023/03/15 | |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26 | 国債証券 | 4.3920 | 1,480 | 1,615 | 40,334 | 2026/04/15 | |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 国債証券 | 4.4980 | 2,820 | 3,148 | 78,583 | 2030/04/15 | |
| MALAYSIA 4.127 04/15/32 | 国債証券 | 4.1270 | 1,180 | 1,272 | 31,758 | 2032/04/15 | |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 国債証券 | 3.8440 | 1,340 | 1,406 | 35,097 | 2033/04/15 | |
| MALAYSIA 4.762 04/07/37 | 国債証券 | 4.7620 | 5,540 | 6,383 | 159,324 | 2037/04/07 | |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 国債証券 | 3.5020 | 4,580 | 4,802 | 119,860 | 2027/05/31 | |
| MALAYSIA 4.232 06/30/31 | 国債証券 | 4.2320 | 2,000 | 2,183 | 54,491 | 2031/06/30 | |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|---------------------------|------|--------|--------------|--------------|-----------|--------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
| (マレーシア) | | % | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円 | | |
| MALAYSIA 4.181 07/15/24 | 国債証券 | 4.1810 | 2,190 | 2,330 | 58,166 | | 2024/07/15 |
| MALAYSIA 3.828 07/05/34 | 国債証券 | 3.8280 | 2,000 | 2,113 | 52,746 | | 2034/07/05 |
| MALAYSIA 3.418 08/15/22 | 国債証券 | 3.4180 | 5,000 | 5,122 | 127,860 | | 2022/08/15 |
| MALAYSIA 3.885 08/15/29 | 国債証券 | 3.8850 | 2,760 | 2,977 | 74,305 | | 2029/08/15 |
| MALAYSIA 3.8 08/17/23 | 国債証券 | 3.8000 | 3,700 | 3,857 | 96,279 | | 2023/08/17 |
| MALAYSIA 5.248 09/15/28 | 国債証券 | 5.2480 | 1,480 | 1,727 | 43,111 | | 2028/09/15 |
| MALAYSIA 3.955 09/15/25 | 国債証券 | 3.9550 | 4,400 | 4,701 | 117,359 | | 2025/09/15 |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 国債証券 | 4.9350 | 3,470 | 4,079 | 101,830 | | 2043/09/30 |
| MALAYSIA 4.059 09/30/24 | 国債証券 | 4.0590 | 1,840 | 1,956 | 48,845 | | 2024/09/30 |
| MALAYSIA 3.795 09/30/22 | 国債証券 | 3.7950 | 1,790 | 1,850 | 46,196 | | 2022/09/30 |
| MALAYSIA 3.9 11/30/26 | 国債証券 | 3.9000 | 1,500 | 1,604 | 40,055 | | 2026/11/30 |
| MALAYSIA 4.642 11/07/33 | 国債証券 | 4.6420 | 1,050 | 1,190 | 29,704 | | 2033/11/07 |
| 小計 | - | - | 57,530 | 62,250 | 1,553,765 | | - |
| (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 | 9,120 | 9,632 | 257,383 | | 2023/01/25 |
| POLAND 5.75 04/25/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,800 | 2,469 | 65,980 | | 2029/04/25 |
| POLAND 2.75 04/25/28 | 国債証券 | 2.7500 | 5,790 | 6,428 | 171,780 | | 2028/04/25 |
| POLAND 2.25 04/25/22 | 国債証券 | 2.2500 | 4,840 | 5,029 | 134,397 | | 2022/04/25 |
| POLAND 2.5 04/25/24 | 国債証券 | 2.5000 | 4,850 | 5,210 | 139,229 | | 2024/04/25 |
| POLAND 2.5 07/25/26 | 国債証券 | 2.5000 | 6,060 | 6,594 | 176,209 | | 2026/07/25 |
| POLAND 3.25 07/25/25 | 国債証券 | 3.2500 | 7,180 | 8,057 | 215,296 | | 2025/07/25 |
| POLAND 2.5 07/25/27 | 国債証券 | 2.5000 | 6,230 | 6,791 | 181,476 | | 2027/07/25 |
| POLAND 0.7/25/22 | 国債証券 | - | 2,640 | 2,624 | 70,138 | | 2022/07/25 |
| POLAND 5.75 09/23/22 | 国債証券 | 5.7500 | 8,690 | 9,769 | 261,047 | | 2022/09/23 |
| POLAND 4.0 10/25/23 | 国債証券 | 4.0000 | 1,610 | 1,798 | 48,058 | | 2023/10/25 |
| POLAND 2.75 10/25/29 | 国債証券 | 2.7500 | 4,360 | 4,903 | 131,014 | | 2029/10/25 |
| POLAND 2.25 10/25/24 | 国債証券 | 2.2500 | 6,880 | 7,353 | 196,480 | | 2024/10/25 |
| 小計 | - | - | 70,050 | 76,665 | 2,048,493 | | - |
| (ユーロ…アイルランド) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| IRISH 2.0 02/18/45 | 国債証券 | 2.0000 | 1,400 | 1,880 | 224,517 | | 2045/02/18 |
| IRISH 1.35 03/18/31 | 国債証券 | 1.3500 | 1,180 | 1,344 | 160,438 | | 2031/03/18 |
| IRISH 3.4 03/18/24 | 国債証券 | 3.4000 | 1,210 | 1,383 | 165,180 | | 2024/03/18 |
| IRISH 5.4 03/13/25 | 国債証券 | 5.4000 | 1,030 | 1,312 | 156,673 | | 2025/03/13 |
| IRISH 3.9 03/20/23 | 国債証券 | 3.9000 | 1,400 | 1,568 | 187,273 | | 2023/03/20 |
| IRISH 0.8 03/15/22 | 国債証券 | 0.8000 | 620 | 634 | 75,704 | | 2022/03/15 |
| IRISH 1.5 05/15/50 | 国債証券 | 1.5000 | 770 | 943 | 112,676 | | 2050/05/15 |
| IRISH 1.3 05/15/33 | 国債証券 | 1.3000 | 800 | 916 | 109,395 | | 2033/05/15 |
| IRISH 2.4 05/15/30 | 国債証券 | 2.4000 | 1,680 | 2,078 | 248,154 | | 2030/05/15 |
| IRISH 0.9 05/15/28 | 国債証券 | 0.9000 | 1,970 | 2,131 | 254,394 | | 2028/05/15 |
| IRISH 1.0 05/15/26 | 国債証券 | 1.0000 | 1,700 | 1,827 | 218,152 | | 2026/05/15 |
| IRISH 1.7 05/15/37 | 国債証券 | 1.7000 | 1,130 | 1,380 | 164,784 | | 2037/05/15 |
| IRISH 0.4 05/15/35 | 国債証券 | 0.4000 | 2,770 | 2,817 | 336,308 | | 2035/05/15 |
| IRISH 0.2 05/15/27 | 国債証券 | 0.2000 | 570 | 584 | 69,829 | | 2027/05/15 |
| IRISH 10/18/22 | 国債証券 | 0.0000 | 1,000 | 1,011 | 120,780 | | 2022/10/18 |
| 小計 | - | - | 19,230 | 21,816 | 2,604,264 | | - |
| (ユーロ…オランダ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| NETHERLANDS 7.5 01/15/23 | 国債証券 | 7.5000 | 590 | 714 | 85,267 | | 2023/01/15 |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 国債証券 | 3.7500 | 2,310 | 4,193 | 500,597 | | 2042/01/15 |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 2,700 | 4,641 | 554,101 | | 2047/01/15 |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/23 | 国債証券 | 3.7500 | 1,670 | 1,859 | 221,953 | | 2023/01/15 |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28 | 国債証券 | 5.5000 | 3,020 | 4,393 | 524,415 | | 2028/01/15 |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37 | 国債証券 | 4.0000 | 2,260 | 3,803 | 454,006 | | 2037/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33 | 国債証券 | 2.5000 | 1,000 | 1,343 | 160,407 | | 2033/01/15 |
| NETHERLANDS 0.5 01/15/40 | 国債証券 | 0.5000 | 1,570 | 1,730 | 206,580 | | 2040/01/15 |
| NETHERLANDS 01/15/22 | 国債証券 | 0.0000 | 5,190 | 5,239 | 625,462 | | 2022/01/15 |

| 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 | |
| (ユーロ…オランダ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| NETHERLANDS 01/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 3,030 | 3,097 | 369,733 | 2024/01/15 | |
| NETHERLANDS 1.75 07/15/23 | 国債証券 | 1.7500 | 3,420 | 3,670 | 438,098 | 2023/07/15 | |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 520 | 551 | 65,886 | 2026/07/15 | |
| NETHERLANDS 2.25 07/15/22 | 国債証券 | 2.2500 | 850 | 901 | 107,572 | 2022/07/15 | |
| NETHERLANDS 2.0 07/15/24 | 国債証券 | 2.0000 | 3,600 | 3,986 | 475,867 | 2024/07/15 | |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | 国債証券 | 0.2500 | 2,630 | 2,739 | 327,008 | 2025/07/15 | |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/28 | 国債証券 | 0.7500 | 1,660 | 1,817 | 216,906 | 2028/07/15 | |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | 国債証券 | 0.7500 | 3,670 | 3,984 | 475,660 | 2027/07/15 | |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 3,250 | 3,424 | 408,807 | 2029/07/15 | |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 3,700 | 3,799 | 453,488 | 2030/07/15 | |
| 小計 | — | — | 46,640 | 55,891 | 6,671,821 | — | |
| (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 | 3,190 | 3,450 | 411,845 | 2022/03/28 | |
| BELGIUM 5.5 03/28/28 | 国債証券 | 5.5000 | 3,750 | 5,441 | 649,537 | 2028/03/28 | |
| BELGIUM 4.25 03/28/41 | 国債証券 | 4.2500 | 2,350 | 4,120 | 491,834 | 2041/03/28 | |
| BELGIUM 4.5 03/28/26 | 国債証券 | 4.5000 | 2,220 | 2,852 | 340,448 | 2026/03/28 | |
| BELGIUM 4.0 03/28/32 | 国債証券 | 4.0000 | 1,550 | 2,277 | 271,900 | 2032/03/28 | |
| BELGIUM 5.0 03/28/35 | 国債証券 | 5.0000 | 2,950 | 5,027 | 600,144 | 2035/03/28 | |
| BELGIUM 3.75 06/22/45 | 国債証券 | 3.7500 | 1,670 | 2,931 | 349,991 | 2045/06/22 | |
| BELGIUM 1.6 06/22/47 | 国債証券 | 1.6000 | 1,640 | 2,059 | 245,847 | 2047/06/22 | |
| BELGIUM 1.7 06/22/50 | 国債証券 | 1.7000 | 1,550 | 2,011 | 240,076 | 2050/06/22 | |
| BELGIUM 2.25 06/22/57 | 国債証券 | 2.2500 | 830 | 1,262 | 150,647 | 2057/06/22 | |
| BELGIUM 2.15 06/22/66 | 国債証券 | 2.1500 | 1,110 | 1,726 | 206,104 | 2066/06/22 | |
| BELGIUM 1.0 06/22/26 | 国債証券 | 1.0000 | 3,770 | 4,080 | 487,139 | 2026/06/22 | |
| BELGIUM 2.6 06/22/24 | 国債証券 | 2.6000 | 2,490 | 2,802 | 334,536 | 2024/06/22 | |
| BELGIUM 1.0 06/22/31 | 国債証券 | 1.0000 | 1,610 | 1,792 | 213,991 | 2031/06/22 | |
| BELGIUM 2.25 06/22/23 | 国債証券 | 2.2500 | 1,680 | 1,822 | 217,609 | 2023/06/22 | |
| BELGIUM 0.8 06/22/28 | 国債証券 | 0.8000 | 3,390 | 3,595 | 429,186 | 2028/06/22 | |
| BELGIUM 0.4 06/22/40 | 国債証券 | 0.4000 | 2,440 | 2,425 | 289,487 | 2040/06/22 | |
| BELGIUM 0.9 06/22/29 | 国債証券 | 0.9000 | 1,400 | 1,535 | 183,260 | 2029/06/22 | |
| BELGIUM 3.0 06/22/34 | 国債証券 | 3.0000 | 1,420 | 1,986 | 237,175 | 2034/06/22 | |
| BELGIUM 1.9 06/22/38 | 国債証券 | 1.9000 | 1,930 | 2,459 | 293,545 | 2038/06/22 | |
| BELGIUM 0.8 06/22/25 | 国債証券 | 0.8000 | 2,430 | 2,581 | 308,191 | 2025/06/22 | |
| BELGIUM 0.8 06/22/27 | 国債証券 | 0.8000 | 1,930 | 2,077 | 248,003 | 2027/06/22 | |
| BELGIUM 1.45 06/22/37 | 国債証券 | 1.4500 | 1,000 | 1,192 | 142,340 | 2037/06/22 | |
| BELGIUM 0.1 06/22/30 | 国債証券 | 0.1000 | 1,770 | 1,804 | 215,383 | 2030/06/22 | |
| BELGIUM 4.25 09/28/21 | 国債証券 | 4.2500 | 4,480 | 4,753 | 567,470 | 2021/09/28 | |
| BELGIUM 4.25 09/28/22 | 国債証券 | 4.2500 | 1,350 | 1,499 | 179,003 | 2022/09/28 | |
| BELGIUM 0.5 10/22/24 | 国債証券 | 0.5000 | 950 | 990 | 118,254 | 2024/10/22 | |
| BELGIUM 0.2 10/22/23 | 国債証券 | 0.2000 | 2,030 | 2,078 | 248,161 | 2023/10/22 | |
| 小計 | — | — | 58,880 | 72,640 | 8,671,119 | — | |
| (ユーロ…フランス) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| FRANCE OAT 02/25/22 | 国債証券 | 0.0000 | 2,810 | 2,837 | 338,733 | 2022/02/25 | |
| FRANCE OAT 03/25/24 | 国債証券 | 0.0000 | 10,170 | 10,380 | 1,239,158 | 2024/03/25 | |
| FRANCE OAT 03/25/25 | 国債証券 | 0.0000 | 3,610 | 3,694 | 441,062 | 2025/03/25 | |
| FRANCE OAT 03/25/23 | 国債証券 | 0.0000 | 4,330 | 4,399 | 525,158 | 2023/03/25 | |
| FRANCE BTAN 8.5 04/25/23 | 国債証券 | 8.5000 | 1,480 | 1,864 | 222,606 | 2023/04/25 | |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26 | 国債証券 | 3.5000 | 7,840 | 9,664 | 1,153,635 | 2026/04/25 | |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41 | 国債証券 | 4.5000 | 6,240 | 11,434 | 1,364,972 | 2041/04/25 | |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55 | 国債証券 | 4.0000 | 2,610 | 5,369 | 640,901 | 2055/04/25 | |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60 | 国債証券 | 4.0000 | 2,460 | 5,341 | 637,620 | 2060/04/25 | |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 国債証券 | 5.5000 | 7,440 | 11,252 | 1,343,267 | 2029/04/25 | |
| FRANCE OAT 3.0 04/25/22 | 国債証券 | 3.0000 | 13,130 | 14,004 | 1,671,705 | 2022/04/25 | |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 4,270 | 7,193 | 858,712 | 2035/04/25 | |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 4,320 | 7,133 | 851,553 | 2045/05/25 | |

| 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 | |
| | | | | 千ユーロ | 千円 | | |
| (ユーロ…フランス) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48 | 国債証券 | 2.0000 | 3,580 | 4,936 | 589,319 | 2048/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/50 | 国債証券 | 1.5000 | 4,480 | 5,616 | 670,436 | 2050/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/52 | 国債証券 | 0.7500 | 3,030 | 3,149 | 375,993 | 2052/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 国債証券 | 1.7500 | 2,070 | 2,947 | 351,896 | 2066/05/25 | |
| FRANCE OAT 2.25 05/25/24 | 国債証券 | 2.2500 | 8,220 | 9,133 | 1,090,291 | 2024/05/25 | |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 国債証券 | 2.5000 | 5,550 | 7,017 | 837,707 | 2030/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 4,850 | 5,246 | 626,222 | 2028/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31 | 国債証券 | 1.5000 | 7,930 | 9,308 | 1,111,201 | 2031/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25 | 国債証券 | 0.5000 | 7,840 | 8,230 | 982,474 | 2025/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29 | 国債証券 | 0.5000 | 6,690 | 7,115 | 849,381 | 2029/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34 | 国債証券 | 1.2500 | 3,360 | 3,895 | 465,041 | 2034/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26 | 国債証券 | 0.5000 | 12,820 | 13,530 | 1,615,127 | 2026/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27 | 国債証券 | 1.0000 | 6,120 | 6,693 | 799,018 | 2027/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/23 | 国債証券 | 1.7500 | 9,570 | 10,225 | 1,220,579 | 2023/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 国債証券 | 1.2500 | 6,030 | 7,021 | 838,136 | 2036/05/25 | |
| FRANCE OAT 05/25/22 | 国債証券 | 0.0000 | 5,500 | 5,564 | 664,177 | 2022/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39 | 国債証券 | 1.7500 | 5,110 | 6,478 | 773,351 | 2039/06/25 | |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/23 | 国債証券 | 4.2500 | 10,990 | 12,785 | 1,526,217 | 2023/10/25 | |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25 | 国債証券 | 6.0000 | 2,220 | 2,998 | 357,912 | 2025/10/25 | |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 国債証券 | 2.7500 | 4,800 | 5,901 | 704,415 | 2027/10/25 | |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38 | 国債証券 | 4.0000 | 5,170 | 8,637 | 1,031,061 | 2038/10/25 | |
| FRANCE OAT 3.25 10/25/21 | 国債証券 | 3.2500 | 4,090 | 4,301 | 513,412 | 2021/10/25 | |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 国債証券 | 5.7500 | 5,120 | 8,780 | 1,048,117 | 2032/10/25 | |
| FRANCE OAT 2.25 10/25/22 | 国債証券 | 2.2500 | 5,090 | 5,431 | 648,406 | 2022/10/25 | |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25 | 国債証券 | 1.0000 | 8,080 | 8,727 | 1,041,744 | 2025/11/25 | |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26 | 国債証券 | 0.2500 | 2,630 | 2,737 | 326,732 | 2026/11/25 | |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 6,690 | 7,252 | 865,751 | 2028/11/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29 | 国債証券 | 0.0000 | 8,900 | 9,032 | 1,078,197 | 2029/11/25 | |
| 小計 | — | — | 237,240 | 287,269 | 34,291,413 | — | |
| (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 | 1,180 | 1,473 | 175,889 | 2024/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 国債証券 | 5.6250 | 3,440 | 5,073 | 605,572 | 2028/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | 国債証券 | 6.2500 | 1,400 | 2,320 | 276,941 | 2030/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 | 国債証券 | 5.5000 | 4,320 | 7,074 | 844,438 | 2031/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | 国債証券 | 4.0000 | 4,750 | 8,146 | 972,495 | 2037/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22 | 国債証券 | 2.0000 | 8,030 | 8,364 | 998,493 | 2022/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 | 国債証券 | 0.5000 | 4,750 | 5,013 | 598,402 | 2025/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 6,250 | 6,663 | 795,444 | 2026/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 6,990 | 7,466 | 891,331 | 2029/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 5,050 | 5,347 | 638,353 | 2023/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 2,040 | 2,211 | 263,979 | 2028/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24 | 国債証券 | 1.7500 | 4,200 | 4,579 | 546,646 | 2024/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27 | 国債証券 | 0.2500 | 4,240 | 4,490 | 536,030 | 2027/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 1,350 | 1,409 | 168,307 | 2030/02/15 | |
| BUNDESSCHAT 0.0 03/11/22 | 国債証券 | 0.0000 | 3,000 | 3,033 | 362,113 | 2022/03/11 | |
| BUNDESUBL 04/08/22 | 国債証券 | 0.0000 | 3,300 | 3,339 | 398,659 | 2022/04/08 | |
| BUNDESUBL 04/14/23 | 国債証券 | 0.0000 | 2,960 | 3,018 | 360,366 | 2023/04/14 | |
| BUNDESUBL 04/05/24 | 国債証券 | 0.0000 | 5,380 | 5,520 | 659,020 | 2024/04/05 | |
| BUNDESUBL 0.0 04/11/25 | 国債証券 | 0.0000 | 2,000 | 2,064 | 246,418 | 2025/04/11 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24 | 国債証券 | 1.5000 | 5,000 | 5,431 | 648,322 | 2024/05/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 8,090 | 8,610 | 1,027,856 | 2023/05/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35 | 国債証券 | 0.0000 | 2,000 | 2,067 | 246,818 | 2035/05/15 | |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27 | 国債証券 | 6.5000 | 1,670 | 2,519 | 300,811 | 2027/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 国債証券 | 4.7500 | 1,800 | 2,580 | 308,066 | 2028/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 3,150 | 5,850 | 698,354 | 2039/07/04 | |

| 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 | |
| (ユーロ…ドイツ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 3,530 | 6,192 | 739,228 | 2042/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 | 国債証券 | 2.5000 | 4,660 | 7,582 | 905,080 | 2044/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国債証券 | 4.7500 | 2,730 | 5,470 | 652,969 | 2040/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22 | 国債証券 | 1.7500 | 4,380 | 4,597 | 548,763 | 2022/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国債証券 | 4.7500 | 2,520 | 4,355 | 519,972 | 2034/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 5,810 | 9,697 | 1,157,624 | 2046/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 国債証券 | 1.2500 | 3,930 | 5,324 | 635,557 | 2048/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25 | 国債証券 | 1.0000 | 4,870 | 5,294 | 631,948 | 2025/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 5,360 | 5,789 | 691,142 | 2027/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 08/15/26 | 国債証券 | 0.0000 | 5,690 | 5,917 | 706,394 | 2026/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 5,940 | 6,335 | 756,316 | 2028/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 3,880 | 4,212 | 502,843 | 2023/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24 | 国債証券 | 1.0000 | 3,100 | 3,319 | 396,192 | 2024/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 08/15/29 | 国債証券 | 0.0000 | 5,620 | 5,876 | 701,431 | 2029/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50 | 国債証券 | 0.0000 | 780 | 776 | 92,658 | 2050/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22 | 国債証券 | 1.5000 | 3,300 | 3,461 | 413,151 | 2022/09/04 | |
| BUNDESSCHAT 0.0 09/10/21 | 国債証券 | 0.0000 | 1,070 | 1,078 | 128,725 | 2021/09/10 | |
| BUNDESUBL 10/18/24 | 国債証券 | 0.0000 | 4,040 | 4,158 | 496,344 | 2024/10/18 | |
| BUNDESUBL 10/08/21 | 国債証券 | 0.0000 | 3,400 | 3,428 | 409,218 | 2021/10/08 | |
| BUNDESUBL 10/07/22 | 国債証券 | 0.0000 | 3,000 | 3,047 | 363,736 | 2022/10/07 | |
| BUNDESUBL 10/13/23 | 国債証券 | 0.0000 | 4,800 | 4,910 | 586,217 | 2023/10/13 | |
| BUNDESSCHAT 0.0 12/10/21 | 国債証券 | 0.0000 | 40 | 40 | 4,821 | 2021/12/10 | |
| 小計 | - | - | 178,790 | 214,538 | 25,609,478 | - | |
| (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 | 4,160 | 4,579 | 546,625 | 2022/01/31 | |
| SPAIN 6.0 01/31/29 | 国債証券 | 6.0000 | 3,500 | 5,188 | 619,345 | 2029/01/31 | |
| SPAIN 4.8 01/31/24 | 国債証券 | 4.8000 | 3,000 | 3,546 | 423,372 | 2024/01/31 | |
| SPAIN 4.2 01/31/37 | 国債証券 | 4.2000 | 4,460 | 6,776 | 808,954 | 2037/01/31 | |
| SPAIN 5.4 01/31/23 | 国債証券 | 5.4000 | 3,740 | 4,298 | 513,116 | 2023/01/31 | |
| SPAIN 1.6 04/30/25 | 国債証券 | 1.6000 | 1,810 | 1,959 | 233,941 | 2025/04/30 | |
| SPAIN 3.8 04/30/24 | 国債証券 | 3.8000 | 5,600 | 6,469 | 772,277 | 2024/04/30 | |
| SPAIN 1.5 04/30/27 | 国債証券 | 1.5000 | 3,700 | 4,046 | 483,009 | 2027/04/30 | |
| SPAIN 1.95 04/30/26 | 国債証券 | 1.9500 | 5,990 | 6,674 | 796,750 | 2026/04/30 | |
| SPAIN 1.4 04/30/28 | 国債証券 | 1.4000 | 2,010 | 2,192 | 261,715 | 2028/04/30 | |
| SPAIN 1.45 04/30/29 | 国債証券 | 1.4500 | 5,320 | 5,834 | 696,472 | 2029/04/30 | |
| SPAIN 0.4 04/30/22 | 国債証券 | 0.4000 | 3,300 | 3,349 | 399,782 | 2022/04/30 | |
| SPAIN 0.5 04/30/30 | 国債証券 | 0.5000 | 2,530 | 2,549 | 304,275 | 2030/04/30 | |
| SPAIN 0.0 04/30/23 | 国債証券 | 0.0000 | 1,860 | 1,873 | 223,604 | 2023/04/30 | |
| SPAIN 5.9 07/30/26 | 国債証券 | 5.9000 | 4,440 | 6,025 | 719,210 | 2026/07/30 | |
| SPAIN 4.9 07/30/40 | 国債証券 | 4.9000 | 2,300 | 3,920 | 467,972 | 2040/07/30 | |
| SPAIN 4.7 07/30/41 | 国債証券 | 4.7000 | 3,800 | 6,425 | 767,035 | 2041/07/30 | |
| SPAIN 3.45 07/30/66 | 国債証券 | 3.4500 | 1,960 | 3,198 | 381,792 | 2066/07/30 | |
| SPAIN 4.65 07/30/25 | 国債証券 | 4.6500 | 4,820 | 5,985 | 714,468 | 2025/07/30 | |
| SPAIN 1.95 07/30/30 | 国債証券 | 1.9500 | 2,620 | 3,009 | 359,293 | 2030/07/30 | |
| SPAIN 5.75 07/30/32 | 国債証券 | 5.7500 | 4,820 | 7,738 | 923,731 | 2032/07/30 | |
| SPAIN 2.35 07/30/33 | 国債証券 | 2.3500 | 3,400 | 4,109 | 490,601 | 2033/07/30 | |
| SPAIN 1.4 07/30/28 | 国債証券 | 1.4000 | 2,460 | 2,683 | 320,313 | 2028/07/30 | |
| SPAIN 1.85 07/30/35 | 国債証券 | 1.8500 | 2,770 | 3,183 | 379,995 | 2035/07/30 | |
| SPAIN 0.25 07/30/24 | 国債証券 | 0.2500 | 2,450 | 2,493 | 297,606 | 2024/07/30 | |
| SPAIN 0.35 07/30/23 | 国債証券 | 0.3500 | 3,300 | 3,361 | 401,312 | 2023/07/30 | |
| SPAIN 2.75 10/31/24 | 国債証券 | 2.7500 | 3,930 | 4,428 | 528,640 | 2024/10/31 | |
| SPAIN 5.15 10/31/28 | 国債証券 | 5.1500 | 4,410 | 6,173 | 736,885 | 2028/10/31 | |
| SPAIN 5.15 10/31/44 | 国債証券 | 5.1500 | 2,440 | 4,499 | 537,119 | 2044/10/31 | |
| SPAIN 2.9 10/31/46 | 国債証券 | 2.9000 | 2,990 | 4,120 | 491,878 | 2046/10/31 | |
| SPAIN 2.7 10/31/48 | 国債証券 | 2.7000 | 3,230 | 4,334 | 517,402 | 2048/10/31 | |

