

## 運用報告書 (全体版)

第2期<決算日2020年2月25日>

### 4資産分散投資・スタンダード<DC年金>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型信託/内外/資産複合 (インデックス型)
信託期間	2018年2月28日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。
主要投資対象	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
運用方法	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
	主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式 (除く日本)、先進国債券 (除く日本) に投資し、各資産クラスのベンチマークを基本配分比率で合成したベンチマーク (合成ベンチマーク) に連動した投資成果をめざして運用を行います。
	時価変動等により各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。
	マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
組入制限	株式への実質投資割合には、制限を設けません。
	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
分配方針	マザーファンド受益証券以外の投資信託証券 (上場投資信託証券を除きます。) への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
	決算日 (原則として2月25日。休業日の場合は翌営業日。) に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益 (マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額 (以下「みなし配当等収益」といいます。)) を含みます。) および売買益 (評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額) 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。

愛称：わたしへの贈りもの

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、「4資産分散投資・スタンダード<DC年金>」は、2020年2月25日に第2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/>

## 4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>

### ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			合成ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率	投資信託(受益証券)組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	ポイント	期中騰落率							
(設定日) 2018年2月28日	円 10,000	円 -	% -	ポイント (2月27日) 14,291.43	% -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 1
1期(2019年2月25日)	10,087	0	0.9	14,326.21	0.2	29.0	0.7	66.3	-	-	0.3	196
2期(2020年2月25日)	10,477	0	3.9	14,913.60	4.1	28.1	0.7	67.1	-	-	0.3	499

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

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

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 合成ベンチマークは委託会社が独自に合成した指数です。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

### ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		合成ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率	投資信託(受益証券)組入比率
	騰落率	%	ポイント	%						
(期首) 2019年2月25日	円 10,087	% -	