| 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 | |
| (ユーロ…スペイン) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| SPAIN 1.0 10/31/50 | 国債証券 | 1.0000 | 690 | 638 | 76,221 | 2050/10/31 | |
| SPAIN 2.15 10/31/25 | 国債証券 | 2.1500 | 4,650 | 5,196 | 620,347 | 2025/10/31 | |
| SPAIN 1.45 10/31/27 | 国債証券 | 1.4500 | 6,450 | 7,039 | 840,304 | 2027/10/31 | |
| SPAIN 0.6 10/31/29 | 国債証券 | 0.6000 | 4,720 | 4,819 | 575,252 | 2029/10/31 | |
| SPAIN 4.4 10/31/23 | 国債証券 | 4.4000 | 4,080 | 4,721 | 563,623 | 2023/10/31 | |
| SPAIN 0.05 10/31/21 | 国債証券 | 0.0500 | 6,080 | 6,115 | 729,960 | 2021/10/31 | |
| SPAIN 0.45 10/31/22 | 国債証券 | 0.4500 | 3,040 | 3,098 | 369,864 | 2022/10/31 | |
| SPAIN 1.25 10/31/30 | 国債証券 | 1.2500 | 2,000 | 2,151 | 256,764 | 2030/10/31 | |
| 小計 | — | — | 138,830 | 168,809 | 20,150,842 | — | |
| (ユーロ…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| ITALY BTPS 0.85 01/15/27 | 国債証券 | 0.8500 | 2,000 | 1,980 | 236,436 | 2027/01/15 | |
| ITALY BTPS 0.05 01/15/23 | 国債証券 | 0.0500 | 3,180 | 3,166 | 378,025 | 2023/01/15 | |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 6,440 | 9,446 | 1,127,668 | 2033/02/01 | |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37 | 国債証券 | 4.0000 | 4,390 | 5,683 | 678,467 | 2037/02/01 | |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 3,290 | 3,501 | 417,950 | 2028/02/01 | |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47 | 国債証券 | 2.7000 | 3,340 | 3,650 | 435,814 | 2047/03/01 | |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 国債証券 | 3.4500 | 2,150 | 2,665 | 318,162 | 2048/03/01 | |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/24 | 国債証券 | 4.5000 | 3,500 | 4,010 | 478,741 | 2024/03/01 | |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67 | 国債証券 | 2.8000 | 1,600 | 1,725 | 205,927 | 2067/03/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/25 | 国債証券 | 5.0000 | 8,750 | 10,485 | 1,251,613 | 2025/03/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/22 | 国債証券 | 5.0000 | 4,810 | 5,214 | 622,399 | 2022/03/01 | |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26 | 国債証券 | 4.5000 | 3,500 | 4,202 | 501,646 | 2026/03/01 | |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 国債証券 | 1.6500 | 4,320 | 4,395 | 524,725 | 2032/03/01 | |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40 | 国債証券 | 3.1000 | 2,130 | 2,495 | 297,869 | 2040/03/01 | |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 国債証券 | 3.3500 | 3,370 | 4,055 | 484,065 | 2035/03/01 | |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 国債証券 | 3.5000 | 4,660 | 5,578 | 665,852 | 2030/03/01 | |
| ITALY BTPS 0.95 03/15/23 | 国債証券 | 0.9500 | 2,700 | 2,752 | 328,583 | 2023/03/15 | |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/23 | 国債証券 | 0.9500 | 5,000 | 5,094 | 608,118 | 2023/03/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 国債証券 | 1.4500 | 3,070 | 2,937 | 350,634 | 2036/03/01 | |
| ITALY BTPS 1.35 04/15/22 | 国債証券 | 1.3500 | 3,000 | 3,067 | 366,121 | 2022/04/15 | |
| ITALY BTPS 1.2 04/01/22 | 国債証券 | 1.2000 | 2,700 | 2,753 | 328,661 | 2022/04/01 | |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 国債証券 | 1.3500 | 4,220 | 4,233 | 505,404 | 2030/04/01 | |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31 | 国債証券 | 6.0000 | 4,300 | 6,247 | 745,811 | 2031/05/01 | |
| ITALY BTPS 4.5 05/01/23 | 国債証券 | 4.5000 | 4,430 | 4,961 | 592,239 | 2023/05/01 | |
| ITALY BTPS 1.85 05/15/24 | 国債証券 | 1.8500 | 2,800 | 2,940 | 350,981 | 2024/05/15 | |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26 | 国債証券 | 1.6000 | 3,300 | 3,436 | 410,229 | 2026/06/01 | |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25 | 国債証券 | 1.5000 | 2,550 | 2,644 | 315,635 | 2025/06/01 | |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27 | 国債証券 | 2.2000 | 2,500 | 2,693 | 321,552 | 2027/06/01 | |
| ITALY BTPS 0.6 06/15/23 | 国債証券 | 0.6000 | 2,000 | 2,017 | 240,840 | 2023/06/15 | |
| ITALY BTPS 2.1 07/15/26 | 国債証券 | 2.1000 | 90 | 96 | 11,478 | 2026/07/15 | |
| ITALY BTPS 1.75 07/01/24 | 国債証券 | 1.7500 | 4,140 | 4,333 | 517,269 | 2024/07/01 | |
| ITALY BTPS 1.0 07/15/22 | 国債証券 | 1.0000 | 3,050 | 3,104 | 370,604 | 2022/07/15 | |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34 | 国債証券 | 5.0000 | 1,800 | 2,530 | 302,101 | 2034/08/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39 | 国債証券 | 5.0000 | 2,660 | 3,918 | 467,808 | 2039/08/01 | |
| ITALY BTPS 4.75 08/01/23 | 国債証券 | 4.7500 | 2,240 | 2,544 | 303,780 | 2023/08/01 | |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 5,700 | 6,081 | 725,903 | 2027/08/01 | |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29 | 国債証券 | 3.0000 | 4,400 | 5,061 | 604,136 | 2029/08/01 | |
| ITALY BTPS 0.9 08/01/22 | 国債証券 | 0.9000 | 3,000 | 3,047 | 363,803 | 2022/08/01 | |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国債証券 | 2.9500 | 2,130 | 2,427 | 289,752 | 2038/09/01 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | 4.7500 | 2,590 | 3,815 | 455,468 | 2044/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | 3.2500 | 3,850 | 4,606 | 549,932 | 2046/09/01 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | 4.7500 | 4,840 | 6,190 | 738,927 | 2028/09/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40 | 国債証券 | 5.0000 | 2,910 | 4,297 | 512,991 | 2040/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 国債証券 | 2.4500 | 2,210 | 2,274 | 271,537 | 2050/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | 2.4500 | 3,650 | 3,998 | 477,330 | 2033/09/01 | |

| 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 | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | | |
| ITALY BTPS 3.75 09/01/24 | 国債証券 | 3.7500 | 千ユーロ 6,380 | 千ユーロ 7,204 | 千円 859,955 | 2024/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 国債証券 | 3.8500 | 960 | 1,273 | 151,983 | 2049/09/01 | |
| ITALY BTPS 5.5 09/01/22 | 国債証券 | 5.5000 | 2,960 | 3,306 | 394,688 | 2022/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 2,400 | 2,549 | 304,336 | 2036/09/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 09/15/22 | 国債証券 | 1.4500 | 4,140 | 4,257 | 508,196 | 2022/09/15 | |
| ITALY BTPS 0.65 10/15/23 | 国債証券 | 0.6500 | 1,870 | 1,888 | 225,469 | 2023/10/15 | |
| ITALY BTPS 2.3 10/15/21 | 国債証券 | 2.3000 | 3,300 | 3,403 | 406,220 | 2021/10/15 | |
| ITALY BTPS 2.45 10/01/23 | 国債証券 | 2.4500 | 3,030 | 3,235 | 386,212 | 2023/10/01 | |
| ITALY BTPS 9.0 11/01/23 | 国債証券 | 9.0000 | 1,700 | 2,188 | 261,250 | 2023/11/01 | |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 国債証券 | 7.2500 | 2,150 | 2,982 | 356,018 | 2026/11/01 | |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27 | 国債証券 | 6.5000 | 3,400 | 4,685 | 559,272 | 2027/11/01 | |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 国債証券 | 5.2500 | 2,850 | 3,839 | 458,323 | 2029/11/01 | |
| ITALY BTPS 5.5 11/01/22 | 国債証券 | 5.5000 | 3,200 | 3,597 | 429,422 | 2022/11/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 11/15/24 | 国債証券 | 1.4500 | 2,800 | 2,899 | 346,135 | 2024/11/15 | |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25 | 国債証券 | 2.5000 | 3,430 | 3,732 | 445,560 | 2025/11/15 | |
| ITALY BTPS 0.35 11/01/21 | 国債証券 | 0.3500 | 5,800 | 5,832 | 696,239 | 2021/11/01 | |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25 | 国債証券 | 2.0000 | 2,900 | 3,082 | 368,007 | 2025/12/01 | |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 国債証券 | 1.2500 | 3,500 | 3,565 | 425,621 | 2026/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 5,290 | 5,712 | 681,959 | 2024/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28 | 国債証券 | 2.8000 | 10,110 | 11,415 | 1,362,634 | 2028/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.15 12/15/21 | 国債証券 | 2.1500 | 2,010 | 2,074 | 247,673 | 2021/12/15 | |
| 小計 | — | — | 227,440 | 259,095 | 30,928,195 | — | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | | | | | |
| FINLAND 2.0 04/15/24 | 国債証券 | 2.0000 | 千ユーロ 1,200 | 千ユーロ 1,319 | 千円 157,531 | 2024/04/15 | |
| FINLAND 0.75 04/15/31 | 国債証券 | 0.7500 | 610 | 671 | 80,153 | 2031/04/15 | |
| FINLAND 1.375 04/15/47 | 国債証券 | 1.3750 | 760 | 990 | 118,244 | 2047/04/15 | |
| FINLAND 0.5 04/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 520 | 549 | 65,576 | 2026/04/15 | |
| FINLAND 1.125 04/15/34 | 国債証券 | 1.1250 | 1,510 | 1,746 | 208,530 | 2034/04/15 | |
| FINLAND 1.5 04/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 890 | 942 | 112,523 | 2023/04/15 | |
| FINLAND 04/15/22 | 国債証券 | 0.0000 | 610 | 616 | 73,609 | 2022/04/15 | |
| FINLAND 0.125 04/15/36 | 国債証券 | 0.1250 | 360 | 363 | 43,423 | 2036/04/15 | |
| FINLAND 4.0 07/04/25 | 国債証券 | 4.0000 | 1,440 | 1,773 | 211,659 | 2025/07/04 | |
| FINLAND 2.75 07/04/28 | 国債証券 | 2.7500 | 1,180 | 1,474 | 176,024 | 2028/07/04 | |
| FINLAND 2.625 07/04/42 | 国債証券 | 2.6250 | 950 | 1,464 | 174,859 | 2042/07/04 | |
| FINLAND 0.5 09/15/29 | 国債証券 | 0.5000 | 880 | 940 | 112,286 | 2029/09/15 | |
| FINLAND 0.875 09/15/25 | 国債証券 | 0.8750 | 780 | 836 | 99,867 | 2025/09/15 | |
| FINLAND 0.5 09/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 300 | 319 | 38,193 | 2028/09/15 | |
| FINLAND 0.5 09/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 1,160 | 1,232 | 147,182 | 2027/09/15 | |
| FINLAND 1.625 09/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 780 | 819 | 97,774 | 2022/09/15 | |
| FINLAND 09/15/23 | 国債証券 | 0.0000 | 470 | 478 | 57,169 | 2023/09/15 | |
| FINLAND 0.0 09/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 350 | 358 | 42,754 | 2024/09/15 | |
| 小計 | — | — | 14,750 | 16,900 | 2,017,364 | — | |
| (ユーロ…オーストリア) | | | | | | | |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62 | 国債証券 | 3.8000 | 千ユーロ 660 | 千ユーロ 1,508 | 千円 180,026 | 2062/01/26 | |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47 | 国債証券 | 1.5000 | 1,450 | 1,898 | 226,609 | 2047/02/20 | |
| AUSTRIA 0.5 02/20/29 | 国債証券 | 0.5000 | 2,840 | 3,026 | 361,316 | 2029/02/20 | |
| AUSTRIA 0.75 02/20/28 | 国債証券 | 0.7500 | 1,000 | 1,082 | 129,243 | 2028/02/20 | |
| AUSTRIA 0.0 02/20/30 | 国債証券 | 0.0000 | 440 | 447 | 53,469 | 2030/02/20 | |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26 | 国債証券 | 4.8500 | 1,700 | 2,225 | 265,647 | 2026/03/15 | |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 国債証券 | 4.1500 | 2,420 | 4,046 | 482,999 | 2037/03/15 | |
| AUSTRIA 0.75 03/20/51 | 国債証券 | 0.7500 | 760 | 847 | 101,199 | 2051/03/20 | |
| AUSTRIA 0.5 04/20/27 | 国債証券 | 0.5000 | 2,300 | 2,440 | 291,360 | 2027/04/20 | |
| AUSTRIA 0.0 04/20/23 | 国債証券 | 0.0000 | 1,000 | 1,016 | 121,306 | 2023/04/20 | |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34 | 国債証券 | 2.4000 | 1,890 | 2,516 | 300,408 | 2034/05/23 | |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 国債証券 | 3.1500 | 980 | 1,652 | 197,270 | 2044/06/20 | |

| 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 | |
| (ユーロ…オーストリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 国債証券 | 6.2500 | 1,160 | 1,705 | 203,584 | 2027/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/23 | 国債証券 | 0.0000 | 850 | 864 | 103,224 | 2023/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 2,670 | 2,729 | 325,831 | 2024/07/15 |
| AUSTRIA 3.5 09/15/21 | 国債証券 | 3.5000 | 4,840 | 5,081 | 606,580 | 2021/09/15 |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17 | 国債証券 | 2.1000 | 920 | 1,791 | 213,823 | 2117/09/20 |
| AUSTRIA 1.65 10/21/24 | 国債証券 | 1.6500 | 1,990 | 2,183 | 260,637 | 2024/10/21 |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 国債証券 | 0.7500 | 1,150 | 1,236 | 147,585 | 2026/10/20 |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25 | 国債証券 | 1.2000 | 1,470 | 1,604 | 191,533 | 2025/10/20 |
| AUSTRIA 1.75 10/20/23 | 国債証券 | 1.7500 | 870 | 938 | 111,989 | 2023/10/20 |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86 | 国債証券 | 1.5000 | 400 | 594 | 70,996 | 2086/11/02 |
| AUSTRIA 3.4 11/22/22 | 国債証券 | 3.4000 | 2,460 | 2,699 | 322,278 | 2022/11/22 |
| 小計 | — | — | 36,220 | 44,139 | 5,268,925 | — |
| 合計 | — | — | — | — | 339,429,470 | — |

■投資信託財産の構成

2020年6月22日現在

| 項目 | 当期 | | 末 |
|--------------|-------------|-------|---|
| | 評価額 | 比率 | |
| 公社債 | 千円 | % | |
| コール・ローン等、その他 | 339,429,470 | 97.4 | |
| 投資信託財産総額 | 8,905,596 | 2.6 | |
| | 348,335,066 | 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、332,599,241千円、95.5%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、2020年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.77円、1カナダ・ドル=78.37円、1オーストラリア・ドル=72.86円、1シンガポール・ドル=76.38円、1イギリス・ポンド=131.78円、1イスラエル・シェケル=30.91円、1デンマーク・クローネ=16.01円、1ノルウェー・クローネ=11.05円、1スウェーデン・クローナ=11.28円、1メキシコ・ペソ=4.72円、1マレーシア・リングギット=24.96円、1ポーランド・ズロチ=26.72円、1ユーロ=119.37円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月22日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産 | 701,472,219,144円 |
| コ ー ル ・ 公 社 債(評価額) | 4,346,338,416 |
| 未 収 入 金 | 339,429,470,073 |
| 未 収 利 息 | 355,602,829,692 |
| 前 払 費 用 | 1,728,853,325 |
| (B) 負 債 | 364,138,906,795 |
| 未 払 金 | 364,127,483,795 |
| 未 払 解 約 金 | 11,423,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 337,333,312,349 |
| 元 本 | 230,136,350,831 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 107,196,961,518 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 230,136,350,831口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 14,658円 |

(注1) 期首元本額 327,518,238,620円
 追加設定元本額 372,741,135,596円
 一部解約元本額 470,123,023,385円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|-------------------------------------|-----------------|
| たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり> | 4,983,783,965円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 225,731,910円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 539,927,280円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 248,963,737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) | 11,596,633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) | 467,334,517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) | 480,337,957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) | 114,574,770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) | 16,420,708円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 3,363,911円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 6,566,503円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 12,882,283円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 3,354,359円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 2,675,587円 |
| 投資のソムリエ | 81,297,161,086円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 7,880,337,302円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 6,151,910,141円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 57,262,511,436円 |
| ワールドアセットバランス (基本コース) | 3,425,326,635円 |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 2,310,540,584円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) | 64,579,720円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) | 37,901,657円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 59,725,579円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) | 142,207,741円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 24,972,939,068円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 3,121,493,462円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) | 18,373,264円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) | 7,480,327円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) | 8,102,360円 |
| 外国債券パッシブファンド2 (為替フルヘッジ) (適格機関投資家限定) | 19,976,339,042円 |
| 先進国債券パッシブファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定) | 5,943,085,380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) | 530,035,974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) | 60,913,162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) | 428,836,613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) | 966,109,573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) | 1,102,111,668円 |
| DIAMバランス20VA (適格機関投資家限定) | 17,897,159円 |
| DIAM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) | 2,045,914,615円 |
| DIAM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) | 2,183,735,880円 |
| DIAM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) | 2,887,293,805円 |
| DIAM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) | 115,973,478円 |
| 期末元本合計 | 230,136,350,831円 |

■損益の状況

当期 自2019年6月25日 至2020年6月22日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 9,339,834,419円 |
| 受 取 利 息 | 9,344,843,727 |
| そ の 他 収 益 金 | 70,369 |
| 支 払 利 息 | △5,079,677 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 15,747,720,457 |
| 売 買 益 | 72,957,092,108 |
| 売 買 損 | △57,209,371,651 |
| (C) そ の 他 費 用 | △43,341,345 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 25,044,213,531 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 127,340,088,329 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △205,679,366,746 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 160,492,026,404 |
| (H) 合 計(D + E + F + G) | 107,196,961,518 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 107,196,961,518 |

(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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第13期（決算日 2020年6月22日）

（対象期間 2019年6月25日～2020年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 | 純資産額 総 |
|-----------------|--------|-------|---|-------|-------------------------------|---------------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | |
| 9期(2016年6月22日) | 10,906 | △5.6 | 108,051.29 | △4.8 | 99.6 | 百万円 32,918 |
| 10期(2017年6月22日) | 11,770 | 7.9 | 117,262.55 | 8.5 | 99.7 | 43,023 |
| 11期(2018年6月22日) | 11,979 | 1.8 | 120,101.82 | 2.4 | 99.3 | 53,148 |
| 12期(2019年6月24日) | 13,060 | 9.0 | 131,885.51 | 9.8 | 99.2 | 47,410 |
| 13期(2020年6月22日) | 10,922 | △16.4 | 111,241.50 | △15.7 | 99.7 | 34,753 |

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

（注2）S & P 先進国 REIT インデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ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）。

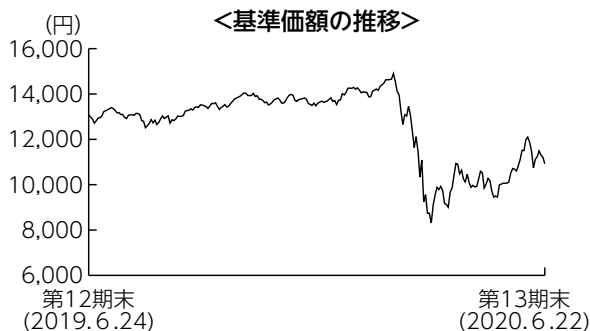
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

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

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2019年6月25日から2020年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,922円となり、前期末比で16.4%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で15.7%下落しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.7%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------|------|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 | 4円 | 0.029% |
| (株 式) | (0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券) | (1) | (0.004) |
| (投 資 証 券) | (3) | (0.025) |
| (b) 有価証券取引税 | 11 | 0.089 |
| (株 式) | (0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券) | (1) | (0.007) |
| (投 資 証 券) | (10) | (0.082) |
| (c) その他費用 | 11 | 0.089 |
| (保 管 費 用) | (8) | (0.065) |
| (そ の 他) | (3) | (0.023) |
| 合 計 | 26 | 0.206 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(12,607円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2019年6月25日から2020年6月22日まで)

(1) 株 式

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

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、増資割当、株式転換・合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 投資信託受益証券、投資証券

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------|----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 73.928 | 11,463 | 76.572 | 11,808 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER'S INC. | 1.125 | 358 | 1.873 | 627 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | 86.436 | 10,458 | 98.391 | 12,783 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CEDAR REALTY TRUST INC | - | - | 13.618 | 28 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 131.917 | 4,969 | 139.652 | 5,500 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 88.054 | 4,207 | 95.639 | 4,844 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AGREE REALTY CORP | 29.369 | 2,060 | 26.556 | 1,922 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRT APARTMENTS CORP | 2.662 | 23 | 1.643 | 20 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SL GREEN | 49.19 | 3,623 | 56.479 | 4,490 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EPR PROPERTIES | 45.41 | 2,713 | 49.043 | 3,192 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PROLOGIS INC | 408.022 | 36,004 | 440.532 | 37,743 |
| | (29.908) | (-) | (-) | (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 83.024 | 16,378 | 90.526 | 18,837 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 162.849 | 1,717 | 157.874 | 1,643 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 57.666 | 5,939 | 63.038 | 6,779 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CBL & ASSOCIATES | 23.633 | 35 | 56.01 | 27 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MACK CALI | 49.145 | 971 | 53.629 | 1,130 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUINIX INC | 70.773 | 42,253 | 44.549 | 26,556 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 100.587 | 4,881 | 106.58 | 5,673 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COUSINS PROPERTIES INC | 88.188 | 3,112 | 96.175 | 3,535 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 12.153 | 228 | 13.988 | 292 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SITE CENTERS CORP | 84.8 | 987 | 89.542 | 1,180 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DUKE REALTY TRUST | 218.861 | 7,514 | 236.704 | 7,988 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | - | - | 16.616 | 16 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 39.249 | 11,570 | 43.183 | 13,034 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|------------------------------|-----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| EQUITY RESIDENTIAL | 210.388 | 16,421 | 237.678 | 19,153 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 42.161 | 4,821 | 47.542 | 5,932 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 76.565 | 3,005 | 83.109 | 3,281 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 306.271 | 9,782 | 316.293 | 10,581 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY COMMONWEALTH | 72 | 2,376 | 78.964 | 2,535 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 82.569 | 2,690 | 86.449 | 2,936 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 61.61 | 2,662 | 66.887 | 3,049 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 96.829 | 1,819 | 104.784 | 2,192 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WELLTOWER INC | 250.339 | 18,654 | 263.961 | 20,978 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EAST GROUP | 22.447 | 2,763 | 23.745 | 2,991 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIMCO REALTY | 250.151 | 4,212 | 273.213 | 5,095 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KILROY REALTY CORP | 61.466 | 4,563 | 65.772 | 5,075 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LTC PROPERTIES INC | 21.849 | 958 | 24.506 | 1,130 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 119.252 | 781 | 129.607 | 945 |
| | (-) | (△20) | (-) | (-) |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 55.618 | 766 | 60.721 | 856 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 46.169 | 2,455 | 54.232 | 2,981 |
| | (△44.309) | (-) | (-) | (-) |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 100.925 | 1,368 | 113.101 | 1,614 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | 169.513 | 5,100 | 185.077 | 5,762 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE MACERICH COMPANY | 63.048 | 1,331 | 66.591 | 1,646 |
| | (1.071) | (7) | (-) | (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 87.478 | 7,192 | 98.056 | 8,140 |
| | (32.371) | (-) | (-) | (-) |
| ACADIA REALTY TRUST | 47.569 | 1,067 | 51.181 | 1,271 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 434.49 | 6,517 | 488.254 | 7,647 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MID AMERICA | 67.88 | 8,583 | 74.2 | 9,722 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 9.498 | 79 | 10.813 | 130 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 25.284 | 1,861 | 27.542 | 2,205 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|------------------------------|----------------|---------------|----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 5.235 (-) | 354 (-) | 6.222 (-) | 434 (-) |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 6.257 (-) | 134 (-) | 5.415 (-) | 133 (-) |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 12.862 (-) | 72 (-) | 22.034 (-) | 66 (-) |
| GETTY REALTY CORP | 19.05 (-) | 567 (-) | 21.286 (-) | 640 (-) |
| PS BUSINESS PARKS | 11.546 (-) | 1,867 (-) | 12.745 (-) | 2,099 (-) |
| RPT REALTY | 40.466 (-) | 433 (-) | 42.706 (-) | 549 (-) |
| REALTY INCOME CORP | 202.236 (-) | 13,940 (-) | 208.241 (-) | 15,454 (-) |
| REGENCY CENTERS CORP | 98.518 (-) | 5,651 (-) | 107.912 (-) | 6,701 (-) |
| UDR INC | 173.701 (-) | 7,815 (-) | 184.094 (-) | 8,613 (-) |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 65.084 (-) | 1,825 (-) | 71.223 (-) | 1,979 (-) |
| CORECIVIC INC | 65.815 (-) | 976 (-) | 71.543 (-) | 1,121 (-) |
| SAUL CENTERS INC | 4.939 (-) | 208 (-) | 5.572 (-) | 250 (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 184.467 (-) | 21,981 (-) | 202.343 (-) | 27,263 (-) |
| LIFE STORAGE INC | 28.387 (-) | 2,908 (-) | 30.792 (-) | 3,293 (-) |
| PUBLIC STORAGE | 89.863 (-) | 20,060 (-) | 97.998 (-) | 22,163 (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 57.468 (-) | 8,396 (-) | 58.908 (-) | 9,011 (-) |
| TAUBMAN CENTERS INC | 35.202 (-) | 1,335 (-) | 38.855 (-) | 1,648 (-) |
| TANGER FACTORY OUTLET | 52.498 (-) | 635 (-) | 56.596 (-) | 759 (-) |
| UMH PROPERTIES INC | 14.648 (-) | 202 (-) | 16.547 (-) | 225 (-) |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 14.099 (-) | 275 (-) | 14.855 (-) | 294 (-) |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 7.254 (-) | 781 (-) | 8.149 (-) | 874 (-) |
| VENTAS INC | 223.063 (-) | 12,254 (-) | 238.823 (-) | 14,008 (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 94.048 (-) | 5,277 (-) | 108.239 (-) | 6,403 (-) |
| WASHINGTON REIT | 44.537 (-) | 1,197 (-) | 48.263 (-) | 1,354 (-) |
| GEO GROUP INC | 63.788 (-) | 953 (-) | 69.573 (-) | 1,086 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------------------|-----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| WEINGARTEN REALTY INVST | 68.934 | 1,737 | 75.901 | 2,131 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 83.828 | 3,572 | 91.849 | 4,183 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 47.055 | 679 | 52.461 | 859 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 77.018 | 8,245 | 83.912 | 9,070 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 53.217 | 380 | 60.653 | 464 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 131.125 | 1,569 | 146.164 | 1,789 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CUBESMART | 115.577 | 3,589 | 124.502 | 4,001 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 144.286 | 19,233 | 138.559 | 17,511 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 109.905 | 938 | 123.184 | 1,171 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 339.568 | 6,534 | 319.53 | 6,489 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DOUGLAS EMMETT INC | 98.615 | 3,793 | 107.284 | 4,359 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 64.15 | 963 | 70.93 | 1,190 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 71.787 | 1,444 | 79.357 | 1,672 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 59.549 | 579 | 67.1 | 700 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TERRENO REALTY CORP | 39.84 | 2,132 | 41.774 | 2,256 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 29.638 | 1,233 | 28.36 | 1,248 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RLJ LODGING TRUST | 98.079 | 1,396 | 111.376 | 1,675 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 120.456 | 4,221 | 126.131 | 4,299 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORESITE REALTY CORP | 23.102 | 2,726 | 24.083 | 2,693 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VEREIT INC | 642.088 | 5,345 | 665.444 | 6,002 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 5.02 | 130 | 5.642 | 149 |
| | (△20.497) | (△574) | (-) | (-) |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 74.195 | 1,611 | 82.327 | 1,895 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 27.891 | 825 | 31.223 | 937 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 19.153 | 197 | 20.73 | 228 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHATHAM LODGING TRUST | 20.564 | 260 | 22.718 | 345 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------------|------------------|--------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 115.26 (-) | 2,185 (-) | 118.283 (-) | 2,366 (-) |
| WHITESTONE REIT | 14.96 (-) | 136 (-) | 16.906 (-) | 197 (-) |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 92.814 (-) | 2,918 (-) | 102.019 (-) | 3,404 (-) |
| STAG INDUSTRIAL INC | 86.007 (-) | 2,504 (-) | 84.975 (-) | 2,482 (-) |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 120.216 (-) | 1,234 (-) | 130.353 (-) | 1,532 (-) |
| CYRUSONE INC | 70.15 (-) | 4,834 (-) | 74.521 (-) | 4,859 (-) |
| WP CAREY INC | 102.444 (-) | 8,117 (-) | 111.607 (-) | 9,235 (-) |
| GLADSTONE LAND CORP | 10.297 (-) | 127 (-) | 8.362 (-) | 106 (-) |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 125.796 (-) | 3,576 (-) | 133.349 (-) | 4,016 (-) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 31.694 (-) | 2,185 (-) | 33.407 (-) | 2,477 (-) |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 16.642 (-) | 162 (-) | 19.626 (-) | 239 (-) |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 60.133 (-) | 2,601 (-) | 59.794 (-) | 2,796 (-) |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 114.489 (-) | 1,978 (-) | 118.435 (-) | 2,188 (-) |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 70.252 (-) | 3,102 (-) | 70.443 (-) | 3,196 (-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 155.05 (-) | 3,982 (-) | 171.244 (-) | 4,502 (-) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 54.571 (-) | 705 (-) | 62.027 (-) | 848 (-) |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 10.051 (-) | 892 (-) | 8.231 (-) | 754 (-) |
| JBG SMITH PROPERTIES | 68.855 (-) | 2,575 (-) | 76.522 (-) | 2,916 (-) |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 71.133 (-) | 840 (-) | 59.164 (-) | 703 (-) |
| RETAIL VALUE INC | 4.797 (0.219) | 98 (8) | 5.928 (-) | 171 (-) |
| INVITATION HOMES INC | 324.214 (-) | 9,091 (-) | 298.944 (-) | 8,676 (-) |
| QTS REALTY TRUST INC | 32.393 (-) | 1,830 (-) | 33.783 (-) | 1,836 (-) |
| SPIRIT MTA REIT | 5.315 (-) | 44 (-) | 19.261 (-) | 165 (-) |
| COREPOINT LODGING INC | 23.965 (-) | 187 (-) | 10.317 (-) | 62 (-) |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 83.944 (-) | 1,023 (-) | 87.762 (-) | 1,139 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|---------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 10.935 | 173 | 5.949 | 111 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAFEHOLD INC | 5.165 | 237 | 3.864 | 204 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 57.385 | 1,220 | 48.583 | 1,142 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 38.581 | 795 | 43.195 | 918 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 64.89 | 1,203 | 70.656 | 1,419 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 119.231 | 4,464 | 130.086 | 5,367 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 176.843 | 3,060 | 193.665 | 3,693 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 7.355 | 66 | 10.956 | 85 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 40.737 | 679 | 57.267 | 1,024 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 150 | 84 | 77.3 | 20 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIME US REIT | 210.2 | 185 | 66.6 | 60 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | 420.6 | 325 | 265.5 | 192 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC | 9.686 | 92 | 8.093 | 93 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FARMLAND PARTNERS INC | 5.098 | 33 | 5.35 | 31 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CITY OFFICE REIT INC | 27.435 | 332 | 29.462 | 344 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 85.115 | 164 | 106.134 | 272 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CARETRUST REIT INC | 52.315 | 1,092 | 56.662 | 1,215 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 34.332 | 168 | 38.372 | 228 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STORE CAPITAL CORP | 128.373 | 4,103 | 133.097 | 4,656 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PARAMOUNT GROUP INC | 113.279 | 1,360 | 128.052 | 1,605 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 18.432 | 212 | 13.579 | 167 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 69.162 | 1,110 | 81.192 | 1,411 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 45.835 | 1,074 | 49.803 | 1,119 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 60.338 | 1,011 | 65.713 | 1,217 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 12.327 | 511 | 13.436 | 607 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 33.855 | 1,092 | 35.758 | 1,204 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | (-) | (-) | (-) | (-) |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 9.933 | 414 | 10.503 | 475 |
| GLOBAL NET LEASE INC | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CLIPPER REALTY INC | 123.934 | 1,687 | 138.502 | 1,972 |
| MANULIFE US REIT | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 49.415 | 888 | 51.627 | 1,002 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VICI PROPERTIES INC | 3.147 | 22 | 3.23 | 32 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 114.5 | 102 | 121.5 | 107 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | (△449.5) | (△393) | (-) | (-) |
| COLONY CAPITAL INC | 761.4 | 672 | 788.8 | 743 |
| | (449.5) | (383) | (-) | (-) |
| | 137.59 | 2,612 | 151.963 | 3,193 |
| | (12.872) | (348) | (-) | (-) |
| | 295.273 | 6,403 | 285.103 | 6,622 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 6.014 | 101 | 24.82 | 420 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 19.507 | 578 | 20.409 | 713 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 35.694 | 937 | 40.109 | 1,126 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 276.179 | 1,148 | 308.566 | 1,449 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | 41.118 | 1,177 | 45.221 | 1,372 |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | (-) | (-) | (-) | (-) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 52.243 | 2,738 | 53.754 | 2,931 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 84.732 | 1,575 | 93.683 | 1,946 |
| ALLIED PROPERTIES REIT | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COMINAR REAL ESTATE INVT TR | 32.471 | 544 | 31.886 | 627 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | (30.048) | (622) | (-) | (-) |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 96.764 | 2,249 | 102.119 | 2,614 |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 38.369 | 1,927 | 38.662 | 2,039 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 51.333 | 617 | 56.914 | 764 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 15.515 | 420 | 16.705 | 508 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 17.344 | 545 | 17.87 | 574 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 12.786 | 499 | 13.427 | 593 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| | 37.078 | 401 | 40.38 | 479 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

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

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

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|--------------------|---------------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 716 (475) | 6,026 (4,929) | 786 (-) | 6,663 (-) |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND MALL TRUST | 1,753.8 (-) | 4,109 (-) | 1,916 (-) | 4,685 (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 1,826 (-) | 5,580 (△16) | 1,856.1 (-) | 5,719 (-) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 1,703.1 (-) | 3,250 (-) | 1,854.5 (-) | 3,660 (-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 1,351.5 (-) | 2,308 (△5) | 1,461.3 (-) | 2,608 (-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,892.9 (-) | 3,268 (△17) | 1,852.5 (-) | 3,221 (-) |
| STARHILL GLOBAL REIT | 716.6 (-) | 464 (△1) | 811.6 (-) | 556 (-) |
| ASCOTT TRUST | 878.7 (202.601) | 991 (241) | 989.9 (-) | 1,201 (-) |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 252.1 (△113.88) | 401 (△176) | 382.5 (-) | 617 (-) |
| KEPPEL REIT | 1,127.8 (-) | 1,330 (-) | 1,200.6 (-) | 1,462 (-) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 427.1 (-) | 1,101 (-) | 448.9 (-) | 1,242 (-) |
| ESR REIT | 1,049.5 (-) | 490 (-) | 1,073.3 (-) | 559 (-) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 482.4 (-) | 673 (△4) | 489.1 (-) | 732 (-) |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 480.4 (-) | 719 (△23) | 481.2 (-) | 715 (-) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 257.9 (-) | 236 (△5) | 276.3 (-) | 271 (-) |
| AJMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 256.4 (-) | 345 (△0.16673) | 333.5 (-) | 472 (-) |
| PARKWAY LIFE REIT | 225 (-) | 740 (△2) | 237.3 (-) | 782 (-) |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 1,036.3 (-) | 200 (△3) | 993.1 (-) | 205 (-) |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 914.4 (-) | 2,330 (△0.5021) | 919.5 (-) | 2,390 (-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 1,334.4 (-) | 2,897 (△0.17955) | 1,347 (-) | 2,995 (-) |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 545.7 (-) | 356 (△0.47411) | 645.7 (-) | 456 (-) |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 261.4 (-) | 93 (-) | 193.8 (-) | 79 (-) |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 1,243.8 (-) | 1,424 (△18) | 1,371.3 (-) | 1,611 (-) |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 177.1 (△255.1) | 196 (△267) | 205.5 (-) | 218 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---|------------|--------------|-----------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 329.7 | 198 | 414 | 267 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPH REIT | 499.1 | 504 | 487 | 504 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OUÉ HOSPITALITY TRUST | 150.8 | 111 | 189.1 | 136 |
| | (△407.02) | (△292) | (-) | (-) |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 431.4 | 196 | 412.8 | 196 |
| | (-) | (△0.57467) | (-) | (-) |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 285.6 | 219 | 120.4 | 86 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OUÉ COMMERCIAL REIT | 1,528.2 | 766 | 1,308 | 662 |
| | (552.855) | (275) | (-) | (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS | - | - | 180.153 | 44 |
| | (180.153) | (-) | (-) | (-) |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 203.6 | 154 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 259.7 | 146 | 297 | 185 |
| | (-) | (△3) | (-) | (-) |
| KEPPEL DC REIT | 774 | 1,630 | 755.3 | 1,590 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 1,000.2 | 1,155 | 973.1 | 1,179 |
| | (140.414) | (143) | (-) | (-) |
| ニュージーランド | 千□ | 千ニュージーランド・ドル | 千□ | 千ニュージーランド・ドル |
| PRECINCT PROPERTIES | 606.07 | 1,072 | 660.09 | 1,197 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 180.938 | 478 | 202.203 | 544 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 696.471 | 1,554 | 729.346 | 1,608 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 945.872 | 1,350 | 1,011.417 | 1,523 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 353.866 | 458 | 389.63 | 533 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STRIDE STAPLED GROUP | 19.128 | 43 | 159.167 | 355 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 581.439 | 2,973 | 641.453 | 3,341 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 87.954 | 23 | 13.153 | 24 |
| | (△201.052) | (-) | (-) | (-) |
| DERWENT LONDON PLC | 64.624 | 2,236 | 71.761 | 2,570 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 90.236 | 975 | 96.492 | 1,038 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HAMMERSON PLC | 455.24 | 890 | 490.897 | 1,127 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 448.997 | 3,646 | 492.772 | 4,169 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WORKSPACE GROUP PLC | 73.453 | 709 | 81.28 | 834 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

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

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2019年6月25日から2020年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | |
|----------------------------------|---------|---------|----|---------|----------|-----------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (アメリカ) | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | | 17.505 | | 8,333 | 11 | 1,210 | 0.0 |
| GETTY REALTY CORP | | 12.616 | | 10.38 | 314 | 33,602 | 0.1 |
| PS BUSINESS PARKS | | 7.004 | | 5,805 | 765 | 81,702 | 0.2 |
| RPT REALTY | | 27.63 | | 25.39 | 170 | 18,190 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | | 107.748 | | 101.743 | 6,260 | 668,406 | 1.9 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 59.384 | | 49.99 | 2,231 | 238,236 | 0.7 |
| UDR INC | | 97.737 | | 87.344 | 3,298 | 352,139 | 1.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | | 38.643 | | 32.504 | 824 | 88,010 | 0.3 |
| CORECIVIC INC | | 41.521 | | 35.793 | 352 | 37,604 | 0.1 |
| SAUL CENTERS INC | | 4.421 | | 3.788 | 123 | 13,140 | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 108.459 | | 90.583 | 6,079 | 649,154 | 1.9 |
| LIFE STORAGE INC | | 16.395 | | 13.99 | 1,314 | 140,379 | 0.4 |
| PUBLIC STORAGE | | 52.671 | | 44.536 | 8,488 | 906,276 | 2.6 |
| SUN COMMUNITIES INC | | 30.554 | | 29,114 | 4,144 | 442,526 | 1.3 |
| TAUBMAN CENTERS INC | | 21.393 | | 17.74 | 661 | 70,668 | 0.2 |
| TANGER FACTORY OUTLET | | 32.737 | | 28.639 | 205 | 21,924 | 0.1 |
| UMH PROPERTIES INC | | 13.433 | | 11,534 | 146 | 15,615 | 0.0 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | | 11.234 | | 10.478 | 194 | 20,758 | 0.1 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | | 4.708 | | 3,813 | 324 | 34,677 | 0.1 |
| VENTAS INC | | 126.445 | | 110.685 | 3,962 | 423,078 | 1.2 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 61.491 | | 47.3 | 1,851 | 197,716 | 0.6 |
| WASHINGTON REIT | | 27.867 | | 24.141 | 524 | 55,958 | 0.2 |
| GEO GROUP INC | | 42.24 | | 36.455 | 431 | 46,045 | 0.1 |
| WEINGARTEN REALTY INVST | | 41.968 | | 35.001 | 647 | 69,172 | 0.2 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | | 49.096 | | 41.075 | 1,504 | 160,643 | 0.5 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | | 31.031 | | 25.625 | 290 | 31,026 | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | | 45.051 | | 38,157 | 3,547 | 378,761 | 1.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | | 40.56 | | 33.124 | 156 | 16,728 | 0.0 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | | 80.002 | | 64.963 | 564 | 60,274 | 0.2 |
| CUBESMART | | 66.756 | | 57.831 | 1,556 | 166,158 | 0.5 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 73.766 | | 79.493 | 11,117 | 1,186,972 | 3.4 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | | 73.922 | | 60.643 | 343 | 36,647 | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | | 136.49 | | 156.528 | 3,013 | 321,715 | 0.9 |
| DOUGLAS EMMETT INC | | 57.933 | | 49.264 | 1,489 | 159,007 | 0.5 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | | 41.878 | | 35.098 | 390 | 41,727 | 0.1 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | | 43.929 | | 36.359 | 604 | 64,558 | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | | 38.836 | | 31.285 | 190 | 20,342 | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP | | 21.401 | | 19,467 | 1,048 | 111,905 | 0.3 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | | 13.155 | | 14.433 | 408 | 43,579 | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | | 61.408 | | 48,111 | 465 | 49,672 | 0.1 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | | 65.012 | | 59,337 | 2,139 | 228,454 | 0.7 |
| CORESITE REALTY CORP | | 12.902 | | 11,921 | 1,448 | 154,633 | 0.4 |
| VEREIT INC | | 342.119 | | 318,763 | 2,161 | 230,752 | 0.7 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | | 21.119 | | - | - | - | - |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | | 45.82 | | 37.688 | 511 | 54,604 | 0.2 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | | 17.851 | | 14.519 | 392 | 41,932 | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES | | 16.36 | | 14.783 | 110 | 11,806 | 0.0 |
| CHATHAM LODGING TRUST | | 17.398 | | 15,244 | 95 | 10,237 | 0.0 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | | 62.571 | | 59,548 | 861 | 91,935 | 0.3 |
| WHITESTONE REIT | | 15.361 | | 13,415 | 92 | 9,854 | 0.0 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | | 54.303 | | 45,098 | 1,137 | 121,437 | 0.3 |
| STAG INDUSTRIAL INC | | 43.588 | | 44.62 | 1,298 | 138,634 | 0.4 |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | | 74.671 | | 64.534 | 417 | 44,580 | 0.1 |
| CYRUSONE INC | | 38.14 | | 33,769 | 2,588 | 276,416 | 0.8 |
| WP CAREY INC | | 60.124 | | 50.961 | 3,514 | 375,218 | 1.1 |
| GLADSTONE LAND CORP | | 4.129 | | 6,064 | 92 | 9,860 | 0.0 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | | 72.282 | | 64,729 | 1,764 | 188,397 | 0.5 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | | 18.038 | | 16,325 | 574 | 61,319 | 0.2 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | | 18.755 | | 15,771 | 136 | 14,565 | 0.0 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | | 30.159 | | 30,498 | 1,089 | 116,346 | 0.3 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|----------------------------------|---------------|---------------|-----------|-------------|-----|------|
| | □ 数 | □ 数 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 率 | 率 |
| (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | | % |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 63.958 | 60.012 | 1,070 | 114,245 | | 0.3 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 36.539 | 36.348 | 1,489 | 159,077 | | 0.5 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 92.275 | 76.081 | 2,048 | 218,675 | | 0.6 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 33.291 | 25.835 | 284 | 30,370 | | 0.1 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | 3.694 | 5.514 | 527 | 56,312 | | 0.2 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 41.967 | 34.3 | 1,038 | 110,891 | | 0.3 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 20.602 | 32.571 | 273 | 29,177 | | 0.1 |
| RETAIL VALUE INC | 5.916 | 5.004 | 63 | 6,731 | | 0.0 |
| INVITATION HOMES INC | 135.096 | 160.366 | 4,464 | 476,684 | | 1.4 |
| QTS REALTY TRUST INC | 19.246 | 17.856 | 1,126 | 120,261 | | 0.3 |
| SPIRIT MTA REIT | 13.946 | — | — | — | | — |
| COREPOINT LODGING INC | — | 13.648 | 55 | 5,887 | | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 48.864 | 45.046 | 308 | 32,945 | | 0.1 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | — | 4.986 | 68 | 7,277 | | 0.0 |
| SAFEHOLD INC | 2.744 | 4.045 | 261 | 27,891 | | 0.1 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS | 17.735 | 26.537 | 453 | 48,422 | | 0.1 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 24.28 | 19.666 | 404 | 43,149 | | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 40.874 | 35.108 | 478 | 51,091 | | 0.1 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | 71.712 | 60.857 | 2,312 | 246,912 | | 0.7 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 105.086 | 88.264 | 1,117 | 119,307 | | 0.3 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 8.936 | 5.335 | 17 | 1,885 | | 0.0 |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 33.378 | 16.848 | 184 | 19,661 | | 0.1 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT | 6.509 | 8.102 | 64 | 6,903 | | 0.0 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 9.63 | 9.378 | 61 | 6,608 | | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | 15.324 | 13.297 | 132 | 14,140 | | 0.0 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 70.292 | 49.273 | 49 | 5,260 | | 0.0 |
| CARETRUST REIT INC | 33.024 | 28.677 | 522 | 55,786 | | 0.2 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 31.63 | 27.59 | 103 | 11,076 | | 0.0 |
| STORE CAPITAL CORP | 70.644 | 65.92 | 1,615 | 172,437 | | 0.5 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 70.246 | 55.473 | 436 | 46,553 | | 0.1 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 7.336 | 12.189 | 147 | 15,708 | | 0.0 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 44.064 | 32.034 | 340 | 36,357 | | 0.1 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I | 25.372 | 21.404 | 502 | 53,704 | | 0.2 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 39.522 | 34.147 | 326 | 34,891 | | 0.1 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 8.002 | 6.893 | 240 | 25,641 | | 0.1 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS | 19.694 | 17.791 | 502 | 53,700 | | 0.2 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 6.76 | 6.19 | 268 | 28,709 | | 0.1 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 75.452 | 60.884 | 610 | 65,135 | | 0.2 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 29.176 | 26.964 | 449 | 48,020 | | 0.1 |
| CLIPPER REALTY INC | 5.169 | 5.086 | 36 | 3,850 | | 0.0 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 70.84 | 69.339 | 742 | 79,289 | | 0.2 |
| VICI PROPERTIES INC | 127.279 | 137.449 | 3,089 | 329,903 | | 0.9 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 18.806 | — | — | — | | — |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 10.32 | 9.418 | 112 | 12,006 | | 0.0 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 25.108 | 20.693 | 490 | 52,406 | | 0.2 |
| COLONY CAPITAL INC | 171.468 | 139.081 | 368 | 39,351 | | 0.1 |
| 小 計 | □ 数 7,983.341 | □ 数 7,409.052 | 242,959 | 25,940,780 | | — |
| 銘 柄 数<比率> | 155銘柄<72.3%> | 157銘柄<74.6%> | — | — | | 74.6 |
| (カナダ) | 千□ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| SMARTCENTRES REIT | 24.167 | 20.064 | 416 | 32,643 | | 0.1 |
| CANADIAN APT PPTYYS REIT | 26.047 | 24.536 | 1,222 | 95,798 | | 0.3 |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 48.916 | 39.965 | 401 | 31,445 | | 0.1 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST | — | 30.633 | 440 | 34,498 | | 0.1 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 52.282 | 46.927 | 740 | 58,070 | | 0.2 |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 18.469 | 18.176 | 744 | 58,374 | | 0.2 |
| COMINAR REAL ESTATE INVT TR | 30.322 | 24.741 | 197 | 15,511 | | 0.0 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | 9.817 | 8.627 | 172 | 13,535 | | 0.0 |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 10.523 | 9.997 | 344 | 26,990 | | 0.1 |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 7.736 | 7.095 | 202 | 15,863 | | 0.0 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 24.488 | 21.186 | 163 | 12,834 | | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 期末 | |
|----------------------------------|-----------|-----------|--------|-------------|---------|----|-----|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| (カナダ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 16.86 | 13,784 | 178 | 14,021 | 14,021 | | 0.0 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 19.862 | 18,272 | 265 | 20,820 | 20,820 | | 0.1 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 22.017 | 24,249 | 256 | 20,125 | 20,125 | | 0.1 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT | 6.696 | 6,002 | 89 | 6,994 | 6,994 | | 0.0 |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM | 33.203 | — | — | — | — | | — |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 22.37 | 22,509 | 237 | 18,575 | 18,575 | | 0.1 |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 19.293 | 20,873 | 229 | 17,993 | 17,993 | | 0.1 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | 8.529 | 8,495 | 569 | 44,665 | 44,665 | | 0.1 |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 10.465 | 12,414 | 70 | 5,545 | 5,545 | | 0.0 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 53.304 | 46,042 | 594 | 46,619 | 46,619 | | 0.1 |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE | 5.037 | 4,997 | 103 | 8,122 | 8,122 | | 0.0 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 16.489 | 14,064 | 193 | 15,144 | 15,144 | | 0.0 |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES | — | 12,087 | 221 | 17,334 | 17,334 | | 0.0 |
| SLATE RETAIL REIT | 6.406 | 5,623 | 57 | 4,494 | 4,494 | | 0.0 |
| SLATE OFFICE REIT | 12.079 | 11,634 | 43 | 3,446 | 3,446 | | 0.0 |
| KILLAM APARTMENT REIT | 16.959 | — | — | — | — | | — |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV | — | 14,74 | 257 | 20,215 | 20,215 | | 0.1 |
| 小計 | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| | 25銘柄 | <1.9%> | 26銘柄 | <1.9%> | — | — | 1.9 |
| (オーストラリア) | 千口 | 千円 | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | % |
| BWP TRUST | 166.921 | 145,963 | 575 | 41,901 | 41,901 | | 0.1 |
| MIRVAC GROUP | 1,398.222 | 1,181,612 | 2,764 | 201,455 | 201,455 | | 0.6 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 608.982 | 570,442 | 510 | 37,198 | 37,198 | | 0.1 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 124.412 | 136,991 | 489 | 35,632 | 35,632 | | 0.1 |
| GPT GROUP | 632.592 | 575,807 | 2,573 | 187,531 | 187,531 | | 0.5 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 120.666 | 100,258 | 278 | 20,307 | 20,307 | | 0.1 |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU | 95.978 | 75,176 | 196 | 14,295 | 14,295 | | 0.0 |
| STOCKLAND | 871.018 | 727,078 | 2,632 | 191,769 | 191,769 | | 0.6 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 79.545 | 68,692 | 321 | 23,422 | 23,422 | | 0.1 |
| DEXUS | 383.348 | 321,924 | 3,235 | 235,726 | 235,726 | | 0.7 |
| GOODMAN GROUP | 568.14 | 478,528 | 7,297 | 531,699 | 531,699 | | 1.5 |
| VICINITY CENTRES | 1,131.404 | 1,197.4 | 1,814 | 132,172 | 132,172 | | 0.4 |
| CHARTER HALL GROUP | 162.348 | 136,701 | 1,380 | 100,596 | 100,596 | | 0.3 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 99.748 | 86,456 | 290 | 21,165 | 21,165 | | 0.1 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 313.615 | 301,574 | 714 | 52,075 | 52,075 | | 0.1 |
| ARENA REIT | 106.906 | 93,469 | 220 | 16,071 | 16,071 | | 0.0 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 77.55 | 123,086 | 568 | 41,432 | 41,432 | | 0.1 |
| APN INDUSTRIA REIT | 38.914 | 41,907 | 111 | 8,121 | 8,121 | | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 243.475 | 280,409 | 553 | 40,350 | 40,350 | | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 52.264 | 50,661 | 160 | 11,664 | 11,664 | | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP | 160.1 | 137.85 | 167 | 12,203 | 12,203 | | 0.0 |
| RURAL FUNDS GROUP | 105.905 | 101,989 | 213 | 15,530 | 15,530 | | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | 1,887.979 | 1,543,922 | 3,412 | 248,603 | 248,603 | | 0.7 |
| CENTURIA OFFICE REIT | — | 115,908 | 243 | 17,734 | 17,734 | | 0.1 |
| WAYPOINT REIT LTD | 156.535 | 208,852 | 576 | 41,998 | 41,998 | | 0.1 |
| 小計 | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| | 24銘柄 | <7.0%> | 25銘柄 | <6.6%> | — | — | 6.6 |
| (香港) | 千口 | 千円 | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | | % |
| LINK REIT | 748.52 | 608.02 | 39,946 | 550,468 | 550,468 | | 1.6 |
| PROSPERITY REIT | 462 | 361 | 844 | 11,640 | 11,640 | | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | 481 | 448 | 1,666 | 22,965 | 22,965 | | 0.1 |
| CHAMPION REIT | 691.07 | 602.07 | 2,528 | 34,845 | 34,845 | | 0.1 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | 384 | 313 | 1,223 | 16,864 | 16,864 | | 0.0 |
| FORTUNE REAL ESTATE (HK) | 477 | — | — | — | — | | — |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T | — | 405 | 2,867 | 39,512 | 39,512 | | 0.1 |
| 小計 | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| | 6銘柄 | <2.6%> | 6銘柄 | <1.9%> | — | — | 1.9 |
| (シンガポール) | 千口 | 千円 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | | % |
| CAPITALAND MALL TRUST | 1,001.86 | 839.66 | 1,704 | 130,190 | 130,190 | | 0.4 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVNT | 911.76 | 881.66 | 2,750 | 210,104 | 210,104 | | 0.6 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|----|------------|--------------|-----------|----|-----|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| (シンガポール) | 千口 | 千円 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | | % |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 992.379 | | 840.979 | 1,454 | 111,124 | | 0.3 |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 808.39 | | 698.59 | 1,005 | 76,835 | | 0.2 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 839.72 | | 880.12 | 1,707 | 130,413 | | 0.4 |
| STARHILL GLOBAL REIT | 469.2 | | 374.2 | 205 | 15,719 | | 0.0 |
| ASCOTT TRUST | 438.715 | | 530.116 | 572 | 43,729 | | 0.1 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 244.28 | | — | — | — | | — |
| KEPPEL REIT | 626.4 | | 553.6 | 614 | 46,935 | | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 230.1 | | 208.3 | 510 | 38,979 | | 0.1 |
| ESR REIT | 660.33 | | 636.53 | 257 | 19,690 | | 0.1 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 257.6 | | 250.9 | 281 | 21,463 | | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 233.38 | | 232.58 | 304 | 23,271 | | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 198.5 | | 180.1 | 129 | 9,904 | | 0.0 |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 217.695 | | 140.595 | 175 | 13,423 | | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REIT | 131.6 | | 119.3 | 408 | 31,163 | | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU | 571.8 | | 615 | 87 | 6,717 | | 0.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 460.92 | | 455.82 | 1,294 | 98,876 | | 0.3 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 657.2 | | 644.6 | 1,302 | 99,453 | | 0.3 |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 410.78 | | 310.78 | 177 | 13,530 | | 0.0 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 218.6 | | 286.2 | 105 | 8,088 | | 0.0 |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 741.7 | | 614.2 | 583 | 44,566 | | 0.1 |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 283.5 | | — | — | — | | — |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 355.6 | | 271.3 | 145 | 11,086 | | 0.0 |
| SPH REIT | 224.9 | | 237 | 212 | 16,201 | | 0.0 |
| OUÉ HOSPITALITY TRUST | 445.32 | | — | — | — | | — |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 256.4 | | 275 | 110 | 8,401 | | 0.0 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T | — | | 165.2 | 125 | 9,589 | | 0.0 |
| OUÉ COMMERCIAL REIT | — | | 773.055 | 309 | 23,618 | | 0.1 |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | — | | 203.6 | 149 | 11,429 | | 0.0 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 273 | | 235.7 | 117 | 9,001 | | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT | 341 | | 359.7 | 888 | 67,860 | | 0.2 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T | 555.65 | | 723.164 | 846 | 64,625 | | 0.2 |
| 小計 | 14,058.279 | | 13,537.549 | 18,538 | 1,415,996 | | — |
| | 口数・金額 銘柄数<比率> | | 30銘柄<3.6%> | 30銘柄<4.1%> | — | — | 4.1 |
| (ニュージーランド) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | | % |
| PRECINCT PROPERTIES | 380.191 | | 326.171 | 544 | 37,268 | | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 127.868 | | 106.603 | 273 | 18,745 | | 0.1 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 361.871 | | 328.996 | 697 | 47,721 | | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 512.744 | | 447.199 | 482 | 33,045 | | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 282.83 | | 247.066 | 286 | 19,608 | | 0.1 |
| STRIDE STAPLED GROUP | 140.039 | | — | — | — | | — |
| 小計 | 1,805.543 | | 1,456.035 | 2,285 | 156,388 | | — |
| | 口数・金額 銘柄数<比率> | | 6銘柄<0.5%> | 5銘柄<0.4%> | — | — | 0.4 |
| (イギリス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | % |
| BRITISH LAND CO PLC | 337.35 | | 277.336 | 1,123 | 148,089 | | 0.4 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 135.437 | | 9.186 | 9 | 1,260 | | 0.0 |
| DERWENT LONDON PLC | 38.645 | | 31.508 | 937 | 123,567 | | 0.4 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 54.616 | | 48.36 | 492 | 64,939 | | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | 269.495 | | 233.838 | 244 | 32,232 | | 0.1 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 265.466 | | 221.691 | 1,343 | 176,981 | | 0.5 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 46.404 | | 38.577 | 269 | 35,534 | | 0.1 |
| INTU PROPERTIES PLC | 295.875 | | 231.04 | 11 | 1,522 | | 0.0 |
| UNITE GROUP PLC | 92.217 | | 106.992 | 1,000 | 131,829 | | 0.4 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 395.499 | | 355.593 | 580 | 76,475 | | 0.2 |
| SHAFTESBURY PLC | 80.557 | | 63.788 | 363 | 47,956 | | 0.1 |
| SEGRO PLC | 379.728 | | 327.645 | 2,884 | 380,130 | | 1.1 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 95.824 | | 73.391 | 477 | 62,864 | | 0.2 |
| ASSURA PLC | 854.448 | | 788.073 | 641 | 84,535 | | 0.2 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT | 204.861 | | 187.713 | 61 | 8,088 | | 0.0 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 194.275 | | 170.446 | 116 | 15,386 | | 0.0 |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 159.52 | | — | — | — | | — |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|---------------|-------------------------------|-------------------------------------|---------------|-----------------|-----------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| (イギリス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 227.534 | 254.022 | 167 | 22,093 | 167 | 22,093 |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 72.106 | 60.379 | 446 | 58,840 | 446 | 58,840 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 251.418 | 269.096 | 600 | 79,150 | 600 | 79,150 |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT | - | 245.021 | 178 | 23,538 | 178 | 23,538 |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL | - | 247.221 | 423 | 55,774 | 423 | 55,774 |
| RDI REIT PLC | 77.641 | 74.051 | 57 | 7,631 | 57 | 7,631 |
| NEWRIVER REIT PLC | 103.999 | 102.138 | 69 | 9,112 | 69 | 9,112 |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 235.42 | 189.831 | 206 | 27,267 | 206 | 27,267 |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT | 134.957 | 110.038 | 105 | 13,920 | 105 | 13,920 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 598.461 | 512.115 | 747 | 98,530 | 747 | 98,530 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 196.113 | 186.961 | 103 | 13,698 | 103 | 13,698 |
| AEW UK REIT PLC | - | 54.933 | 38 | 5,096 | 38 | 5,096 |
| LXI REIT PLC | 134.197 | 159.926 | 182 | 24,025 | 182 | 24,025 |
| REGIONAL REIT LTD | 110.888 | 129.74 | 97 | 12,822 | 97 | 12,822 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 6,042.951 28銘柄<4.9%> | □数 金額 5,760.649 30銘柄<5.3%> | 金額 13,984 | 金額 1,842,897 | 比率 5.3 |
| (イスラエル) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| REIT 1 LTD | 63.655 | 52.551 | 722 | 22,334 | 722 | 22,334 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 63.655 1銘柄<0.1%> | 金額 52.551 1銘柄<0.1%> | 金額 722 | 金額 22,334 | 比率 0.1 |
| (韓国) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 9.316 | 10.894 | 72,989 | 6,423 | 72,989 | 6,423 |
| LOTTE REIT CO LTD | - | 25.4 | 147,574 | 12,986 | 147,574 | 12,986 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 9.316 1銘柄<0.0%> | 金額 36.294 2銘柄<0.1%> | 金額 220,563 | 金額 19,409 | 比率 0.1 |
| (ユーロ…アイルランド) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| GREEN REIT PLC | 240.878 | - | - | - | - | - |
| HIBERNIA REIT PLC | 242.24 | 208.204 | 231 | 27,587 | 231 | 27,587 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI | 124.155 | 119.677 | 167 | 20,000 | 167 | 20,000 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 607.273 3銘柄<0.2%> | 金額 327.881 2銘柄<0.1%> | 金額 398 | 金額 47,587 | 比率 0.1 |
| (ユーロ…オランダ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 14.114 | 11,468 | 147 | 17,577 | 147 | 17,577 |
| VASTNED RETAIL | 6.326 | 5,849 | 111 | 13,265 | 111 | 13,265 |
| WERELDHAVE NV | 14.313 | 11,998 | 102 | 12,195 | 102 | 12,195 |
| NSI NV | 6.338 | 5,133 | 184 | 21,966 | 184 | 21,966 |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 48.27 | 40,645 | 2,243 | 267,819 | 2,243 | 267,819 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 89.361 5銘柄<2.0%> | 金額 75.093 5銘柄<1.0%> | 金額 2,788 | 金額 332,823 | 比率 1.0 |
| (ユーロ…ベルギー) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| BEFIMMO | 7.94 | 6,929 | 282 | 33,663 | 282 | 33,663 |
| COFINIMMO SA | 7.418 | 7,256 | 921 | 110,000 | 921 | 110,000 |
| RETAIL ESTATES | 2.609 | 3,188 | 190 | 22,756 | 190 | 22,756 |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 8.307 | 6,779 | 153 | 18,288 | 153 | 18,288 |
| WAREHOUSES DE PAUW | 6.236 | 38,064 | 933 | 111,434 | 933 | 111,434 |
| MONTEA SCA | 3.562 | 3,259 | 285 | 34,078 | 285 | 34,078 |
| AEDIFICA | 8.684 | 7,985 | 816 | 97,413 | 816 | 97,413 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 44.756 7銘柄<0.9%> | 金額 73.46 7銘柄<1.2%> | 金額 3,582 | 金額 427,636 | 比率 1.2 |
| (ユーロ…フランス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| GEKINA SA | 19.268 | 16,655 | 1,900 | 226,843 | 1,900 | 226,843 |
| ICADE | 16.153 | 8,117 | 514 | 61,381 | 514 | 61,381 |
| ALTAREA | 1.209 | 0,977 | 136 | 16,327 | 136 | 16,327 |
| KLEPIERRE | 70.94 | 60,564 | 1,067 | 127,420 | 1,067 | 127,420 |
| COVIVIO | 21.906 | 14,277 | 969 | 115,718 | 969 | 115,718 |
| MERCIALYS | 18.406 | 7,165 | 54 | 6,551 | 54 | 6,551 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 147.882 6銘柄<2.2%> | 金額 107,755 6銘柄<1.6%> | 金額 4,643 | 金額 554,242 | 比率 1.6 |
| (ユーロ…ドイツ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| HAMBORNER REIT AG | 27.782 | 21,542 | 185 | 22,173 | 185 | 22,173 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 期末 | |
|----------------------------------|--------------|------------|--------------|-------|------------|----|------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| (ユーロ…ドイツ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 56.116 | 83,898 | 46.459 | 638 | 76,254 | | 0.2 |
| 小計 | 2銘柄<0.3%> | 83,898 | 2銘柄<0.3%> | 824 | 98,428 | | 0.3 |
| (ユーロ…スペイン) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 97.764 | 25,183 | 72.211 | 582 | 69,562 | | 0.2 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 25.183 | 127,901 | 18.634 | 88 | 10,565 | | 0.0 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 127.901 | 250,848 | 109.392 | 852 | 101,788 | | 0.3 |
| 小計 | 3銘柄<0.7%> | 250,848 | 3銘柄<0.5%> | 1,523 | 181,915 | | 0.5 |
| (ユーロ…イタリア) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 15.915 | 15,915 | 14.335 | 49 | 5,852 | | 0.0 |
| 小計 | 1銘柄<0.0%> | 15,915 | 1銘柄<0.0%> | 49 | 5,852 | | 0.0 |
| 合計 | 303銘柄<99.2%> | 44,555,511 | 308銘柄<99.7%> | — | 34,662,937 | | 99.7 |

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

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

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

■投資信託財産の構成

2020年6月22日現在

| 項目 | 当期 | | 期末 | |
|---------------|------------|----|-------|----|
| | 評価額 | 比率 | 評価額 | 比率 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 千円 | | 千円 | % |
| | 34,662,937 | | 98.9 | |
| コール・ローン等、その他 | 369,226 | | 1.1 | |
| 投資信託財産総額 | 35,032,164 | | 100.0 | |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、34,683,398千円、99.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.77円、1カナダ・ドル=78.37円、1オーストラリア・ドル=72.86円、1香港・ドル=13.78円、1シンガポール・ドル=76.38円、1ニュージーランド・ドル=68.42円、1イギリス・ポンド=131.78円、1イスラエル・シケル=30.91円、100韓国・ウォン=8.80円、1ユーロ=119.37円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月22日)現在

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

(注1) 期首元本額 36,301,672,788円
 追加設定元本額 63,049,855,284円
 一部解約元本額 67,533,162,239円

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2019年6月25日 至2020年6月22日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2020年4月20日）

（計算期間 2019年4月19日～2020年4月20日）

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | MSCIエマージング・マーケット・インデックス | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託 受益証券・ 投資証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|---------|---------|---|---------|--------|--------|-------------------------------|------------|
| | 円 | 期中騰落率 | （円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | 期中騰落率 | | | | |
| 8期(2016年4月18日) | 円 8,600 | % △24.6 | ポイント 189,749.05 | % △24.2 | % 92.8 | % 6.1 | % 1.0 | 百万円 36,196 |
| 9期(2017年4月18日) | 10,121 | 17.7 | 224,042.80 | 18.1 | 95.8 | 3.2 | 0.9 | 40,863 |
| 10期(2018年4月18日) | 12,241 | 20.9 | 273,007.15 | 21.9 | 92.1 | 7.1 | 0.7 | 66,443 |
| 11期(2019年4月18日) | 12,260 | 0.2 | 276,323.22 | 1.2 | 94.4 | 4.4 | 0.6 | 61,535 |
| 12期(2020年4月20日) | 9,723 | △20.7 | 225,442.54 | △18.4 | 64.7 | 34.8 | 0.4 | 41,166 |

（注1）株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

（注2）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注5）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

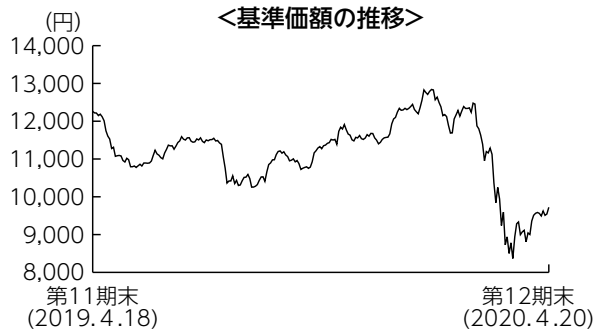
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | MSCIエマージング・ マーケット・インデックス (円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 株式組入 比 率 | 株式先物 比 率 | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 |
|-------------------------|---------|----------|--|----------|-------------|-------------|-------------------------------|
| | 円 | 騰落率 % | ポイント | 騰落率 % | | | |
| (期 首) 2019年 4 月 18 日 | 12,260 | — | 276,323.22 | — | 94.4 | 4.4 | 0.6 |
| 4 月 末 | 12,012 | △2.0 | 270,962.63 | △1.9 | 89.9 | 8.6 | 0.5 |
| 5 月 末 | 10,861 | △11.4 | 245,572.57 | △11.1 | 90.0 | 8.2 | 0.5 |
| 6 月 末 | 11,437 | △6.7 | 258,203.62 | △6.6 | 88.8 | 9.0 | 1.8 |
| 7 月 末 | 11,428 | △6.8 | 258,772.93 | △6.4 | 88.5 | 9.5 | 1.7 |
| 8 月 末 | 10,433 | △14.9 | 236,418.66 | △14.4 | 88.1 | 8.4 | 2.9 |
| 9 月 末 | 10,926 | △10.9 | 248,035.72 | △10.2 | 91.9 | 6.6 | 1.0 |
| 10 月 末 | 11,519 | △6.0 | 260,565.89 | △5.7 | 86.0 | 12.9 | 1.0 |
| 11 月 末 | 11,675 | △4.8 | 264,578.11 | △4.3 | 88.1 | 10.9 | 1.0 |
| 12 月 末 | 12,446 | 1.5 | 282,689.73 | 2.3 | 89.1 | 10.4 | 1.0 |
| 2020年 1 月 末 | 11,890 | △3.0 | 269,975.47 | △2.3 | 87.8 | 11.2 | 1.0 |
| 2 月 末 | 11,393 | △7.1 | 260,455.14 | △5.7 | 83.3 | 15.1 | 0.8 |
| 3 月 末 | 9,074 | △26.0 | 209,688.40 | △24.1 | 76.5 | 39.1 | 0.5 |
| (期 末) 2020年 4 月 20 日 | 9,723 | △20.7 | 225,442.54 | △18.4 | 64.7 | 34.8 | 0.4 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2019年4月19日から2020年4月20日まで）

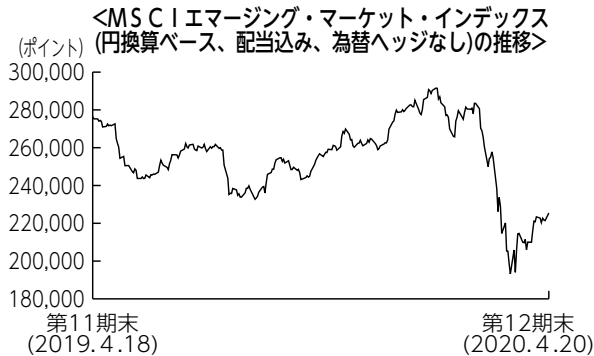


基準価額の推移

当期末の基準価額は9,723円となり、前期末比で20.7%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

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

期末

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



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で18.4%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを2.3%下回りましたが、ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当課税の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------|------|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 | 15円 | 0.134% |
| (株 式) | (13) | (0.112) |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) |
| (先物・オプション) | (2) | (0.020) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.001) |
| (投 資 証 券) | (0) | (0.000) |
| (b) 有価証券取引税 | 21 | 0.186 |
| (株 式) | (21) | (0.186) |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投 資 証 券) | (0) | (0.000) |
| (c) その他費用 | 22 | 0.201 |
| (保 管 費 用) | (16) | (0.147) |
| (そ の 他) | (6) | (0.053) |
| 合 計 | 58 | 0.520 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(11,180円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2019年4月19日から2020年4月20日まで)

(1) 株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-----|----------|--------------|----------------------|----------------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外 国 | タ イ | 証券 - | 千タイ・バーツ - | 証券 112,163 (-) | 千タイ・バーツ 41 (-) |
| | | (62,595) | (75) | | |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---|----------------------|------------------|-----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| ISHARES MSCI SAUDI ARABIA CAPPED UCITS ETF | 3,088.04 (-) | 14,666 (-) | 3,088.04 (-) | 13,482 (-) |
| メキシコ | 千□ | 千メキシコ・ペソ | 千□ | 千メキシコ・ペソ |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | 113.9 (-) | 18,990 (-) | 202.2 (-) | 34,354 (-) |
| GRUPO TELEvisa SAB | 67.1 (147.2) | 2,312 (5,435) | 110.5 (-) | 3,897 (-) |
| CEMEX SAB DE CV | 1,216.9 (-) | 7,668 (-) | 2,013.8 (-) | 13,677 (-) |
| MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV | 17.7 (27.4) | 1,113 (2,493) | 20.1 (-) | 1,284 (-) |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 137.3 (-) | 3,252 (△242) | 278.5 (-) | 7,951 (-) |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 10.1 (39.7) | 976 (4,843) | 26.5 (-) | 2,907 (-) |
| ブラジル | 千□ | 千ブラジル・レアル | 千□ | 千ブラジル・レアル |
| SUL AMERICA SA | 10.7 (17.869) | 568 (561) | 12.3 (-) | 646 (-) |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA | - (34.6) | - (1,507) | 21 (-) | 818 (-) |
| ENERGISA SA | 5.1 (16) | 281 (719) | 15 (-) | 810 (-) |
| KLABIN SA | 16.9 (62) | 356 (975) | 53.7 (-) | 1,049 (-) |
| BANCO BTG PACTUAL SA | 4 (18.5) | 279 (876) | 15.3 (-) | 906 (-) |
| 南アフリカ | 千□ | 千南アフリカ・ランド | 千□ | 千南アフリカ・ランド |
| REDEFINE PROPERTIES LTD | 145.422 (279.94) | 1,175 (2,538) | 272.494 (-) | 1,494 (-) |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 143.934 (184.218) | 2,517 (4,439) | 132.389 (-) | 2,386 (-) |
| HYPROP INVESTMENTS LTD | - (-) | - (-) | 22.174 (-) | 1,499 (-) |
| FORTRESS REIT LTD | - (117.482) | - (2,344) | 62.964 (-) | 1,174 (-) |
| FORTRESS REIT LTD-B | - (-) | - (-) | 57.784 (-) | 603 (-) |
| RESILIENT REIT LTD | - (0.698) | - (-) | 29.298 (-) | 1,655 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|-----------|---------------|---------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 株式先物取引 | 百万円 83,453 | 百万円 71,156 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年4月19日から2020年4月20日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| TRIP.COM GROUP LTD ADR | 390.58 | 236.39 | 563 | 60,827 | インターネット販売・通信販売 |
| CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR | 170 | 100.55 | 71 | 7,702 | 金属・鉱業 |
| SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF | 699 | 242.1 | 120 | 12,981 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CREDICORP LTD | 64.94 | 34.47 | 496 | 53,560 | 銀行 |
| SINA CORP | 58.7 | 37.64 | 129 | 13,994 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR | 527.53 | 297.41 | 242 | 26,151 | 無線通信サービス |
| NETEASE INC-ADR | 74.21 | 35.13 | 1,224 | 132,140 | 娯楽 |
| GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR | — | 33.43 | 24 | 2,643 | 銀行 |
| SOUTHERN COPPER CORP | 72.48 | 42.94 | 129 | 14,018 | 金属・鉱業 |
| TELECOM ARGENTINA SA SP ADR | — | 37.89 | 29 | 3,164 | 各種電気通信サービス |
| YPF SA ADR | — | 15.94 | 6 | 667 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LUKOIL SPON ADR | 467 | 208.53 | 1,299 | 140,209 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GAZPROM PAO ADR | 5,196.69 | 2,639.51 | 1,302 | 140,480 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR | 1,570.79 | 787.21 | 307 | 33,123 | 銀行 |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL CO | 1,058 | 940 | 61 | 6,602 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE | 1,028.8 | 547.36 | 42 | 4,635 | 不動産管理・開発 |
| SURGUTNEFTEGAZ ADR | 775.37 | 432.84 | 198 | 21,388 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| 51JOB INC ADR | 23 | 15.26 | 109 | 11,773 | 専門サービス |
| X5 RETAIL GROUP NV GDR | 126.36 | 68.74 | 196 | 21,151 | 食品・生活必需品小売り |
| NOVATEK PJSC GDR | 88.33 | 46.01 | 593 | 64,035 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BAIDU INC -SPON ADR | 263.13 | 135.55 | 1,423 | 153,557 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| NOVOLIPETSK STEEL GDR | 136.17 | 81.7 | 138 | 14,993 | 金属・鉱業 |
| BANCO MACRO SA ADR | — | 32.36 | 53 | 5,722 | 銀行 |
| MMC NORILSK NICKEL ADR | 635.43 | 315.94 | 841 | 90,738 | 金属・鉱業 |
| ROSNEFT OIL CO GDR | 1,151 | 615.61 | 258 | 27,855 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH | 136.49 | 70.71 | 795 | 85,809 | 各種消費者サービス |
| SEVERSTAL GDR | 247.28 | 122.6 | 142 | 15,383 | 金属・鉱業 |
| TATNEFT ADR | 246.84 | 130.78 | 549 | 59,233 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR | 237.48 | 147.36 | 99 | 10,747 | 金属・鉱業 |
| VTB BANK OJSC GDR | 1,720 | 820 | 75 | 8,165 | 銀行 |
| DP WORLD PLC | 152.19 | 60.42 | 93 | 10,104 | 運送インフラ |
| MAGNIT PJSC GDR | 356.89 | 201.42 | 190 | 20,590 | 食品・生活必需品小売り |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR | 424.34 | 222.33 | 396 | 42,793 | インターネット販売・通信販売 |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR | 339.86 | 190.58 | 984 | 106,221 | 各種消費者サービス |
| NOAH HOLDINGS LTD ADR | 27 | 16.3 | 40 | 4,320 | 資本市場 |
| SBERBANK ADR | 2,588.17 | 1,341.38 | 1,385 | 149,497 | 銀行 |
| PHOSAGRO PJSC GDR | 137.84 | 92.54 | 108 | 11,701 | 化学 |
| HUAZHU GROUP LTD ADR | 126.76 | 55.08 | 170 | 18,433 | ホテル・レストラン・レジャー |
| JOYY INC-ADR | 43.98 | 31.62 | 196 | 21,233 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| GDS HOLDINGS LTD ADR | 56 | 32.56 | 192 | 20,726 | 情報技術サービス |
| ZAI LAB LTD ADR | — | 16.93 | 107 | 11,593 | バイオテクノロジー |
| BEST INC ADR | — | 85.74 | 47 | 5,171 | 航空貨物・物流サービス |
| HUYA INC ADR | — | 15.6 | 25 | 2,785 | 娯楽 |
| NIO INC ADR | — | 234.28 | 75 | 8,113 | 自動車 |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR | 81.15 | 46.89 | 51 | 5,509 | 娯楽 |
| 58.COM INC ADR | 91.17 | 51.12 | 262 | 28,293 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| AUTOHOME INC ADR | 56.56 | 30.96 | 246 | 26,615 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| LUCKIN COFFEE INC ADR | — | 30.29 | 13 | 1,434 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WEIBO CORP ADR | 54.27 | 19.47 | 71 | 7,707 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| JD.COM INC ADR | 697.18 | 362.26 | 1,671 | 180,373 | インターネット販売・通信販売 |
| GLOBANT SA | — | 19.17 | 197 | 21,307 | ソフトウェア |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 1,230.79 | 850.33 | 17,814 | 1,921,997 | インターネット販売・通信販売 |
| MOMO INC SPON ADR | 140.47 | 63.37 | 150 | 16,278 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |

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

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|----------|-----------|-------------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| CHINA TELECOM CORP LTD | 13,400 | 7,000 | 1,778 | 24,749 | 各種電気通信サービス |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD | 1,720 | 580 | 348 | 4,844 | エネルギー設備・サービス |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 14,300 | 9,100 | 864 | 12,033 | 娯楽 |
| SINOTRANS LTD | 1,900 | 2,480 | 453 | 6,317 | 航空貨物・物流サービス |
| MAANSHAN IRON & STEEL | 1,720 | 160 | 37 | 518 | 金属・鉱業 |
| CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL | 3,375.92 | 1,925.92 | 853 | 11,876 | 商業サービス・用品 |
| MMG LTD | 2,200 | - | - | - | 金属・鉱業 |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD | 1,360 | 700 | 350 | 4,872 | 紙製品・林産品 |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 6,617.88 | 3,477.88 | 2,584 | 35,970 | 保険 |
| AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY | 1,890 | 1,580 | 467 | 6,510 | 航空宇宙・防衛 |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS | 1,912 | 1,012 | 935 | 13,016 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD | 3,125 | 1,190 | 595 | 8,282 | 自動車 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 7,150 | 3,560 | 5,724 | 79,684 | 保険 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | 5,610 | 3,070 | 1,013 | 14,102 | 金属・鉱業 |
| CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD | 700 | - | - | - | 金属・鉱業 |
| SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H | 1,760 | 1,040 | 1,148 | 15,982 | ヘルスケア機器・用品 |
| SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 2,747 | 1,567 | 2,356 | 32,806 | 半導体・半導体製造装置 |
| WEICHAI POWER CO LTD | 1,764.4 | 814.4 | 1,162 | 16,188 | 機械 |
| CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO | 1,000 | 340 | 159 | 2,214 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL | 3,730 | 2,930 | 606 | 8,442 | 化学 |
| SHANGHAI INDUSTRIAL | 460 | 170 | 215 | 3,000 | コンプロマリット |
| SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD | - | 540 | 439 | 6,111 | 運送インフラ |
| TINGYI HOLDING CORP | 1,780 | 860 | 1,111 | 15,466 | 食品 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD | 340 | 160 | 692 | 9,632 | 飲料 |
| GUANGDONG INVESTMENTS LTD | 2,820 | 1,300 | 2,061 | 28,700 | 水道 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD | 2,080 | 1,480 | 504 | 7,025 | 医薬品 |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS | 1,413.33 | 733.33 | 2,705 | 37,667 | 飲料 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD | 1,460 | 740 | 388 | 5,407 | 運送インフラ |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 6,755 | 3,455 | 3,987 | 55,500 | 医薬品 |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 2,650 | 1,390 | 3,912 | 54,466 | 食品 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 5,426 | 2,804 | 114,851 | 1,598,737 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 4,920 | 2,695 | 21,182 | 294,863 | 保険 |
| LI NING CO LTD | - | 1,015 | 2,461 | 34,262 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD | 5,080 | 3,280 | 1,000 | 13,925 | 水道 |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 9,702.4 | 4,352.4 | 317 | 4,422 | 専門小売り |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 3,500 | 2,100 | 317 | 4,414 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AIR CHINA / HONG KONG | 1,640 | 540 | 285 | 3,968 | 旅客航空輸送業 |
| ZTE CORP | 712.88 | 430.88 | 1,027 | 14,304 | 通信機器 |
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD | 2,500 | 1,260 | 280 | 3,911 | 電気設備 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | 3,340 | 1,750 | 2,492 | 34,688 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD | 2,485 | 690 | 146 | 2,036 | 海運業 |
| BANK OF COMMUNICATIONS | 8,102.05 | 3,792.05 | 1,827 | 25,442 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD | 1,862.5 | 1,162.5 | 702 | 9,773 | 建設・土木 |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 720 | 390 | 1,528 | 21,280 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK | 91,385.3 | 46,635.3 | 28,540 | 397,287 | 銀行 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD | 726 | 384 | 3,603 | 50,165 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 2,700 | 1,740 | 890 | 12,401 | 自動車 |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD | 1,580 | 640 | 545 | 7,590 | 不動産管理・開発 |
| SSY GROUP LTD | 1,440 | 980 | 596 | 8,307 | 医薬品 |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD | 1,710 | 600 | 468 | 6,514 | 紙製品・林産品 |
| CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL | 3,920 | 1,660 | 1,538 | 21,420 | 建設資材 |
| BANK OF CHINA LTD | 75,282 | 37,952 | 11,309 | 157,430 | 銀行 |
| SHUI ON LAND LTD | 3,355 | 3,880 | 516 | 7,183 | 不動産管理・開発 |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 1,130 | 600 | 1,854 | 25,807 | 不動産管理・開発 |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD | 820 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD | 800 | 804 | 810 | 11,281 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 3,709.7 | 1,824.7 | 6,441 | 89,661 | 銀行 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|-----------|-----------|-----------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| IND & COMM BK OF CHINA - H | 65,902.35 | 31,332.35 | 16,104 | 224,179 | 銀行 |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD | 960 | 355 | 299 | 4,175 | 金属・鉱業 |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING | 1,040 | 565 | 416 | 5,804 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES | 2,276 | 1,196 | 688 | 9,589 | 建設・土木 |
| CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD | 4,420 | 1,990 | 1,040 | 14,487 | 建設・土木 |
| CHINA COAL ENERGY CO | 1,780 | 430 | 92 | 1,280 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 540 | 400 | 552 | 7,683 | 機械 |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD | 510 | 170 | 394 | 5,490 | 電気設備 |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD | 1,150 | 560 | 1,150 | 16,019 | 家庭用耐久財 |
| CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD | 1,910 | - | - | - | 食品 |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD | 7,271.42 | 3,851.42 | 3,766 | 52,432 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD | 3,690 | 1,320 | 314 | 4,373 | 金属・鉱業 |
| CHINA CITIC BANK-H | 8,798 | 3,848 | 1,427 | 19,872 | 銀行 |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD | 1,210 | 445 | 504 | 7,024 | 不動産管理・開発 |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 687 | 362 | 4,090 | 56,941 | 電子装置・機器・部品 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 1,040 | 550 | 3,517 | 48,960 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FOSUN INTERNATIONAL | 2,610.28 | 1,265.28 | 1,213 | 16,890 | コングロマリット |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD | 5,140 | 2,860 | 1,527 | 21,259 | 不動産管理・開発 |
| CHINA AOYUAN GROUP LTD | - | 410 | 376 | 5,244 | 不動産管理・開発 |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 2,535 | 1,340 | 274 | 3,823 | 不動産管理・開発 |
| BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | - | 1,500 | 292 | 4,071 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SOHO CHINA LTD | 1,725 | 1,115 | 404 | 5,634 | 不動産管理・開発 |
| KINGSOFT CORP LTD | 760 | 450 | 1,190 | 16,568 | ソフトウェア |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 645 | 385 | 591 | 8,231 | 機械 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | 3,380 | 2,050 | 906 | 12,612 | 建設・土木 |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD | 1,220 | 540 | 399 | 5,562 | 食品 |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD | 525 | 250 | 410 | 5,707 | 通信機器 |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP | 1,650 | 870 | 748 | 10,414 | 建設・土木 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 4,880 | 2,670 | 1,503 | 20,924 | 食品 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 2,518 | 1,336 | 3,266 | 45,469 | 保険 |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 2,500 | 980 | 1,342 | 18,688 | 不動産管理・開発 |
| CRRC CORP LTD - H | 3,374.5 | 1,934.5 | 793 | 11,040 | 機械 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD | 1,260 | 770 | 733 | 10,203 | 医薬品 |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 2,115 | 1,260 | 1,512 | 21,047 | 食品・生活必需品小売り |
| BBMG CORP | 2,220 | 460 | 91 | 1,274 | 建設資材 |
| CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD | 1,452 | 236 | 43 | 604 | 金属・鉱業 |
| SINOPHARM GROUP CO | 1,076 | 616 | 1,232 | 17,149 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA RESOURCES CEMENT | 2,380 | 1,340 | 1,301 | 18,111 | 建設資材 |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD | 2,760 | 80 | 10 | 151 | 建設・土木 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD | 2,745.27 | 1,265.27 | 832 | 11,589 | 自動車 |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 1,995 | 845 | 301 | 4,199 | 金属・鉱業 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK | 2,680 | 600 | 190 | 2,647 | 銀行 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP | 2,720 | 1,880 | 733 | 10,206 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD | 737 | 305 | 418 | 5,824 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUANENG RENEWABLES CORP LTD | 4,720 | - | - | - | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD | 3,250 | - | - | - | 医薬品 |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 2,330 | 1,230 | 4,225 | 58,812 | 不動産管理・開発 |
| YUZHOU PROPERTIES CO LTD | 1,660 | 860 | 283 | 3,950 | 不動産管理・開発 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | - | 566 | 358 | 4,987 | 機械 |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 1,440 | 885 | 3,367 | 46,874 | 不動産管理・開発 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 846 | 353 | 896 | 12,480 | 保険 |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 5,926.56 | 3,021.56 | 1,713 | 23,848 | 銀行 |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD | 2,030 | 1,260 | 379 | 5,279 | 不動産管理・開発 |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | 848 | 68 | 51 | 710 | 電気設備 |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | - | 680 | 703 | 9,787 | 建設関連製品 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 2,690 | 1,240 | 378 | 5,264 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA | 27,910 | 13,380 | 4,161 | 57,923 | 銀行 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|----------|--------|-----------|-------------|--------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD | 550 | 310 | 926 | 12,902 | 専門小売り |
| FAR EAST HORIZON LTD | 1,990 | 1,450 | 884 | 12,312 | 各種金融サービス |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 2,025 | 915 | 1,363 | 18,977 | 資本市場 |
| SEAZEN GROUP LIMITED | 1,720 | 780 | 556 | 7,741 | 不動産管理・開発 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 2,920 | 1,220 | 875 | 12,193 | 資本市場 |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD | 7,890 | 4,610 | 1,170 | 16,299 | 保険 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 460 | 320 | 870 | 12,115 | 医薬品 |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 3,340 | 1,640 | 970 | 13,514 | 不動産管理・開発 |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD | 1,215 | 1,235 | 433 | 6,034 | 建設・土木 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD | 3,285 | 1,955 | 762 | 10,613 | 資本市場 |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP | 9,860 | 9,860 | 0 | 0 | 半導体・半導体製造装置 |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD | 850 | 200 | 90 | 1,255 | 自動車部品 |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD | 3,230 | 3,230 | 0 | 0 | 食品 |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD | 960 | 720 | 672 | 9,360 | 商業サービス・用品 |
| JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD | 940 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD | 598 | 260 | 295 | 4,118 | 資本市場 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD | 7,170 | 3,700 | 1,739 | 24,206 | 銀行 |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD | 430 | 200 | 1,196 | 16,648 | 食品 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 740 | 320 | 411 | 5,728 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD | 1,180 | 630 | 2,119 | 29,509 | 商業サービス・用品 |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD | - | 630 | 311 | 4,340 | 不動産管理・開発 |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD | - | 167 | 1,603 | 22,316 | ヘルスケア・テクノロジー |
| CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD | 3,080 | - | - | - | 自動車部品 |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD | - | 190 | 199 | 2,777 | 各種消費者サービス |
| A-LIVING SERVICES CO LTD | - | 160 | 628 | 8,752 | 商業サービス・用品 |
| CHINA TOWER CORP LTD | 38,060 | 21,000 | 3,633 | 50,571 | 各種電気通信サービス |
| XIAOMI CORP | 3,356 | 5,190 | 5,397 | 75,134 | コンピュータ・周辺機器 |
| WUXI APPTCE CO LTD | - | 96 | 1,008 | 14,044 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| MEITUAN DIANPING | 294 | 502 | 5,020 | 69,878 | インターネット販売・通信販売 |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD | - | 100 | 320 | 4,454 | ホテル・レストラン・レジャー |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY-RTS | 114 | - | - | - | 電気設備 |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 2,760 | 2,200 | 1,036 | 14,423 | 半導体・半導体製造装置 |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | - | 400 | 1,334 | 18,569 | バイオテクノロジー |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD | 7,960 | 4,560 | 674 | 9,394 | 資本市場 |
| LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD | 1,340 | 640 | 819 | 11,403 | 不動産管理・開発 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD | 1,480 | 825 | 2,945 | 40,997 | 機械 |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD | - | 280 | 372 | 5,183 | 各種消費者サービス |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | - | 720 | 683 | 9,511 | 専門小売り |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | - | 160 | 467 | 6,503 | 医薬品 |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 1,208.61 | 645.61 | 1,649 | 22,961 | 不動産管理・開発 |
| LUYE PHARMA GROUP LTD | 1,080 | 530 | 203 | 2,832 | 医薬品 |
| CAR INC | 680 | - | - | - | 陸運・鉄道 |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 390 | 240 | 387 | 5,398 | 半導体・半導体製造装置 |
| CGN POWER CO LTD | 9,810 | 5,450 | 1,040 | 14,490 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| FULLSHARE HOLDINGS LTD | 6,950 | - | - | - | 電気設備 |
| BAIC MOTOR CORP LTD | 1,635 | 820 | 269 | 3,755 | 自動車 |
| GF SECURITIES CO LTD | 1,120 | 756 | 637 | 8,871 | 資本市場 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | 512 | 216 | 368 | 5,129 | 自動車部品 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD | 1,458 | 726 | 930 | 12,955 | 資本市場 |
| 3SBIO INC | 1,290 | 780 | 679 | 9,456 | バイオテクノロジー |
| LEGEND HOLDINGS CORP | 315 | 135 | 127 | 1,781 | コンピュータ・周辺機器 |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 1,605 | 1,040 | 500 | 6,963 | 医薬品 |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD | 9,040 | 5,210 | 463 | 6,454 | 資本市場 |
| CHINA LITERATURE LTD | 240 | 60 | 186 | 2,589 | メディア |
| DALI FOODS GROUP CO LTD | 1,880 | 780 | 373 | 5,200 | 食品 |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD | 1,410 | 270 | 104 | 1,458 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA REINSURANCE GROUP CORP | 5,250 | 4,850 | 446 | 6,211 | 保険 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|---------------------|---------------------|-----------|-------------|-------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| MEITU INC | 1,525 | — | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| BOC AVIATION LTD | 194 | 131 | 650 | 9,053 | 商社・流通業 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD | 230 | 87 | 227 | 3,172 | 保険 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD | 960 | 768 | 907 | 12,636 | 資本市場 |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 445 | 390 | 4,543 | 63,245 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| HENG TEN NETWORKS GROUP LTD | 20,960 | — | — | — | インターネット販売・通信販売 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数 | 459,608 | 6,397,743 | |
| | 892,466.75 207銘柄 | 455,669.75 207銘柄 | — | <15.5%> | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾・ドル | 千円 | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | — | 210 | 4,326 | 15,530 | 通信機器 |
| ACER INC | 2,785.32 | 1,405.32 | 2,213 | 7,946 | コンピュータ・周辺機器 |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 675.54 | 365.54 | 7,237 | 25,983 | コンピュータ・周辺機器 |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 456.16 | 256.16 | 5,904 | 21,197 | 半導体・半導体製造装置 |
| ASIA CEMENT CORP | 1,949.28 | 939.28 | 4,085 | 14,668 | 建設資材 |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP | 310 | 170 | 3,289 | 11,809 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 3,714.57 | 3,627.79 | 3,809 | 13,674 | 銀行 |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP | 850 | 410 | 2,796 | 10,038 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD | 650 | 250 | 2,325 | 8,346 | コンピュータ・周辺機器 |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 549.75 | 399.75 | 3,269 | 11,739 | コンピュータ・周辺機器 |
| QUANTA COMPUTER INC | 2,608.58 | 1,358.58 | 8,531 | 30,629 | コンピュータ・周辺機器 |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 920.7 | 320.7 | 1,324 | 4,754 | 不動産管理・開発 |
| EVA AIRWAYS CORP | 1,962.69 | 841.25 | 866 | 3,110 | 旅客航空輸送業 |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 627.6 | 337.6 | 7,325 | 26,300 | コンピュータ・周辺機器 |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 5,123.45 | 2,347.71 | 4,765 | 17,109 | 銀行 |
| CHINA AIRLINES | 2,321.56 | 681.56 | 488 | 1,754 | 旅客航空輸送業 |
| CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO | 1,961.69 | 1,241.69 | 4,109 | 14,754 | 自動車部品 |
| CHINA STEEL CORP | 12,110.58 | 5,780.58 | 11,416 | 40,985 | 金属・鉱業 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN | 2,649.94 | 1,779.94 | 3,533 | 12,684 | 保険 |
| ADVANTECH CO LTD | 298.89 | 138.89 | 3,875 | 13,911 | コンピュータ・周辺機器 |
| COMPAL ELECTRONICS INC | 3,913.04 | 2,393.04 | 4,474 | 16,065 | コンピュータ・周辺機器 |
| DELTA ELECTRONICS INC | 1,976.63 | 966.63 | 13,001 | 46,674 | 電子装置・機器・部品 |
| NANYA TECHNOLOGY CORP | 1,080 | 670 | 4,093 | 14,696 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 3,573.27 | 1,753.27 | 19,022 | 68,292 | 各種電気通信サービス |
| AU OPTRONICS CORP | 8,731.94 | 3,911.94 | 2,883 | 10,350 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 1,468 | 778 | 8,246 | 29,606 | 無線通信サービス |
| EVERGREEN MARINE CORP | 1,982.76 | 988.2 | 1,012 | 3,636 | 海運業 |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 3,218.24 | 1,788.24 | 4,443 | 15,953 | コングロメリット |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 298.25 | 203.07 | 2,964 | 10,643 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ECLAT TEXTILE CO LTD | 153.22 | 73.22 | 2,050 | 7,360 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 512.85 | 242.85 | 4,492 | 16,128 | 半導体・半導体製造装置 |
| FORMOSA PLASTICS CORP | 4,246.33 | 2,166.33 | 18,023 | 64,705 | 化学 |
| FORMOSA TAFFETA CO LTD | 950 | 190 | 606 | 2,175 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO | 3,355.94 | 1,755.94 | 12,484 | 44,820 | 化学 |
| GIANT MANUFACTURING | 301.51 | 111.51 | 1,577 | 5,664 | レジャー用品 |
| MEDIATEK INC | 1,435.07 | 745.07 | 27,418 | 98,432 | 半導体・半導体製造装置 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | 6,319.36 | 3,249.36 | 13,192 | 47,360 | 保険 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 6,342.32 | 3,994.59 | 7,449 | 26,745 | 銀行 |
| HOTAI MOTOR CO LTD | 260 | 150 | 7,515 | 26,978 | 専門小売り |
| FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD | 1,440 | 690 | 4,547 | 16,324 | 無線通信サービス |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 8,761.41 | 5,141.41 | 8,663 | 31,101 | 各種金融サービス |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 7,749.2 | 3,769.41 | 14,399 | 51,692 | 保険 |
| CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING | 12,234.03 | 7,584.03 | 6,522 | 23,414 | 保険 |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD | 9,361.68 | 5,255.45 | 13,821 | 49,620 | 銀行 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 12,492.25 | 6,082.25 | 46,103 | 165,511 | 電子装置・機器・部品 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 10,264.95 | 5,214.95 | 15,149 | 54,386 | 銀行 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 92.2 | 52.2 | 20,097 | 72,148 | 電子装置・機器・部品 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 9,785.89 | 4,285.93 | 5,250 | 18,848 | 銀行 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 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 | | | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾・ドル | 千円 | | | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO | 9,430.61 | 4,830.61 | 4,077 | 14,636 | | | 保険 |
| INVENTEC CO LTD | 2,060.05 | 1,460.05 | 3,445 | 12,370 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 1,848.45 | 938.45 | 4,030 | 14,470 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 10,584.43 | 4,714.43 | 5,610 | 20,140 | | | 銀行 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | 16,720.48 | 9,120.48 | 17,876 | 64,175 | | | 銀行 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD | 9,322.2 | 5,028.52 | 10,559 | 37,910 | | | 銀行 |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC | 855.6 | 355.6 | 3,449 | 12,383 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| NAN YA PLASTICS CORP | 4,898.28 | 2,528.28 | 15,194 | 54,549 | | | 化学 |
| WISTRON CORP | 2,669.16 | 1,359.16 | 3,540 | 12,710 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| POU CHEN CORP | 2,289.9 | 1,459.9 | 4,168 | 14,963 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP | 4,622.97 | 2,402.97 | 16,292 | 58,488 | | | 食品 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 543.92 | 293.92 | 8,435 | 30,283 | | | 食品・生活必需品小売り |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 1,084.8 | 484.8 | 4,004 | 14,375 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PHISON ELECTRONICS CORP | 126.58 | 56.58 | 1,530 | 5,494 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 543.93 | 283.93 | 1,186 | 4,260 | | | 不動産管理・開発 |
| RUENTEX INDUSTRIES LTD | 338.29 | 118.29 | 785 | 2,819 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 955.88 | 455.88 | 2,484 | 8,919 | | | 電子装置・機器・部品 |
| STANDARD FOODS CORP | 346.39 | 256.39 | 1,681 | 6,038 | | | 食品 |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP | 1,518.99 | 478.99 | 1,841 | 6,611 | | | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN CEMENT CORP | 4,445.61 | 2,496.84 | 10,486 | 37,647 | | | 建設資材 |
| TATUNG CO LTD | 1,640 | 610 | 1,381 | 4,960 | | | 家庭用耐久財 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR | 23,370.83 | 12,020.83 | 368,438 | 1,322,693 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 11,565.25 | 5,665.25 | 8,526 | 30,609 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| WINBOND ELECTRONICS CORP | 3,180 | 2,170 | 2,886 | 10,361 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| YAGEO CORP | 231.6 | 131.6 | 4,467 | 16,039 | | | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 2,030 | 1,090 | 3,515 | 12,619 | | | 運送インフラ |
| INNOLUX CORPORATION | 8,203.45 | 5,143.45 | 3,214 | 11,540 | | | 電子装置・機器・部品 |
| WPG HOLDINGS CO LTD | 1,432.03 | 722.03 | 2,725 | 9,785 | | | 電子装置・機器・部品 |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 190.73 | 86.45 | 2,118 | 7,603 | | | 機械 |
| TAIMED BIOLOGICS INC | 180 | - | - | - | | | バイオテクノロジー |
| PEGATRON CORP | 1,925.54 | 1,025.54 | 6,676 | 23,967 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 90 | 40 | 1,988 | 7,136 | | | 機械 |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP | 310 | 140 | 3,836 | 13,771 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 1,117.37 | 650.29 | 6,470 | 23,228 | | | 各種金融サービス |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD | 453.85 | 223.85 | 2,294 | 8,237 | | | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING | 8,394.12 | 4,516.74 | 8,988 | 32,268 | | | 銀行 |
| SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD | 2,990 | 1,769.93 | 7,557 | 27,131 | | | 銀行 |
| WIWYNN CORP | - | 30 | 1,989 | 7,140 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 3,329.03 | 1,779.03 | 11,883 | 42,663 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| GLOBALWAFERS CO LTD | 190 | 90 | 3,415 | 12,261 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 150 | 60 | 1,263 | 4,534 | | | 家庭用耐久財 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | | | |
| | 311,006.96 87銘柄 | 164,158.29 88銘柄 | 949,323 - | 3,408,070 <8.3%> | | | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | | |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 227.56 | 97.78 | 148 | 20,040 | | | 金属・鉱業 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 金額 <比率> | 金額 <比率> | | | |
| | 227.56 1銘柄 | 97.78 1銘柄 | 148 - | 20,040 <0.0%> | | | |
| (トルコ) | 百株 | 百株 | 千トルコ・リラ | 千円 | | | |
| AKBANK TAS | 2,958.91 | 1,660.79 | 961 | 15,029 | | | 銀行 |
| ANADOLU EFES BIRACLIK VE MALT SANAYII AS | 197.24 | 35.73 | 65 | 1,028 | | | 飲料 |
| ARCELIK | 189.02 | 8.01 | 12 | 192 | | | 家庭用耐久財 |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 317.66 | 91.92 | 249 | 3,896 | | | 航空宇宙・防衛 |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS | 1,259.6 | 887.23 | 730 | 11,412 | | | 金属・鉱業 |
| FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 59.19 | 46.68 | 270 | 4,224 | | | 自動車 |
| KOC HOLDING AS | 673.25 | 302.17 | 453 | 7,093 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| PETKIM PETROKIMYA HOLDING | 881.74 | - | - | - | | | 化学 |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS | 543.97 | - | - | - | | | コンピュータ・周辺機器 |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|--------------------|-------------------|--------------|---------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (フィリピン) | 百株 | 百株 | 千フィリピン・ペソ | 千円 | |
| METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP | 11,489 | 3,529 | 952 | 2,019 | 各種金融サービス |
| ABOITIZ POWER CORP | 1,282 | 510 | 1,366 | 2,897 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| MANILA ELECTRIC COMPANY | 234.3 | 148 | 3,981 | 8,440 | 電力 |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC | 91.37 | 24.11 | 1,181 | 2,504 | コンプロマリット |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 109,019 | 231,121 | |
| | 60,163.4 23銘柄 | 22,569.15 21銘柄 | - | <0.6%> | |
| (チリ) | 百株 | 百株 | 千チリ・ペソ | 千円 | |
| BANCO SANTANDER CHILE | 64,144.7 | 27,996.58 | 91,828 | 11,597 | 銀行 |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES | 47.7 | 33.79 | 96,301 | 12,162 | 銀行 |
| BANCO DE CHILE | 22,134.93 | 25,958.42 | 184,564 | 23,310 | 銀行 |
| EMPRESAS CMPC SA | 1,115.77 | 390.74 | 63,897 | 8,070 | 紙製品・林産品 |
| EMPRESAS COPEC SA | 376.73 | 180.31 | 92,336 | 11,662 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 130.24 | 53.63 | 35,663 | 4,504 | 飲料 |
| ENTEL CHILE SA | 135.72 | 66.1 | 28,489 | 3,598 | 無線通信サービス |
| ENEL AMERICAS SA | 28,187.18 | 19,544.64 | 266,784 | 33,694 | 電力 |
| COLBUN SA | 8,191.36 | 2,568.74 | 29,861 | 3,771 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AGUAS ANDINAS SA | 2,240.14 | 868.53 | 22,581 | 2,852 | 水道 |
| EMBOTELLADORA ANDINA SA | 404.01 | 200.26 | 37,849 | 4,780 | 飲料 |
| LATAM AIRLINES GROUP SA | 306.55 | 38.99 | 12,355 | 1,560 | 旅客航空輸送業 |
| SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA | 106.24 | 40.1 | 76,049 | 9,605 | 化学 |
| FALABELLA SA | 674.78 | 514.1 | 113,102 | 14,284 | 複合小売り |
| ITAU CORPBANCA | 132,369.77 | 12,369.77 | 2,981 | 376 | 銀行 |
| CENCOSUD SA | 1,511.41 | 732.05 | 71,382 | 9,015 | 食品・生活必需品小売り |
| ENEL CHILE SA | 28,910.6 | 17,039.55 | 111,609 | 14,096 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,337,638 | 168,943 | |
| | 290,987.83 17銘柄 | 108,596.3 17銘柄 | - | <0.4%> | |
| (コロンビア) | 百株 | 百株 | 千コロンビア・ペソ | 千円 | |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP | 441.5 | 216.75 | 390,150 | 10,690 | 電力 |
| ECOPETROL SA | 4,555.98 | 2,603.36 | 507,655 | 13,909 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF | 101.38 | - | - | - | 各種金融サービス |
| GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF | 3,418.31 | 1,960.73 | 185,288 | 5,076 | 銀行 |
| CEMENTOS ARGOS SA | 377.2 | - | - | - | 建設資材 |
| GRUPO ARGOS SA | 282.17 | 148.97 | 168,336 | 4,612 | 建設資材 |
| BANCOLOMBIA SA | 209.47 | 67.47 | 178,795 | 4,898 | 銀行 |
| BANCOLOMBIA SA-PREF | 449.76 | 275.34 | 758,286 | 20,777 | 銀行 |
| GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA | 240.67 | 92.36 | 222,772 | 6,103 | 各種金融サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,411,284 | 66,069 | |
| | 10,076.44 9銘柄 | 5,364.98 7銘柄 | - | <0.2%> | |
| (カタール) | 百株 | 百株 | 千カタール・リアル | 千円 | |
| QATAR INSURANCE CO SAQ | 144.17 | 822.82 | 177 | 5,248 | 保険 |
| QATAR NATIONAL BANK | 429.98 | 2,186.04 | 3,869 | 114,260 | 銀行 |
| COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC | 182.02 | 758.09 | 304 | 8,990 | 銀行 |
| OOREDOO QSC | 67.6 | 534.59 | 327 | 9,659 | 各種電気通信サービス |
| QATAR FUEL QSC | - | 292.53 | 492 | 14,555 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 50.5 | 326.18 | 482 | 14,255 | 総合公益事業 |
| QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC | - | 286.75 | 230 | 6,810 | 銀行 |
| INDUSTRIES QATAR QSC | 174.05 | 940.11 | 644 | 19,030 | コンプロマリット |
| QATAR ISLAMIC BANK SAQ | 114.06 | 589.69 | 893 | 26,381 | 銀行 |
| MASRAF AL RAYAN | 365.35 | 1,604.22 | 601 | 17,755 | 銀行 |
| BARWA REAL ESTATE CO | 167.63 | 1,000.55 | 276 | 8,163 | 不動産管理・開発 |
| EZDAN HOLDING GROUP QSC | 694.16 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO | - | 1,769.57 | 326 | 9,646 | 化学 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 8,627 | 254,757 | |
| | 2,389.52 10銘柄 | 11,111.14 12銘柄 | - | <0.6%> | |
| (サウジアラビア) | 百株 | 百株 | 千サウジアラビア・リアル | 千円 | |
| YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO | - | 124.66 | 536 | 15,445 | 化学 |
| JARIR MARKETING CO | - | 21.89 | 301 | 8,681 | 専門小売り |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|----------|----------|---------|---------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 期末 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (サウジアラビア) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | — | 20.3 | 130 | 3,756 | 保険 |
| ETIHAD ETISALAT CO | — | 207.81 | 516 | 14,856 | 無線通信サービス |
| SAUDI BRITISH BANK | — | 365.42 | 778 | 22,400 | 銀行 |
| AL RAJHI BANK | — | 578.93 | 3,085 | 88,806 | 銀行 |
| ARAB NATIONAL BANK | — | 303.9 | 561 | 16,163 | 銀行 |
| BANK ALBILAD | — | 210.92 | 434 | 12,492 | 銀行 |
| BANK AL-JAZIRA | — | 294.76 | 333 | 9,586 | 銀行 |
| BANQUE SAUDI FRANSI | — | 273.61 | 746 | 21,497 | 銀行 |
| RIYAD BANK | — | 594.73 | 915 | 26,359 | 銀行 |
| SAMBA FINANCIAL GROUP | — | 487.48 | 1,011 | 29,097 | 銀行 |
| SAUDI TELECOM CO | — | 190.84 | 1,742 | 50,145 | 各種電気通信サービス |
| SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO | — | 86.58 | 557 | 16,047 | 化学 |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | — | 353.28 | 2,691 | 77,475 | 化学 |
| SAUDI CEMENT CO | — | 27.73 | 141 | 4,062 | 建設資材 |
| SAUDI ELECTRICITY CO | — | 407.14 | 676 | 19,474 | 電力 |
| SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP | — | 76.5 | 130 | 3,742 | 化学 |
| SAVOLA GROUP | — | 140.14 | 574 | 16,536 | 食品 |
| NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO | — | 284.89 | 273 | 7,871 | 化学 |
| ALMARAI CO JSC | — | 130.48 | 626 | 18,043 | 食品 |
| EMAAR ECONOMIC CITY | — | 153.95 | 107 | 3,105 | 不動産管理・開発 |
| SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO | — | 249.29 | 346 | 9,972 | 化学 |
| ADVANCED PETROCHEMICAL CO | — | 37.51 | 164 | 4,728 | 化学 |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | — | 484.81 | 387 | 11,162 | 化学 |
| DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO | — | 208.3 | 169 | 4,879 | 不動産管理・開発 |
| RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO | — | 60.66 | 86 | 2,479 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO | — | 7.18 | 73 | 2,107 | 保険 |
| ALINMA BANK | — | 500.3 | 755 | 21,741 | 銀行 |
| SAUDI ARABIAN MINING CO | — | 225.49 | 795 | 22,908 | 金属・鉱業 |
| SAUDI AIRLINES CATERING CO | — | 31.19 | 221 | 6,373 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SAUDI ARABIAN OIL CO | — | 545.76 | 1,645 | 47,356 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NATIONAL COMMERCIAL BANK | — | 573.06 | 2,011 | 57,889 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 | 株数 | 23,531 | 677,245 | |
| | 銘柄数<比率> | 銘柄 | — | <1.6%> | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD | 2,705.06 | 1,400.2 | 171,384 | 243,365 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 729.4 | 282.46 | 10,171 | 14,443 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ASIAN PAINTS LTD | 278.04 | 144.6 | 25,395 | 36,061 | 化学 |
| EICHER MOTORS LTD | 12.23 | 5.58 | 8,241 | 11,703 | 自動車 |
| GRASIM INDUSTRIES LTD | 326.39 | 134.74 | 7,350 | 10,438 | 建設資材 |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 721.96 | 405.49 | 14,727 | 20,912 | 自動車 |
| SHREE CEMENT LTD | 8.46 | 5.11 | 9,681 | 13,748 | 建設資材 |
| ICICI BANK LTD | 2,271.54 | 2,368.52 | 88,949 | 126,308 | 銀行 |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD | 584.63 | 202.28 | 4,403 | 6,253 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| STATE BANK OF INDIA LTD | 1,709.63 | 945.52 | 18,272 | 25,946 | 銀行 |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 189.35 | 66.92 | 2,522 | 3,581 | 陸運・鉄道 |
| LIC HOUSING FINANCE LTD | 262.42 | 144.36 | 4,009 | 5,693 | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| TATA STEEL LTD | 301.06 | 138.26 | 4,055 | 5,759 | 金属・鉱業 |
| TATA MOTORS LTD | 1,561.48 | 581.68 | 4,470 | 6,347 | 自動車 |
| JSW STEEL LTD | 834.15 | 381.77 | 6,768 | 9,611 | 金属・鉱業 |
| TATA POWER CO LTD | 1,004.83 | 371.95 | 1,279 | 1,816 | 電力 |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 57.51 | 33.56 | 9,504 | 13,496 | 食品 |
| NESTLE INDIA LTD | 22.5 | 11.92 | 20,650 | 29,323 | 食品 |
| GAIL INDIA LTD | 700.27 | 979.27 | 8,784 | 12,473 | ガス |
| VEDANTA LTD | 1,150.72 | 874.77 | 7,356 | 10,446 | 金属・鉱業 |
| AXIS BANK LTD | 1,810.46 | 1,059.19 | 50,714 | 72,013 | 銀行 |
| TITAN COMPANY LTD | 276.48 | 163.05 | 15,905 | 22,585 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 1,226.55 | 1,078.1 | 8,225 | 11,680 | 石油・ガス・消耗燃料 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|----------|----------|----------|---------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | |
| COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD | — | 20.97 | 2,890 | 4,104 | パーソナル用品 |
| LUPIN LTD | 224.53 | 123.45 | 10,150 | 14,413 | 医薬品 |
| BAJAJ FINANCE LTD | 165.95 | 94.3 | 21,765 | 30,907 | 消費者金融 |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP | 1,555.5 | 808.64 | 135,900 | 192,978 | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD | 438.7 | 311.62 | 4,367 | 6,201 | メディア |
| INFOSYS LTD | 3,320.56 | 1,672.84 | 105,179 | 149,355 | 情報技術サービス |
| WIPRO LTD | 1,346.1 | 491.1 | 9,183 | 13,040 | 情報技術サービス |
| INDIAN OIL CORP LTD | 1,682.52 | 728.1 | 6,261 | 8,891 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 615.5 | 400.78 | 95,586 | 135,732 | 家庭用品 |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 518.18 | 551.59 | 25,111 | 35,657 | 情報技術サービス |
| DABUR INDIA LTD | 515.6 | 229.89 | 11,266 | 15,999 | パーソナル用品 |
| HERO MOTOCORP LTD | 45.09 | 41.43 | 7,606 | 10,800 | 自動車 |
| DR REDDYS LABORATORIES LTD | 103.89 | 58.8 | 23,105 | 32,810 | 医薬品 |
| BHARTI AIRTEL LTD | 1,351.06 | 1,217.56 | 61,176 | 86,870 | 無線通信サービス |
| UNITED SPIRITS LTD | 292.61 | 175.15 | 9,283 | 13,183 | 飲料 |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | 813.13 | 362.94 | 16,589 | 23,557 | 医薬品 |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 77.03 | 43.4 | 10,121 | 14,372 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 101.11 | 54.52 | 30,013 | 42,618 | 自動車 |
| GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD | 136.89 | — | — | — | 医薬品 |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 262.23 | 114.18 | 6,196 | 8,799 | 医薬品 |
| HAVELLS INDIA LTD | 264.92 | 156.33 | 8,263 | 11,734 | 電気設備 |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 950.48 | 426.76 | 3,704 | 5,260 | 自動車部品 |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD | 138.34 | 37.77 | 3,029 | 4,301 | 消費者金融 |
| PETRONET LNG LTD | 528.75 | 418.74 | 8,860 | 12,581 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CIPLA LTD/INDIA | 318.7 | 187.92 | 11,237 | 15,957 | 医薬品 |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 456.02 | 262.27 | 24,467 | 34,743 | 建設・土木 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 93.55 | 53.62 | 18,949 | 26,908 | 建設資材 |
| ASHOK LEYLAND LTD | 1,108.86 | 500.57 | 2,447 | 3,475 | 機械 |
| BOSCH LTD | 6.87 | 2.22 | 2,384 | 3,385 | 自動車部品 |
| TATA CONSULTANCY SERVICES LTD | 853.92 | 439.12 | 79,313 | 112,625 | 情報技術サービス |
| NTPC LTD | 2,100.66 | 1,142.12 | 10,907 | 15,488 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 74.74 | 55.89 | 4,989 | 7,084 | 医薬品 |
| YES BANK LTD | 1,622.58 | — | — | — | 銀行 |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 546.35 | 468.06 | 8,095 | 11,495 | 建設資材 |
| BHARAT FORGE LTD | 184.21 | 76.44 | 2,169 | 3,080 | 自動車部品 |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 1,161.35 | 561.31 | 6,968 | 9,895 | 金属・鉱業 |
| ITC LTD | 3,281.99 | 1,760.58 | 33,116 | 47,025 | タバコ |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 116.66 | 71.98 | 10,588 | 15,035 | 化学 |
| UNITED PHOSPHORUS LTD | 348.38 | 301.31 | 10,946 | 15,544 | 化学 |
| SIEMENS INDIA LTD | — | 26.78 | 3,207 | 4,554 | コンピュータリット |
| INFO EDGE INDIA LTD | — | 21.51 | 5,348 | 7,594 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 328.23 | 156.95 | 8,675 | 12,319 | パーソナル用品 |
| TECH MAHINDRA LTD | 455.27 | 204.62 | 10,432 | 14,814 | 情報技術サービス |
| VODAFONE IDEA LTD | 1,965.27 | — | — | — | 無線通信サービス |
| MARICO LTD | 456.6 | 282.57 | 8,481 | 12,043 | パーソナル用品 |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 5.28 | 1.91 | 3,272 | 4,646 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DLF LTD | — | 240.13 | 3,287 | 4,668 | 不動産管理・開発 |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 1,710.78 | 959.97 | 16,103 | 22,866 | 電力 |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 508.92 | 354.33 | 9,501 | 13,491 | 運送インフラ |
| REC LTD | 551.73 | 263.09 | 2,512 | 3,567 | 各種金融サービス |
| BAJAJ FINSERV LTD | 37.23 | 21.74 | 10,869 | 15,434 | 保険 |
| BAJAJ AUTO LTD | 79.67 | 33.92 | 8,070 | 11,459 | 自動車 |
| COAL INDIA LTD | 1,124.57 | 544.64 | 8,101 | 11,504 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD | 289.33 | 86.21 | 1,550 | 2,201 | 消費者金融 |
| BHARTI INFRAELECT LTD | 322.96 | 140.7 | 2,367 | 3,362 | 各種電気通信サービス |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD | 254.66 | — | — | — | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| TATA STEEL LTD-PARTLY PAID | 23.33 | 23.33 | 77 | 109 | 金属・鉱業 |

| 銘柄 | 株数 | 期首(前期末) | 当期 | | 業種等 | |
|---|------------------|--------------------|--------------------|-----------------|---------------------|--------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (インド) | | | | | | |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | 保険 | |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | — | 216.72 | 10,738 | 15,248 | 資本市場 | |
| BANDHAN BANK LTD | — | 25.14 | 6,729 | 9,556 | 銀行 | |
| BERGER PAINTS INDIA LTD | — | 99.23 | 2,146 | 3,047 | 化学 | |
| CADILA HEALTHCARE LTD | 169.62 | — | 4,102 | 5,825 | 医薬品 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 112.16 | 65.1 | 14,400 | 20,449 | 食品・生活必需品小売り | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD | — | 79.31 | 9,512 | 13,507 | 保険 | |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD | — | 115.66 | 4,278 | 6,075 | 保険 | |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 83 | 36.35 | 3,883 | 5,514 | 旅客航空輸送業 | |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | — | 149.7 | 10,515 | 14,932 | 保険 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 54,947.24 79銘柄 | 30,432.72 85銘柄 | 1,513,188 — | 2,148,727 <5.2%> | |
| (パキスタン) | | | | | | |
| MCB BANK LTD | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | 銀行 | |
| OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD | 390 | 124 | 1,909 | 1,241 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| HABIB BANK LTD | 745 | 218.68 | 2,106 | 1,369 | 銀行 | |
| HABIB BANK LTD | 544 | 193 | 2,035 | 1,322 | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,679 3銘柄 | 535.68 3銘柄 | 6,051 — | 3,933 <0.0%> | |
| (インドネシア) | | | | | | |
| BARITO PACIFIC TBK PT | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | 化学 | |
| UNITED TRACTORS TBK PT | — | 14,625 | 1,447,875 | 10,135 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT | 1,670.01 | 1,039.01 | 1,800,084 | 12,600 | 食品 | |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT | 4,588 | 2,769 | 1,730,625 | 12,114 | 家庭用品 | |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK | 1,375 | 3,608 | 2,480,500 | 17,363 | 自動車 | |
| TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK | 19,392 | 10,655 | 4,048,900 | 28,342 | 各種電気通信サービス | |
| CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT | 47,363 | 24,831 | 8,020,413 | 56,142 | 食品 | |
| GUDANG GARAM TBK PT | 6,756 | 2,440 | 1,034,560 | 7,241 | タバコ | |
| HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK | 448 | 158 | 726,800 | 5,087 | タバコ | |
| INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT | 7,955 | 4,563 | 746,050 | 5,222 | 建設資材 | |
| INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT | 1,803 | 1,098 | 1,205,055 | 8,435 | 紙製品・林産品 | |
| BUKIT ASAM TBK PT | 2,620 | 1,428 | 742,560 | 5,197 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| BANK DANAMON INDONESIA TBK PT | 2,567 | 2,300 | 455,400 | 3,187 | 銀行 | |
| BANK MANDIRI | 2,613.16 | — | — | — | 銀行 | |
| PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT | 17,900 | 9,617 | 4,212,246 | 29,485 | 紙製品・林産品 | |
| BANK RAKYAT INDONESIA | 980 | 868 | 457,870 | 3,205 | 銀行 | |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT | 52,904 | 27,728 | 7,847,024 | 54,929 | ガス | |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT | 10,641 | 4,772 | 398,462 | 2,789 | 銀行 | |
| KALBE FARMA TBK PT | 7,244 | 4,400 | 1,830,400 | 12,812 | 医薬品 | |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 18,222 | 13,344 | 1,594,608 | 11,162 | 建設資材 | |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 2,765 | 1,009 | 653,327 | 4,573 | 銀行 | |
| XL AXIATA TBK PT | 9,338 | 4,753 | 12,892,512 | 90,247 | 無線通信サービス | |
| JASA MARGA PERSERO TBK PT | — | 355 | 85,200 | 596 | 運送インフラ | |
| BUMI SERPONG DAMAI PT | 2,001.25 | 416.25 | 121,545 | 850 | 不動産管理・開発 | |
| ADARO ENERGY PT | 7,465 | 6,631 | 527,164 | 3,690 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| PAKUWON JATI TBK | 14,345 | 6,845 | 708,457 | 4,959 | 不動産管理・開発 | |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT | 16,599 | 2,185 | 92,644 | 648 | 食品 | |
| TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT | 2,385 | 774 | 789,480 | 5,526 | 各種電気通信サービス | |
| BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT | 1,808 | — | — | — | 銀行 | |
| ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT | 4,803 | 1,579 | 151,584 | 1,061 | 専門小売り | |
| PT SURYA CITRA MEDIA TBK | — | 1,104 | 147,936 | 1,035 | メディア | |
| PT SURYA CITRA MEDIA TBK | 5,113 | — | — | — | メディア | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 273,663.42 28銘柄 | 155,894.26 28銘柄 | 56,949,284 — | 398,644 <1.0%> | |
| (アラブ首長国連邦) | | | | | | |
| DUBAI ISLAMIC BANK PJSC | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | 銀行 | |
| EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC | 1,361.45 | 630.16 | 218 | 6,433 | 各種電気通信サービス | |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC | 1,648.45 | 876.04 | 1,289 | 37,937 | 銀行 | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 2,010.06 | 1,545.32 | 673 | 19,822 | 銀行 | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 2,589.74 | 1,363.91 | 1,579 | 46,466 | 銀行 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|------------------|----------|-----------|---------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アラブ首長国連邦) | 百株 | 百株 | 千円 | | |
| EMAAR PROPERTIES PJSC | 3,431.66 | 2,271.65 | 572 | 16,841 | 不動産管理・開発 |
| ALDAR PROPERTIES PJSC | 3,561.42 | 1,419.95 | 214 | 6,308 | 不動産管理・開発 |
| EMAAR DEVELOPMENT PJSC | 774.63 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| EMAAR MALLS PJSC | 1,781.66 | 953.55 | 107 | 3,170 | 不動産管理・開発 |
| DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC | 1,902.35 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 19,061.42 | 9,060.58 | 4,655 | 136,979 | |
| | 株数・金額 銘柄数<比率> | 9銘柄 | 7銘柄 | <0.3%> | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千ブラジル・リアル | 千円 | |
| BRF SA | 474.92 | 325.92 | 620 | 12,790 | 食品 |
| VALE SA | 3,005.21 | 1,557.21 | 6,851 | 141,145 | 金属・鉱業 |
| RAIA DROGASIL SA | 206 | 120 | 1,246 | 25,686 | 食品・生活必需品小売り |
| TIM PARTICIPACOES SA | 763 | 483 | 628 | 12,954 | 無線通信サービス |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA | 238.5 | 94.5 | 277 | 5,711 | 電力 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA | 198 | 178 | 461 | 9,515 | 電力 |
| BANCO DO BRASIL SA | 847 | 439 | 1,298 | 26,750 | 銀行 |
| INVESTIMENTOS ITAU SA | 4,323.6 | 2,183.6 | 1,995 | 41,113 | 銀行 |
| LOJAS AMERICANAS SA | 770.74 | 318.74 | 693 | 14,281 | 複合小売り |
| GERDAU SA | 1,010.3 | 495.3 | 609 | 12,549 | 金属・鉱業 |
| CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR | 158.06 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO | — | 65.06 | 416 | 8,577 | 食品・生活必需品小売り |
| PETROLEO BRASILEIRO SA | 2,782.1 | 1,839.1 | 3,071 | 63,268 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 328 | 382 | 703 | 14,487 | 専門小売り |
| PETROLEO BRASILEIRO SA | 3,774.12 | 2,056.12 | 3,316 | 68,320 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COGNA EDUCACAO | 1,373.68 | 642.47 | 323 | 6,670 | 各種消費者サービス |
| CCR SA | 1,214.2 | 539.2 | 684 | 14,095 | 運送インフラ |
| WEG SA | 900.72 | 424.72 | 1,633 | 33,649 | 電気設備 |
| BANCO BRADESCO SA PREF | 3,505.5 | 2,168.85 | 4,415 | 90,965 | 銀行 |
| BANCO BRADESCO SA | 997.41 | 600.25 | 1,132 | 23,333 | 銀行 |
| NATURA COSMETICOS SA | 198 | — | — | — | パーソナル用品 |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 617.06 | 195.06 | 148 | 3,049 | 金属・鉱業 |
| SUZANO SA | 523.75 | 282.75 | 1,013 | 20,875 | 紙製品・林産品 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 4,639.47 | 2,352.47 | 5,462 | 112,526 | 銀行 |
| PORTO SEGURO SA | 88 | 46 | 214 | 4,428 | 保険 |
| B2W CIA DIGITAL | 162 | 91 | 562 | 11,585 | インターネット販売・通信販売 |
| BRASKEM SA | 157.3 | 103.3 | 216 | 4,468 | 化学 |
| ENGIE BRASIL SA | 211.87 | 110.87 | 444 | 9,147 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| LOCALIZA RENT A CAR | 584.8 | 272.89 | 874 | 18,005 | 陸運・鉄道 |
| TELEFONICA BRASIL S.A. | 434.28 | 228.28 | 1,092 | 22,511 | 各種電気通信サービス |
| LOJAS RENNER SA | 713.7 | 433.37 | 1,625 | 33,477 | 複合小売り |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 358.52 | 442.04 | 621 | 12,793 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSAN SA | 162 | 101 | 540 | 11,131 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 177 | 417 | 792 | 16,321 | 電力 |
| EMBRAER SA | 656.6 | 211.6 | 202 | 4,162 | 航空宇宙・防衛 |
| M DIAS BRANCO SA | 104 | — | — | — | 食品 |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | 765.65 | 294.65 | 282 | 5,820 | 不動産管理・開発 |
| JBS SA | 900 | 453 | 965 | 19,886 | 食品 |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS | 794.49 | 549.49 | 557 | 11,477 | 電力 |
| CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO | 338.98 | 182.98 | 771 | 15,895 | 水道 |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA | 344.4 | 206.4 | 432 | 8,907 | 不動産管理・開発 |
| SUL AMERICA SA | 178.69 | — | — | — | 保険 |
| HYPERA SA | 365 | 211 | 661 | 13,630 | 医薬品 |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO | 1,987.16 | 1,013.16 | 4,005 | 82,503 | 資本市場 |
| MAGAZINE LUIZA SA | 75 | 375 | 1,672 | 34,445 | 複合小売り |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA | 408 | — | — | — | 銀行 |
| CIELO SA | 1,113.07 | 465.07 | 210 | 4,339 | 情報技術サービス |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 689 | 296 | 767 | 15,804 | 保険 |
| NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA | — | 251 | 1,395 | 28,748 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|---------------|------------------|-------------------|-------------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千ブラジル・レアル | 千円 | |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA | — | 122 | 639 | 13,169 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA | 373 | 163 | 332 | 6,849 | 食品・生活必需品小売り |
| AMBEV SA | 4,481.95 | 2,326.95 | 2,699 | 55,604 | 飲料 |
| KLABIN SA | 648 | — | — | — | 容器・包装 |
| NATURA & CO HOLDING SA | — | 345 | 1,150 | 23,694 | パーソナル用品 |
| RUMO SA | 1,080 | 571 | 1,155 | 23,807 | 陸運・鉄道 |
| IRB BRASIL RESSEGUROS S/A | 137 | 250 | 298 | 6,138 | 保険 |
| 小計 | 株数 銘柄数<比率> | 51,338.8 52銘柄 | 28,276.37 50銘柄 | 62,188 — | 1,281,077 <3.1%> |
| (チェコ) | 百株 | 百株 | 千チェコ・コルナ | 千円 | |
| KOMERCNI BANKA AS | 71.13 | 46.48 | 2,486 | 10,692 | 銀行 |
| CEZ | 150.14 | 80.01 | 3,760 | 16,170 | 電力 |
| MONETA MONEY BANK AS | 551.83 | 209.73 | 1,098 | 4,725 | 銀行 |
| 小計 | 株数 銘柄数<比率> | 773.1 3銘柄 | 336.22 3銘柄 | 7,346 — | 31,588 <0.1%> |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | |
| CHEIL WORLDWIDE INC | 75.51 | 33.54 | 56,850 | 5,042 | メディア |
| HANMI SCIENCE CO LTD | 11.87 | — | — | — | 医薬品 |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 31.24 | 15.15 | 95,899 | 8,506 | 自動車 |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC | 29.4 | 13.75 | 263,312 | 23,355 | 保険 |
| DB INSURANCE CO LTD | 48.71 | 16.28 | 61,375 | 5,444 | 保険 |
| COWAY CO LTD | 50.7 | 27.6 | 170,292 | 15,104 | 家庭用耐久財 |
| KT&G CORP | 113.07 | 59.33 | 462,774 | 41,048 | タバコ |
| S-1 CORPORATION | 14.44 | 4.87 | 40,761 | 3,615 | 商業サービス・用品 |
| KOREA GAS CORP | 24.69 | 26.07 | 70,128 | 6,220 | ガス |
| CJ CORP | 16.95 | 3.09 | 22,309 | 1,978 | コングロマリット |
| KAKAO CORP | 48.62 | 25.98 | 446,856 | 39,636 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| CJ ENM CO LTD | 9.87 | 5.63 | 63,337 | 5,618 | インターネット販売・通信販売 |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | 26.34 | 31.83 | 52,837 | 4,686 | 機械 |
| KMW CO LTD | — | 8.63 | 55,922 | 4,960 | 通信機器 |
| SK TELECOM CO LTD | 18.59 | 10.13 | 201,587 | 17,880 | 無線通信サービス |
| DAELIM INDUSTRIAL CO | 26.49 | 16.47 | 129,618 | 11,497 | 建設・土木 |
| MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD | 403.22 | 223.72 | 121,703 | 10,795 | 資本市場 |
| NCSOFT CORPORATION | 16.88 | 8.24 | 534,776 | 47,434 | 娯楽 |
| LG UPLUS CORP | 96.56 | 115.51 | 140,344 | 12,448 | 各種電気通信サービス |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT | 135.4 | 50.23 | 16,852 | 1,494 | 建設・土木 |
| POSCO INTERNATIONAL CORP | 36 | 16.34 | 21,650 | 1,920 | 商社・流通業 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 8.96 | 4.74 | 592,026 | 52,512 | パーソナル用品 |
| LG CHEM LTD | 43.91 | 22.58 | 818,525 | 72,603 | 化学 |
| LG CHEM LTD | 7.26 | 3.54 | 61,242 | 5,432 | 化学 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 2.01 | 0.78 | 52,650 | 4,670 | パーソナル用品 |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | 407.81 | 225.41 | 642,418 | 56,982 | 銀行 |
| S-OIL CORP | 43.83 | 25.95 | 174,384 | 15,467 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HANWHA SOLUTIONS CORPORATION | 82.89 | 32.34 | 46,569 | 4,130 | 化学 |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | — | 134.12 | 40,437 | 3,586 | 資本市場 |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 59.97 | 25.6 | 73,856 | 6,551 | 資本市場 |
| POSCO CHEMICAL CO LTD | 21.26 | 6.83 | 35,584 | 3,156 | 建設資材 |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 16.77 | 8.37 | 162,378 | 14,402 | 化学 |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 28.26 | 10.53 | 81,818 | 7,257 | 専門小売り |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD | 38.44 | 18.35 | 150,470 | 13,346 | 機械 |
| HYUNDAI MOBIS | 64.84 | 32.73 | 587,503 | 52,111 | 自動車部品 |
| SK HYNIX INC | 554.2 | 267.27 | 2,247,740 | 199,374 | 半導体・半導体製造装置 |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | 74.08 | 42.68 | 141,484 | 12,549 | 建設・土木 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 19.54 | 7.44 | 44,714 | 3,966 | 自動車 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 135.32 | 76.24 | 766,212 | 67,963 | 自動車 |
| HYUNDAI STEEL CO | 71.94 | 44.76 | 88,401 | 7,841 | 金属・鉱業 |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 226.06 | 158.08 | 124,567 | 11,049 | 銀行 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|----------|----------|------------|-----------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | |
| KCC CORP | 5.54 | 4.02 | 57,888 | 5,134 | 化学 |
| KIA MOTORS CORP | 251.7 | 132.1 | 394,979 | 35,034 | 自動車 |
| KOREA ZINC CO LTD | 8.38 | 4.27 | 172,508 | 15,301 | 金属・鉱業 |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP | 247.64 | 129.26 | 266,275 | 23,618 | 電力 |
| HANWHA CORP | 37.85 | 18.37 | 33,708 | 2,989 | コングロマリット |
| KOREAN AIR CO LTD | 43.87 | 8.79 | 18,371 | 1,629 | 旅客航空輸送業 |
| OCI COMPANY LTD | 18.29 | 5.28 | 20,882 | 1,852 | 化学 |
| CJ LOGISTICS | 8.6 | 4.33 | 63,867 | 5,665 | 陸運・鉄道 |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 15.09 | 12.71 | 84,140 | 7,463 | 化学 |
| KT CORP | 20.48 | - | - | - | 各種電気通信サービス |
| HLB INC | 29.94 | 17.32 | 182,206 | 16,161 | レジャー用品 |
| LG ELECTRONICS INC | 102.93 | 46.01 | 250,754 | 22,241 | 家庭用耐久財 |
| LOTTE CORP | 28.1 | 21.83 | 59,923 | 5,315 | コングロマリット |
| LG CORP | 92.19 | 46.92 | 291,373 | 25,844 | コングロマリット |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 133.62 | 51.45 | 46,870 | 4,157 | 資本市場 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCTION | 60.04 | 25.23 | 59,795 | 5,303 | 建設・土木 |
| NAVER CORP | 133.74 | 68.85 | 1,232,415 | 109,315 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD | 12.49 | 2.34 | 15,420 | 1,367 | 複合小売り |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD | 42.91 | 21.33 | 104,730 | 9,289 | 資本市場 |
| OTTOGI CORP | 1.12 | 1.21 | 64,856 | 5,752 | 食品 |
| AMOREPACIFIC GROUP | 27.61 | 8.4 | 52,500 | 4,656 | パーソナル用品 |
| KANGWON LAND INC | 106.55 | 65.2 | 162,674 | 14,429 | ホテル・レストラン・レジャー |
| POSCO | 74.46 | 38.29 | 673,904 | 59,775 | 金属・鉱業 |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 144.49 | 47.34 | 54,204 | 4,807 | 建設・土木 |
| SAMSUNG SDI CO LTD | 52.65 | 27.24 | 780,426 | 69,223 | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | 54.55 | 28.89 | 329,346 | 29,212 | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 4,532.55 | 2,336.06 | 12,007,348 | 1,065,051 | コンピュータ・周辺機器 |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD | 391.72 | 242.94 | 105,314 | 9,341 | 機械 |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD | 782.05 | 403.27 | 1,776,404 | 157,567 | コンピュータ・周辺機器 |
| SHINSEGAE CO LTD | 6.46 | 4.13 | 104,282 | 9,249 | 複合小売り |
| YUHAN CORP | 9.51 | 27.09 | 126,510 | 11,221 | 医薬品 |
| HANON SYSTEMS | 171.56 | 110.87 | 101,113 | 8,968 | 自動車部品 |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD | 56.67 | 30.18 | 74,091 | 6,571 | 保険 |
| GS HOLDINGS CORP | 47.51 | 21.16 | 82,100 | 7,282 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LG DISPLAY CO LTD | 228.49 | 108.38 | 124,637 | 11,055 | 電子装置・機器・部品 |
| CELLTRION INC | 79.64 | 46.63 | 983,893 | 87,271 | バイオテクノロジー |
| HELIXMITH CO LTD | 11.9 | 9.58 | 81,621 | 7,239 | バイオテクノロジー |
| HANA FINANCIAL GROUP | 289.14 | 154.1 | 381,397 | 33,829 | 銀行 |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 18 | 7.41 | 77,434 | 6,868 | 航空貨物・物流サービス |
| CELLTRION PHARM INC | 14.57 | - | - | - | 医薬品 |
| LOTTE SHOPPING CO | 10.03 | 5.5 | 47,630 | 4,224 | 複合小売り |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD | 67.76 | 37.37 | 181,431 | 16,092 | 保険 |
| AMOREPACIFIC CORP | 31.23 | 16.57 | 299,088 | 26,529 | パーソナル用品 |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF | 8.48 | 3.68 | 23,588 | 2,092 | パーソナル用品 |
| SAMSUNG CARD CO | 28.77 | 8.75 | 25,375 | 2,250 | 消費者金融 |
| SK INNOVATION CO LTD | 61.75 | 24.96 | 243,859 | 21,630 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 8.58 | 4.84 | 114,708 | 10,174 | 食品 |
| STX PAN OCEAN CO LTD | 183.95 | 215.02 | 70,096 | 6,217 | 海運業 |
| LG INNOTEK CO LTD | 14.4 | 6.98 | 92,485 | 8,203 | 電子装置・機器・部品 |
| SK HOLDINGS CO LTD | 30.8 | 15.27 | 287,839 | 25,531 | コングロマリット |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 380.76 | 196.69 | 636,292 | 56,439 | 銀行 |
| MEDY-TOX INC | 4.21 | 2.29 | 43,739 | 3,879 | バイオテクノロジー |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD | 66.02 | 45.7 | 103,282 | 9,161 | 航空宇宙・防衛 |
| BNK FINANCIAL GROUP INC | 249.23 | 214.32 | 102,873 | 9,124 | 銀行 |
| HANMI PHARM CO LTD | 6.53 | 4.16 | 108,992 | 9,667 | 医薬品 |
| HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD | 284.68 | 113.69 | 20,634 | 1,830 | 保険 |
| FILA HOLDINGS CORP | 43.1 | 24.24 | 80,719 | 7,159 | 繊維・アパレル・贅沢品 |

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|---------|-------|-------|--------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| BYD CO LTD | 75 | 100 | 588 | 8,961 | 自動車 |
| LOMON BILLIONS GROUP CO LTD | — | 110 | 170 | 2,605 | 化学 |
| NANJI E-COMMERCE CO LTD | — | 129 | 178 | 2,726 | メディア |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD | — | 12 | 164 | 2,500 | 電子装置・機器・部品 |
| PERFECT WORLD CO LTD/CHINA | — | 37 | 185 | 2,830 | 娯楽 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD | — | 12 | 152 | 2,328 | 飲料 |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD | — | 120 | 143 | 2,192 | 化学 |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD | — | 42 | 287 | 4,377 | 家庭用耐久財 |
| YUNDA HOLDING CO LTD | — | 54 | 168 | 2,569 | 航空貨物・物流サービス |
| GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD | — | 338 | 95 | 1,462 | 半導体・半導体製造装置 |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD | — | 151 | 172 | 2,632 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SF HOLDING CO LTD | — | 50 | 243 | 3,707 | 航空貨物・物流サービス |
| SHANDONG SINCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD | — | 65 | 147 | 2,240 | 化学 |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD | 209 | 655.9 | 543 | 8,286 | 銀行 |
| CSC FINANCIAL CO LTD | — | 63 | 220 | 3,354 | 資本市場 |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD | — | 171 | 236 | 3,609 | 化学 |
| JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD | — | 236 | 160 | 2,438 | 銀行 |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD | — | 43.2 | 147 | 2,249 | 金属・鉱業 |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD | — | 95 | 147 | 2,251 | 食品 |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD | — | 5 | 115 | 1,754 | 電子装置・機器・部品 |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD | — | 29 | 329 | 5,020 | ヘルスケア機器・用品 |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD | — | 16 | 204 | 3,117 | バイオテクノロジー |
| CAITONG SECURITIES CO LTD | — | 127 | 124 | 1,894 | 資本市場 |
| BANK OF CHENGDU CO LTD | — | 270 | 203 | 3,094 | 銀行 |
| NANJING SECURITIES CO LTD | — | 98 | 145 | 2,217 | 資本市場 |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD | — | 144 | 201 | 3,070 | 電子装置・機器・部品 |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD | — | 34 | 881 | 13,432 | ヘルスケア機器・用品 |
| HUAXI SECURITIES CO LTD | — | 155 | 164 | 2,511 | 資本市場 |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC | — | 11 | 192 | 2,930 | ソフトウェア |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD | — | 41 | 561 | 8,557 | 電気設備 |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC | — | 6 | 161 | 2,459 | 半導体・半導体製造装置 |
| WUXI APPTTEC CO LTD | — | 32 | 316 | 4,817 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD | — | 25 | 247 | 3,768 | 電子装置・機器・部品 |
| WILL SEMICONDUCTOR LTD | — | 14 | 246 | 3,750 | 半導体・半導体製造装置 |
| PETROCHINA CO LTD | 328 | 128 | 58 | 887 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD | 755 | 1,633 | 840 | 12,816 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD | 825 | 2,306 | 793 | 12,089 | 銀行 |
| BANK OF CHINA LTD | 745 | 840 | 300 | 4,582 | 銀行 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP | 513 | 351 | 160 | 2,439 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | — | 100 | 280 | 4,276 | 保険 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | — | 61 | 97 | 1,490 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 315 | 647 | 2,126 | 32,400 | 銀行 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD | 195 | 339 | 2,454 | 37,404 | 保険 |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD | 274 | 653 | 1,048 | 15,982 | 銀行 |
| SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD | 367 | 948 | 966 | 14,736 | 銀行 |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 733.2 | 1,399 | 810 | 12,344 | 銀行 |
| SAIC MOTOR CORP LTD | 109 | 175 | 332 | 5,067 | 自動車 |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD | 18 | 37 | 4,536 | 69,131 | 飲料 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD | 792 | 1,232 | 639 | 9,744 | 銀行 |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 316 | 404 | 944 | 14,394 | 資本市場 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 109 | 165 | 483 | 7,367 | 保険 |
| SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD | — | 383 | 165 | 2,521 | 運送インフラ |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD | 265 | 628 | 1,075 | 16,385 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| DAQIN RAILWAY CO LTD | 301 | 661 | 452 | 6,900 | 陸運・鉄道 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 608 | 1,598 | 576 | 8,791 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD | 616 | 1,467 | 773 | 11,782 | 建設・土木 |
| CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD | — | 736 | 312 | 4,755 | 機械 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|---------|-------|-------|--------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 360 | 242 | 316 | 4,820 | 資本市場 |
| HUAXIA BANK CO LTD | 232 | 229 | 148 | 2,261 | 銀行 |
| INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD | 104 | 228 | 682 | 10,406 | 食品 |
| BANK OF BEIJING CO LTD | 428 | 880 | 420 | 6,410 | 銀行 |
| CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD | - | 795 | 420 | 6,409 | 無線通信サービス |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD | 292 | 407 | 200 | 3,057 | 金属・鉱業 |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD | 165 | 107 | 622 | 9,492 | 建設資材 |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD | 228 | 157 | 280 | 4,280 | 資本市場 |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD | 204 | 246 | 389 | 5,930 | 不動産管理・開発 |
| CRRC CORP LTD | 847 | 1,101 | 699 | 10,654 | 機械 |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD | 102 | 138 | 1,333 | 20,316 | 医薬品 |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD | - | 366 | 332 | 5,064 | 金属・鉱業 |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD | 274 | 298 | 294 | 4,487 | 建設・土木 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD | 236 | 197 | 357 | 5,449 | 資本市場 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | - | 497 | 290 | 4,423 | 建設・土木 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | - | 71 | 302 | 4,617 | 保険 |
| HAIER SMART HOME CO LTD | - | 286 | 423 | 6,459 | 家庭用耐久財 |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD | 211 | 333 | 652 | 9,946 | 機械 |
| GD POWER DEVELOPMENT CO LTD | - | 618 | 126 | 1,921 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 110 | 36 | 128 | 1,952 | 医薬品 |
| GEMDALE CORP | - | 106 | 145 | 2,222 | 不動産管理・開発 |
| SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD | - | 75 | 161 | 2,459 | 半導体・半導体製造装置 |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD | - | 71 | 313 | 4,773 | 化学 |
| CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD | - | 99 | 211 | 3,228 | 不動産管理・開発 |
| SHANGHAI ORIENTAL PEARL GROUP CO LTD | - | 384 | 350 | 5,343 | メディア |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | - | 700 | 289 | 4,405 | 金属・鉱業 |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD | 310 | 159 | 112 | 1,710 | 資本市場 |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD | - | 120 | 92 | 1,406 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD | - | 145 | 305 | 4,653 | 電気設備 |
| OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD | - | 298 | 158 | 2,420 | エネルギー設備・サービス |
| CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD | 39 | 82 | 666 | 10,159 | 専門小売り |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD | - | 1,739 | 198 | 3,021 | 金属・鉱業 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD | - | 73 | 339 | 5,178 | 飲料 |
| NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LTD | - | 669 | 232 | 3,537 | 運送インフラ |
| AVIC CAPITAL CO LTD | 498 | 322 | 126 | 1,933 | 各種金融サービス |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD | - | 658 | 191 | 2,918 | 金属・鉱業 |
| AIR CHINA LTD | - | 284 | 193 | 2,951 | 旅客航空輸送業 |
| TBEA CO LTD | - | 457 | 360 | 5,495 | 電気設備 |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD | - | 425 | 260 | 3,976 | 建設・土木 |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD | 1,512 | 336 | 88 | 1,341 | 建設・土木 |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD | 954 | 264 | 99 | 1,512 | 建設・土木 |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD | - | 33 | 223 | 3,405 | 運送インフラ |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD | - | 69 | 217 | 3,320 | 医薬品 |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD | - | 84 | 175 | 2,675 | 自動車部品 |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD | - | 148 | 142 | 2,167 | 資本市場 |
| ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD | - | 48 | 57 | 877 | 化学 |
| SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD | 237 | 237 | 209 | 3,196 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD | 99 | 187 | 365 | 5,577 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AECC AVIATION POWER CO LTD | 95 | 93 | 211 | 3,228 | 航空宇宙・防衛 |
| BANK OF NANJING CO LTD | - | 156 | 116 | 1,773 | 銀行 |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 160 | 76 | 133 | 2,037 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD | - | 618 | 220 | 3,362 | 金属・鉱業 |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD | 532 | 282 | 172 | 2,630 | 資本市場 |
| BEIJING TONGRENTANG CO LTD | 64 | 106 | 267 | 4,082 | 医薬品 |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD | 80 | 68 | 247 | 3,764 | 金属・鉱業 |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD | - | 76 | 189 | 2,889 | 電気設備 |
| BBMG CORP | - | 542 | 178 | 2,725 | 建設資材 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|----------|-----------|-----------|--------------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD | 240 | 294 | 303 | 4,632 | 食品・生活必需品小売り |
| YANZHOU COAL MINING CO LTD | - | 186 | 160 | 2,443 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SHENERGY CO LTD | - | 464 | 249 | 3,797 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD | - | 882 | 375 | 5,726 | 旅客航空輸送業 |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD | - | 150.19 | 133 | 2,041 | 電気設備 |
| AISINO CORP | 64 | 103 | 197 | 3,017 | ソフトウェア |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC | - | 18 | 171 | 2,611 | ソフトウェア |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD | - | 65 | 293 | 4,466 | ソフトウェア |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD | 665 | 327 | 171 | 2,611 | 旅客航空輸送業 |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD | - | 1,068 | 350 | 5,338 | 建設・土木 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | - | 17 | 32 | 498 | 自動車部品 |
| XIAMEN C & D INC | - | 304 | 233 | 3,553 | 商社・流通業 |
| AVIC HELICOPTER CO LTD | - | 46 | 203 | 3,095 | 航空宇宙・防衛 |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD | - | 168 | 133 | 2,027 | 資本市場 |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD | - | 850 | 218 | 3,329 | 化学 |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD | - | 140 | 127 | 1,945 | 電気設備 |
| ZHANGZHOU PIENITZHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD | 18 | 17 | 229 | 3,493 | 医薬品 |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD | - | 17 | 165 | 2,524 | 飲料 |
| FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD | - | 114 | 369 | 5,637 | 通信機器 |
| SHANGHAI AJ GROUP CO LTD | - | 157 | 123 | 1,875 | 各種金融サービス |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD | - | 1,602 | 334 | 5,102 | 金属・鉱業 |
| SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD | - | 129 | 97 | 1,490 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD | - | 126 | 137 | 2,094 | 電気設備 |
| GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD | - | 119 | 168 | 2,573 | 運送インフラ |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD | - | 45 | 130 | 1,986 | 電子装置・機器・部品 |
| TONGWEI CO LTD | - | 116 | 148 | 2,266 | 食品 |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD | - | 53 | 140 | 2,135 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CHINA RAILWAY HI-TECH INDUSTRY CO LTD | - | 228 | 226 | 3,446 | 建設・土木 |
| CHINA JUSHI CO LTD | - | 234 | 198 | 3,031 | 建設資材 |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD | - | 53 | 358 | 5,466 | 機械 |
| HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD | 81 | 67 | 112 | 1,717 | 通信機器 |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD | - | 65 | 187 | 2,864 | 半導体・半導体製造装置 |
| SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD | - | 323.51 | 244 | 3,722 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD | - | 74 | 932 | 14,204 | 食品 |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP | - | 124 | 252 | 3,847 | 自動車部品 |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD | - | 58 | 176 | 2,694 | 電気設備 |
| DONGXING SECURITIES CO LTD | - | 132 | 144 | 2,202 | 資本市場 |
| JUNEYAO AIRLINES CO LTD | - | 128 | 125 | 1,911 | 旅客航空輸送業 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD | - | 215 | 360 | 5,488 | 資本市場 |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD | 513 | 214 | 95 | 1,451 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| HUAAN SECURITIES CO LTD | - | 165 | 123 | 1,880 | 資本市場 |
| BANK OF JIANGSU CO LTD | 324 | 218 | 129 | 1,966 | 銀行 |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD | - | 236 | 183 | 2,794 | 銀行 |
| SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD | - | 12 | 319 | 4,871 | 半導体・半導体製造装置 |
| SDIC CAPITAL CO LTD | - | 65 | 79 | 1,210 | 資本市場 |
| CHINA GRAND AUTOMOTIVE SERVICES CO LTD | - | 351 | 126 | 1,920 | 専門小売り |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD | - | 21 | 141 | 2,162 | 機械 |
| ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA | 248 | 449 | 423 | 6,459 | 資本市場 |
| SPRING AIRLINES CO LTD | - | 75 | 263 | 4,018 | 旅客航空輸送業 |
| EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD | 240 | 160 | 179 | 2,738 | 資本市場 |
| DAWNING INFORMATION INDUSTRY CO LTD | - | 75 | 345 | 5,260 | コンピュータ・周辺機器 |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LTD | - | 292 | 160 | 2,447 | 不動産管理・開発 |
| FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD | - | 106 | 335 | 5,111 | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 株数 | 株数 | 金額 | 金額 | |
| | 22,976.2 | 64,044.54 | 82,257.00 | 1,253,600.00 | |
| | 73銘柄 | 259銘柄 | - | <3.0%> | |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| AMMB HOLDINGS BHD | 1,345 | 844 | 261 | 6,454 | 銀行 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|------------------------------------|---------------|--------------|--------------|---------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千マレーシア・リンギット | 千円 | |
| GENTING PLANTATIONS BHD | 375 | 141 | 135 | 3,349 | 食品 |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 4,651 | 2,774 | 1,006 | 24,841 | 銀行 |
| DIGI.COM BHD | 2,887 | 1,208 | 553 | 13,649 | 無線通信サービス |
| MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD | 1,014.2 | 588.2 | 299 | 7,400 | 運送インフラ |
| RHB BANK BHD | 777.8 | 577.8 | 277 | 6,842 | 銀行 |
| HAP SENG CONSOLIDATED BHD | 632 | 344 | 248 | 6,135 | コンプロマリット |
| TOP GLOVE CORP BHD | 1,338 | 563 | 382 | 9,444 | ヘルスケア機器・用品 |
| GAMUDA BHD | 1,946 | 696 | 225 | 5,563 | 建設・土木 |
| GENTING BHD | 2,117 | 1,367 | 539 | 13,320 | ホテル・レストラン・レジャー |
| YTL CORP BHD | 2,837.1 | 1,070.1 | 81 | 2,019 | 総合公益事業 |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD | 202.56 | 87.56 | 117 | 2,894 | 銀行 |
| HONG LEONG BANK BHD | 624.08 | 237.08 | 325 | 8,036 | 銀行 |
| IJM CORP BHD | 2,303.6 | 1,080.6 | 189 | 4,665 | 建設・土木 |
| IOI CORP BHD | 1,872.13 | 1,222.13 | 488 | 12,059 | 食品 |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 445 | 265 | 560 | 13,820 | 食品 |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 128 | 88 | 277 | 6,842 | 飲料 |
| MALAYAN BANKING BHD | 3,662.75 | 1,785.75 | 1,375 | 33,921 | 銀行 |
| ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD | 884 | - | - | - | 銀行 |
| MISC BHD | 902.8 | 561.8 | 444 | 10,962 | 海運業 |
| NESTLE MALAYSIA BHD | 48 | 29 | 402 | 9,930 | 食品 |
| PPB GROUP BHD | 475.6 | 262.6 | 439 | 10,844 | 食品 |
| PETRONAS DAGANGAN BHD | 196 | 208 | 437 | 10,786 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PETRONAS GAS BHD | 604 | 394 | 610 | 15,065 | ガス |
| GENTING MALAYSIA BHD | 2,986 | 1,396 | 311 | 7,679 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD | 147 | - | - | - | タバコ |
| TELEKOM MALAYSIA BHD | 1,034 | 567 | 224 | 5,539 | 各種電気通信サービス |
| SP SETIA BHD | 1,367 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| TENAGA NASIONAL BHD | 3,046.5 | 1,524.5 | 1,936 | 47,763 | 電力 |
| QL RESOURCES BHD | 538 | 372 | 303 | 7,479 | 食品 |
| DIALOG GROUP BHD | 3,205.44 | 1,504.44 | 491 | 12,136 | エネルギー設備・サービス |
| PUBLIC BANK BHD(LOCAL) | 2,762.3 | 1,545.3 | 2,478 | 61,148 | 銀行 |
| AIRASIA GROUP BHD | 1,479 | 555 | 43 | 1,074 | 旅客航空輸送業 |
| CARLSBERG BREWERY-MALAY BHD | - | 70 | 197 | 4,869 | 飲料 |
| SIME DARBY BERHAD | 2,296 | 1,531 | 283 | 6,987 | コンプロマリット |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD | 1,171 | 765 | 587 | 14,494 | ヘルスケア機器・用品 |
| AXIATA GROUP BERHAD | 2,746 | 1,528 | 582 | 14,362 | 無線通信サービス |
| MAXIS BHD | 2,384 | 910 | 496 | 12,257 | 無線通信サービス |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 2,331 | 1,323 | 747 | 18,440 | 化学 |
| IHH HEALTHCARE BHD | 2,137 | 1,148 | 599 | 14,783 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD | 1,092 | 145 | 56 | 1,402 | 運送インフラ |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD | 1,240 | 880 | 340 | 8,401 | 金属・鉱業 |
| SIME DARBY PROPERTY BHD | 2,327 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| SIME DARBY PLANTATION BHD | 2,161 | 876 | 425 | 10,502 | 食品 |
| IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD | 1,745.48 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 株数 70,464.34 | 株数 33,034.86 | 19,788 | 488,177 | |
| | 銘柄数 <比率> 44銘柄 | 銘柄数 40銘柄 | - | <1.2%> | |
| (南アフリカ) | 百株 | 百株 | 千南アフリカ・ランド | 千円 | |
| BIDVEST GROUP LTD | 334.72 | 159.91 | 2,299 | 13,221 | コンプロマリット |
| CLICKS GROUP LTD | 224.23 | 108.58 | 2,924 | 16,813 | 食品・生活必需品小売り |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD | 453.11 | - | - | - | 専門小売り |
| DISCOVERY LTD | 358.24 | 226.58 | 1,910 | 10,982 | 保険 |
| REDEFINE PROPERTIES LTD | 5,458.11 | - | - | - | エクイティ不動産投資信託 (REITs) |
| GOLD FIELDS LTD | 699.36 | 437.64 | 5,263 | 30,267 | 金属・鉱業 |
| REMGRO LTD | 506.21 | 228.62 | 2,989 | 17,191 | 各種金融サービス |
| THE FOSCHINI GROUP LTD | 198.73 | 75.72 | 588 | 3,386 | 専門小売り |
| NORTHAM PLATINUM LTD | - | 126.32 | 1,090 | 6,271 | 金属・鉱業 |
| MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD | 808.77 | 395.05 | 662 | 3,811 | 保険 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|------------|------------|------------|----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (南アフリカ) | 百株 | 百株 | 千南アフリカ・ランド | 千円 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 2,898.26 | — | — | — | エクイティ不動産投資信託 (REITs) |
| EXXARO RESOURCES LTD | 248.46 | 79.98 | 912 | 5,247 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 37.04 | 26.28 | 2,390 | 13,747 | 銀行 |
| LIBERTY HOLDINGS LTD | 114.38 | 54.22 | 366 | 2,109 | 保険 |
| MTN GROUP LTD | 1,626.78 | 867.7 | 4,577 | 26,318 | 無線通信サービス |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 405.22 | 216.67 | 8,933 | 51,367 | 金属・鉱業 |
| TELKOM SA SOC LTD | 220.8 | 74.7 | 157 | 904 | 各種電気通信サービス |
| FIRSTRAND LTD | 3,195.17 | 1,694.08 | 6,381 | 36,694 | 各種金融サービス |
| PSG GROUP LTD | 149.38 | 49.09 | 691 | 3,975 | 各種金融サービス |
| NASPERS LTD | 416.43 | 217.22 | 60,290 | 346,669 | インターネット販売・通信販売 |
| NEDBANK GROUP LTD | 387.61 | 213.34 | 2,016 | 11,592 | 銀行 |
| NETCARE LTD | 1,054.65 | — | — | — | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PICK'N PAY STORES LTD | 312.55 | 149.15 | 901 | 5,180 | 食品・生活必需品小売り |
| RMB HOLDINGS LTD | 611.74 | 412 | 2,060 | 11,845 | 各種金融サービス |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 50.42 | 30.72 | 2,790 | 16,045 | 金属・鉱業 |
| SAPPI LTD | 538.82 | — | — | — | 紙製品・林産品 |
| SASOL LTD | 537.28 | 228.48 | 1,316 | 7,567 | 化学 |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 433.8 | 192.18 | 2,286 | 13,147 | 食品・生活必需品小売り |
| MR PRICE GROUP LTD | 234.11 | 148.01 | 1,938 | 11,148 | 専門小売り |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 1,235.96 | 649.38 | 6,710 | 38,582 | 銀行 |
| SPAR GROUP LTD/THE | 200.38 | 80.76 | 1,493 | 8,588 | 食品・生活必需品小売り |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 880.09 | 611.53 | 1,847 | 10,622 | 複合小売り |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | 345.76 | 206.4 | 2,301 | 13,232 | 医薬品 |
| ABSA GROUP LTD | 698.64 | 307.37 | 2,560 | 14,722 | 銀行 |
| TIGER BRANDS LTD | 159.65 | 72.48 | 1,294 | 7,442 | 食品 |
| SANLAM LTD | 1,713.29 | 960.98 | 5,264 | 30,269 | 保険 |
| INVESTEC LTD | 295.37 | 252.13 | 931 | 5,353 | 資本市場 |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | — | 412.26 | 4,452 | 25,601 | 金属・鉱業 |
| KUMBA IRON ORE LTD | 53.27 | 30.74 | 1,055 | 6,070 | 金属・鉱業 |
| MONDI LTD | 108.66 | — | — | — | 紙製品・林産品 |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD | 1,371.82 | 806.61 | 1,475 | 8,482 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| RMI HOLDINGS | 555.7 | 482.13 | 1,148 | 6,606 | 保険 |
| VODACOM GROUP PTY LTD | 626.12 | 323.22 | 3,899 | 22,422 | 無線通信サービス |
| NEPI ROCKCASTLE PLC | 329.83 | 151.82 | 1,381 | 7,943 | 不動産管理・開発 |
| OLD MUTUAL LTD | 4,758.87 | 2,218.19 | 2,757 | 15,853 | 保険 |
| REINET INVESTMENTS SCA | 139.93 | 80.54 | 2,318 | 13,328 | 資本市場 |
| PEPKOR HOLDINGS LTD | — | 166.33 | 189 | 1,089 | 専門小売り |
| MULTICHOICE GROUP LTD | 407.24 | 249.88 | 2,264 | 13,018 | メディア |
| SIBANYE STILLWATER LTD | — | 912.18 | 3,029 | 17,418 | 金属・鉱業 |
| FORTRESS REIT LTD-A | 1,029.5 | — | — | — | エクイティ不動産投資信託 (REITs) |
| BID CORP LTD | 323.21 | 175.18 | 4,067 | 23,386 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数 < 銘柄数 > | 株数 < 銘柄数 > | 166,181 | 955,545 | |
| | | | — | < 2.3% > | |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千タイ・パーツ | 千円 | |
| BANGKOK BANK PCL | 220 | 235 | 2,690 | 8,933 | 銀行 |
| BERLI JUCKER PCL NVDR | 1,236 | 779 | 3,096 | 10,280 | 食品・生活必需品小売り |
| KRUNG THAI BANK PCL NVDR | 3,480 | 1,462 | 1,578 | 5,242 | 銀行 |
| RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR | — | 236 | 1,398 | 4,642 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ROBINSON PCL-NVDR | 388 | — | — | — | 複合小売り |
| SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR | 1,739 | 297 | 2,056 | 6,828 | 銀行 |
| TRUE CORP PCL NVDR | 10,747.55 | 5,859.55 | 1,933 | 6,419 | 各種電気通信サービス |
| KASIKORN BANK PCL NVDR | 621 | 352 | 3,484 | 11,569 | 銀行 |
| TMB BANK PCL -NVDR | 10,100 | 13,362 | 1,202 | 3,992 | 銀行 |
| IRPC PCL NVDR | 10,609 | 3,796 | 979 | 3,251 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR | 1,720 | 2,119 | 1,186 | 3,939 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR | 131 | 164 | 3,919 | 13,013 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHIN CORP PCL | — | 1,002 | 4,859 | 16,134 | 無線通信サービス |

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

| 銘柄 | 柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|--------------------------------|------------------|-----------------------|-------------------------|--------------|------------|----|--|----------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (ハンガリー) | | 百株 | 百株 | 千ハンガリー・フォリント | 千円 | | | |
| RICHTER GEDEON NYRT | | 131.04 | 75.42 | 48,495 | 16,095 | | | 医薬品 |
| MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT | | 349.34 | 179.55 | 37,274 | 12,371 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| OTP BANK NYRT | | 214.83 | 115.07 | 97,521 | 32,367 | | | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 695.21 3銘柄 | 370.04 3銘柄 | 183,291 | 60,834 | | | |
| (ユーロ…ベルギー) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | | |
| TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA | | — | 27 | 30 | 3,596 | | | 建設資材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | — 1銘柄 | 27 1銘柄 | 30 | 3,596 | | | |
| (ユーロ…ギリシャ) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | | |
| ALPHA BANK A.E. | | 1,257.32 | 383.28 | 26 | 3,056 | | | 銀行 |
| NATIONAL BANK OF GREECE | | — | 263.48 | 30 | 3,615 | | | 銀行 |
| TITAN CEMENT CO. S.A. | | 40.89 | — | — | — | | | 建設資材 |
| HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | | 220.51 | 145.18 | 170 | 19,953 | | | 各種電気通信サービス |
| FF GROUP | | 31.3 | 31.3 | 0 | 0 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| EUROBANK ERGASIAS SERVICES | | — | 748.45 | 27 | 3,212 | | | 銀行 |
| MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN | | 58.47 | 22.65 | 31 | 3,723 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| OPAP SA | | 198.46 | 91.84 | 62 | 7,355 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| JUMBO SA | | 115.02 | 54.3 | 75 | 8,838 | | | 専門小売り |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,921.97 7銘柄 | 1,740.48 8銘柄 | 424 | 49,755 | | | |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,324,818.12 963銘柄 | 1,249,512.59 1,180銘柄 | — | 26,646,081 | | | |

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

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

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

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

(2) 外国新株予約権証券

| 銘柄 | 柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|------------------------------|-------------------|---------------|--------------|---------|--------|----|--|
| | | 証券数 | 証券数 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (タイ) | | | | 千タイ・バーツ | 千円 | | |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | | 証券 59,033 | 証券 — | — | — | | |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | | — | 9,465 | 21 | 70 | | |
| 合計 | 証券数・金額 銘柄数<比率> | 59,033 1銘柄 | 9,465 1銘柄 | — | 70 | | |

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|---------------|-------|----------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 外国 MINI MSCI EMG MKT | 百万円 14,340 | | 百万円 - |

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

■投資信託財産の構成

2020年4月20日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|------------------|-----|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 | 率 |
| 株 式 | 千円 26,646,081 | | % 64.5 |
| 新 株 予 約 権 証 券 | 70 | | 0.0 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券、投 資 証 券 | 184,052 | | 0.4 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等、そ の 他 | 14,474,036 | | 35.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 41,304,240 | | 100.0 |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、40,906,088千円、99.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年4月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.89円、1香港・ドル=13.92円、1台湾・ドル=3.59円、1イギリス・ポンド=134.75円、1トルコ・リラ=15.63円、1メキシコ・ペソ=4.49円、1フィリピン・ペソ=2.12円、100チリ・ペソ=12.63円、100コロンビア・ペソ=2.74円、1カタール・リアル=29.53円、1サウジアラビア・リアル=28.78円、1インド・ルピー=1.42円、1パキスタン・ルピー=0.65円、100インドネシア・ルピア=0.70円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.42円、1ブラジル・レアル=20.60円、1チェコ・コルナ=4.30円、100韓国・ウォン=8.87円、1オフショア・人民元=15.24円、1マレーシア・リングギット=24.67円、1南アフリカ・ランド=5.75円、1タイ・バーツ=3.32円、1ポーランド・ズロチ=25.87円、100ハンガリー・フォリント=33.19円、1ユーロ=117.27円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年4月20日)現在

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

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

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

たわらノーロード 全世界株式 27,656,092円
One DC 新興国株式インデックスファンド 26,232,767円
マネックス資産設計ファンド エボリューション 441,719,912円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) 398,227,441円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) 400,152,689円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30) 712,425,282円
投資のソムリエ 12,196,710,455円
クルーズコントロール 530,462,496円
投資のソムリエ<DC年金> 1,153,569,344円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 363,111,843円
クルーズコントロール<DC年金> 603,694円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) 7,287,401円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) 19,375,965円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 423,849,540円
リスク抑制世界8資産バランスファンド 4,153,309,653円
ワールドアセットバランス (基本コース) 1,464,721,356円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 915,052,973円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 7,341,516円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 4,897,797円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 3,862,935円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 8,646,549円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 1,221,142,588円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 316,194,620円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 1,491,414円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 692,778円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 940,124円
エマージング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用) 179,615,850円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 425,370,792円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 318,695,555円
期末元本合計 42,338,367,514円

■損益の状況

当期 自2019年4月19日 至2020年4月20日

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

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2020年4月20日）

（計算期間 2019年4月19日～2020年4月20日）

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|------------------|--------|-------|--|-------|--------|--------|---------------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | | |
| 8期 (2016年4月18日) | 17,120 | △6.9% | 81,716.02 | △3.9% | 96.5% | — | 百万円 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 |
| 12期 (2020年4月20日) | 19,435 | 1.2% | 88,952.63 | △5.0% | 96.5% | — | 78,076 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

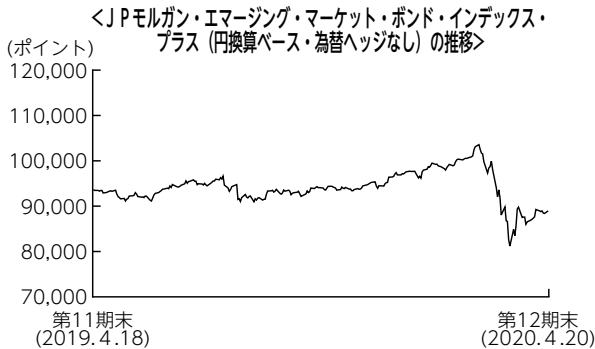
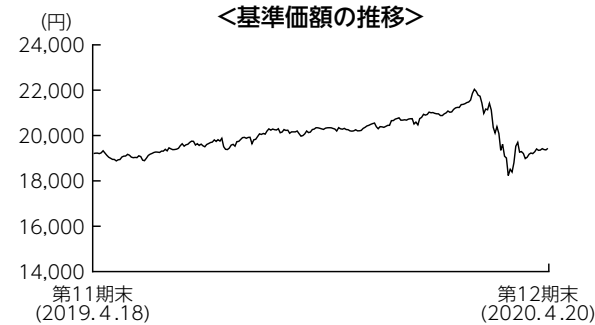
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | JPモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 債券組入 比 | 債券先物 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--|--------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2019 年 4 月 18 日 | 円 19,206 | % - | ポイント 93,647.60 | % - | % 97.5 | % - |
| 4 月 末 | 19,229 | 0.1 | 92,912.02 | △0.8 | 96.7 | - |
| 5 月 末 | 19,071 | △0.7 | 92,204.77 | △1.5 | 96.5 | - |
| 6 月 末 | 19,439 | 1.2 | 94,614.26 | 1.0 | 96.0 | - |
| 7 月 末 | 19,755 | 2.9 | 95,975.11 | 2.5 | 96.3 | - |
| 8 月 末 | 20,076 | 4.5 | 91,872.88 | △1.9 | 96.2 | - |
| 9 月 末 | 20,162 | 5.0 | 93,068.15 | △0.6 | 96.2 | - |
| 10 月 末 | 20,287 | 5.6 | 93,980.92 | 0.4 | 97.6 | - |
| 11 月 末 | 20,526 | 6.9 | 95,246.45 | 1.7 | 98.0 | - |
| 12 月 末 | 20,744 | 8.0 | 97,704.58 | 4.3 | 96.6 | - |
| 2020 年 1 月 末 | 21,083 | 9.8 | 99,206.38 | 5.9 | 98.3 | - |
| 2 月 末 | 21,430 | 11.6 | 99,779.17 | 6.5 | 87.9 | - |
| 3 月 末 | 19,292 | 0.4 | 87,584.44 | △6.5 | 113.2 | - |
| (期 末) 2020 年 4 月 20 日 | 19,435 | 1.2 | 88,952.63 | △5.0 | 96.5 | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2019年4月19日から2020年4月20日まで）



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

基準価額の推移

当期末の基準価額は19,435円となり、前期末比で1.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国金利の低下や債券の利息収入を主因に、基準価額は上昇しました。

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○国別構成比 期首（前期末）

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

期末

| 国 | ファンド | ベンチマーク | 差 | |
|-----------|--------|--------|--------|--------|
| 中南米 | アルゼンチン | 0.0% | 4.9% | △4.9% |
| | ブラジル | 10.0% | 8.6% | 1.4% |
| | メキシコ | 15.3% | 13.4% | 1.9% |
| | パナマ | 5.7% | 3.9% | 1.8% |
| | ペルー | 4.6% | 2.9% | 1.7% |
| | コロンビア | 9.2% | 8.4% | 0.8% |
| | 計 | 44.7% | 42.1% | 2.7% |
| 欧州 | ハンガリー | 4.1% | 2.5% | 1.6% |
| | ロシア | 14.2% | 11.6% | 2.6% |
| | トルコ | 0.0% | 12.6% | △12.6% |
| | ウクライナ | 0.0% | 4.3% | △4.3% |
| | クロアチア | 1.8% | 1.1% | 0.7% |
| | ルーマニア | 3.5% | 2.3% | 1.2% |
| 計 | 23.6% | 34.4% | △10.8% | |
| アジア・オセアニア | インドネシア | 13.8% | 11.8% | 2.1% |
| | フィリピン | 8.8% | 8.0% | 0.8% |
| 計 | 22.6% | 19.7% | 2.9% | |
| アフリカ | 南アフリカ | 5.6% | 3.8% | 1.8% |
| | 計 | 5.6% | 3.8% | 1.8% |
| 現金など | 3.5% | - | - | |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | - | |



(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で5.0%下落しました。

当ファンドはベンチマークを6.2%上回りました。これは、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-----------|-----|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) その他費用 | 2円 | 0.011% |
| （保管費用） | (2) | (0.011) |
| （その他） | (0) | (0.000) |
| 合 計 | 2 | 0.011 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（20,018円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況（2019年4月19日から2020年4月20日まで）

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|----|---------|---------|-----------|----------------------|
| 外国 | ア メ リ カ | 国 債 証 券 | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル |
| | | | 1,892,513 | 2,183,380 (3,072) |

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等（2019年4月19日から2020年4月20日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|---------------------|---------------------|------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格 以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 630,091 | 千アメリカ・ドル 698,504 | 千円 75,361,611 | % 96.5 | % 15.6 | % 74.3 | % 19.2 | % 3.1 |
| 合 計 | — | — | 75,361,611 | 96.5 | 15.6 | 74.3 | 19.2 | 3.1 |

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

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

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | 評 価 額 | | | 償還年月日 |
|-------------------------------------|-------|--------|----------|-----------|-------------|--|------------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 | 国債証券 | 6.0500 | 7,900 | 8,985 | 969,432 | | 2040/01/11 |
| BRAZIL 5.625 01/07/41 | 国債証券 | 5.6250 | 5,100 | 5,240 | 565,370 | | 2041/01/07 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 | 国債証券 | 4.6000 | 6,000 | 5,753 | 620,747 | | 2046/01/23 |
| BRAZIL 4.25 01/07/25 | 国債証券 | 4.2500 | 10,100 | 10,567 | 1,140,087 | | 2025/01/07 |
| PANAMA 7.125 01/29/26 | 国債証券 | 7.1250 | 4,800 | 5,705 | 615,512 | | 2026/01/29 |
| PHILIPPINES 7.75 01/14/31 | 国債証券 | 7.7500 | 4,100 | 6,026 | 650,156 | | 2031/01/14 |
| ROMANIA 6.125 01/22/44 | 国債証券 | 6.1250 | 4,400 | 5,324 | 574,406 | | 2044/01/22 |
| UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 | 国債証券 | 5.5500 | 6,400 | 6,995 | 754,719 | | 2045/01/21 |
| SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24 | 国債証券 | 4.6650 | 5,100 | 5,042 | 544,048 | | 2024/01/17 |
| PHILIPPINES 6.375 01/15/32 | 国債証券 | 6.3750 | 2,600 | 3,531 | 381,025 | | 2032/01/15 |
| COLOMBIA 6.125 01/18/41 | 国債証券 | 6.1250 | 7,000 | 8,141 | 878,332 | | 2041/01/18 |
| INDONESIA 5.25 01/17/42 | 国債証券 | 5.2500 | 5,300 | 6,120 | 660,313 | | 2042/01/17 |
| INDONESIA 6.75 01/15/44 | 国債証券 | 6.7500 | 5,500 | 7,425 | 801,094 | | 2044/01/15 |
| BRAZIL 5.0 01/27/45 | 国債証券 | 5.0000 | 6,800 | 6,534 | 705,039 | | 2045/01/27 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47 | 国債証券 | 4.3500 | 6,000 | 5,610 | 605,360 | | 2047/01/15 |
| INDONESIA 5.125 01/15/45 | 国債証券 | 5.1250 | 3,400 | 3,830 | 413,254 | | 2045/01/15 |
| INDONESIA 5.25 01/08/47 | 国債証券 | 5.2500 | 3,400 | 3,873 | 417,882 | | 2047/01/08 |
| INDONESIA 4.35 01/11/48 | 国債証券 | 4.3500 | 4,000 | 4,210 | 454,278 | | 2048/01/11 |
| BRAZIL 8.25 01/20/34 | 国債証券 | 8.2500 | 5,200 | 6,531 | 704,707 | | 2034/01/20 |
| PANAMA 6.7 01/26/36 | 国債証券 | 6.7000 | 6,900 | 8,354 | 901,369 | | 2036/01/26 |
| BRAZIL 7.125 01/20/37 | 国債証券 | 7.1250 | 6,300 | 7,424 | 801,034 | | 2037/01/20 |
| INDONESIA 7.75 01/17/38 | 国債証券 | 7.7500 | 5,500 | 7,735 | 834,596 | | 2038/01/17 |
| PHILIPPINES 3.95 01/20/40 | 国債証券 | 3.9500 | 2,800 | 3,302 | 356,280 | | 2040/01/20 |
| INDONESIA 5.95 01/08/46 | 国債証券 | 5.9500 | 5,200 | 6,467 | 697,758 | | 2046/01/08 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 | 国債証券 | 3.6000 | 5,200 | 5,259 | 567,418 | | 2025/01/30 |
| PHILIPPINES 5.0 01/13/37 | 国債証券 | 5.0000 | 2,800 | 3,554 | 383,456 | | 2037/01/13 |
| INDONESIA 4.125 01/15/25 | 国債証券 | 4.1250 | 6,800 | 7,093 | 765,306 | | 2025/01/15 |
| INDONESIA 4.35 01/08/27 | 国債証券 | 4.3500 | 5,000 | 5,312 | 573,147 | | 2027/01/08 |
| PHILIPPINES 3.75 01/14/29 | 国債証券 | 3.7500 | 3,000 | 3,417 | 368,694 | | 2029/01/14 |
| ROMANIA 4.875 01/22/24 | 国債証券 | 4.8750 | 3,600 | 3,836 | 413,960 | | 2024/01/22 |
| COLOMBIA 4.5 01/28/26 | 国債証券 | 4.5000 | 6,000 | 6,236 | 672,829 | | 2026/01/28 |
| CROATIA 6.0 01/26/24 | 国債証券 | 6.0000 | 5,400 | 6,012 | 648,664 | | 2024/01/26 |

| 銘柄 | 当 | | 期 | | | | 末 |
|--------------------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 | 国債証券 | 4.1250 | 7,000 | 7,175 | 774,110 | 2026/01/21 | |
| INDONESIA 5.875 01/15/24 | 国債証券 | 5.8750 | 5,200 | 5,714 | 616,540 | 2024/01/15 | |
| INDONESIA 4.75 01/08/26 | 国債証券 | 4.7500 | 6,800 | 7,390 | 797,360 | 2026/01/08 | |
| PHILIPPINES 4.2 01/21/24 | 国債証券 | 4.2000 | 4,800 | 5,193 | 560,336 | 2024/01/21 | |
| BRAZIL 2.625 01/05/23 | 国債証券 | 2.6250 | 4,800 | 4,852 | 523,568 | 2023/01/05 | |
| BRAZIL 4.625 01/13/28 | 国債証券 | 4.6250 | 6,800 | 7,182 | 774,919 | 2028/01/13 | |
| UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28 | 国債証券 | 3.7500 | 5,200 | 5,120 | 552,472 | 2028/01/11 | |
| INDONESIA 3.5 01/11/28 | 国債証券 | 3.5000 | 4,200 | 4,255 | 459,164 | 2028/01/11 | |
| PANAMA 3.16 01/23/30 | 国債証券 | 3.1600 | 5,000 | 4,919 | 530,764 | 2030/01/23 | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50 | 国債証券 | 4.5000 | 6,000 | 5,655 | 610,182 | 2050/01/31 | |
| BRAZIL 8.75 02/04/25 | 国債証券 | 8.7500 | 3,800 | 4,643 | 500,998 | 2025/02/04 | |
| PHILIPPINES 3.7 02/02/42 | 国債証券 | 3.7000 | 6,000 | 7,031 | 758,670 | 2042/02/02 | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48 | 国債証券 | 4.6000 | 6,400 | 6,208 | 669,781 | 2048/02/10 | |
| PHILIPPINES 9.5 02/02/30 | 国債証券 | 9.5000 | 5,800 | 9,236 | 996,513 | 2030/02/02 | |
| COLOMBIA 5.625 02/26/44 | 国債証券 | 5.6250 | 4,000 | 4,450 | 480,110 | 2044/02/26 | |
| ROMANIA 6.75 02/07/22 | 国債証券 | 6.7500 | 7,500 | 7,988 | 861,828 | 2022/02/07 | |
| INDONESIA 5.35 02/11/49 | 国債証券 | 5.3500 | 3,000 | 3,563 | 384,424 | 2049/02/11 | |
| BRAZIL 5.625 02/21/47 | 国債証券 | 5.6250 | 6,600 | 6,864 | 740,556 | 2047/02/21 | |
| COLOMBIA 4.0 02/26/24 | 国債証券 | 4.0000 | 6,100 | 6,238 | 673,061 | 2024/02/26 | |
| INDONESIA 4.75 02/11/29 | 国債証券 | 4.7500 | 4,000 | 4,411 | 475,966 | 2029/02/11 | |
| HUNGARY 5.375 02/21/23 | 国債証券 | 5.3750 | 6,358 | 6,896 | 744,038 | 2023/02/21 | |
| PHILIPPINES 3.0 02/01/28 | 国債証券 | 3.0000 | 5,000 | 5,373 | 579,735 | 2028/02/01 | |
| PANAMA 3.875 03/17/28 | 国債証券 | 3.8750 | 2,100 | 2,231 | 240,729 | 2028/03/17 | |
| RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 | 国債証券 | 7.5000 | 9,853 | 11,135 | 1,201,448 | 2030/03/31 | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 | 国債証券 | 4.7500 | 8,400 | 8,244 | 889,518 | 2044/03/08 | |
| RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 | 国債証券 | 4.3750 | 8,400 | 9,282 | 1,001,480 | 2029/03/21 | |
| COLOMBIA 4.5 03/15/29 | 国債証券 | 4.5000 | 5,000 | 5,193 | 560,278 | 2029/03/15 | |
| PHILIPPINES 5.5 03/30/26 | 国債証券 | 5.5000 | 5,600 | 6,569 | 708,741 | 2026/03/30 | |
| PERU 6.55 03/14/37 | 国債証券 | 6.5500 | 8,000 | 11,095 | 1,197,061 | 2037/03/14 | |
| HUNGARY 7.625 03/29/41 | 国債証券 | 7.6250 | 5,000 | 8,157 | 880,074 | 2041/03/29 | |
| PHILIPPINES 3.7 03/01/41 | 国債証券 | 3.7000 | 5,000 | 5,836 | 629,722 | 2041/03/01 | |
| HUNGARY 5.375 03/25/24 | 国債証券 | 5.3750 | 6,380 | 7,112 | 767,400 | 2024/03/25 | |
| PANAMA 3.75 03/16/25 | 国債証券 | 3.7500 | 4,200 | 4,383 | 472,960 | 2025/03/16 | |
| UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 | 国債証券 | 3.6250 | 5,900 | 5,947 | 641,649 | 2022/03/15 | |
| COLOMBIA 2.625 03/15/23 | 国債証券 | 2.6250 | 3,700 | 3,639 | 392,706 | 2023/03/15 | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 | 国債証券 | 4.1500 | 8,400 | 8,526 | 919,870 | 2027/03/28 | |
| RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 | 国債証券 | 5.1000 | 10,000 | 11,845 | 1,278,026 | 2035/03/28 | |
| PANAMA 4.5 04/16/50 | 国債証券 | 4.5000 | 6,300 | 6,811 | 734,933 | 2050/04/16 | |
| PANAMA 9.375 04/01/29 | 国債証券 | 9.3750 | 3,900 | 5,415 | 584,258 | 2029/04/01 | |
| RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 | 国債証券 | 5.6250 | 9,000 | 11,373 | 1,227,113 | 2042/04/04 | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 | 国債証券 | 4.5000 | 8,000 | 8,184 | 882,980 | 2029/04/22 | |
| INDONESIA 4.625 04/15/43 | 国債証券 | 4.6250 | 4,400 | 4,714 | 508,603 | 2043/04/15 | |
| RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 | 国債証券 | 4.5000 | 5,800 | 6,086 | 656,662 | 2022/04/04 | |
| COLOMBIA 3.875 04/25/27 | 国債証券 | 3.8750 | 4,600 | 4,609 | 497,286 | 2027/04/25 | |
| CROATIA 5.5 04/04/23 | 国債証券 | 5.5000 | 6,400 | 6,899 | 744,349 | 2023/04/04 | |
| INDONESIA 3.375 04/15/23 | 国債証券 | 3.3750 | 5,700 | 5,777 | 623,328 | 2023/04/15 | |
| INDONESIA 4.1 04/24/28 | 国債証券 | 4.1000 | 5,000 | 5,255 | 567,051 | 2028/04/24 | |
| BRAZIL 6.0 04/07/26 | 国債証券 | 6.0000 | 6,800 | 7,694 | 830,127 | 2026/04/07 | |
| SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26 | 国債証券 | 4.8750 | 5,400 | 5,094 | 549,659 | 2026/04/14 | |
| COLOMBIA 8.125 05/21/24 | 国債証券 | 8.1250 | 4,900 | 5,645 | 609,070 | 2024/05/21 | |
| SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22 | 国債証券 | 5.8750 | 3,000 | 3,091 | 333,594 | 2022/05/30 | |
| PANAMA 4.5 05/15/47 | 国債証券 | 4.5000 | 3,000 | 3,233 | 348,853 | 2047/05/15 | |

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

■投資信託財産の構成

2020年4月20日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|------------|-----|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 | |
| 公 社 債 | 千円 | | % |
| | 75,361,611 | | 92.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 6,251,585 | | 7.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 81,613,197 | | 100.0 |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、77,837,248千円、95.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年4月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.89円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年4月20日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

■損益の状況

当期 自2019年4月19日 至2020年4月20日

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

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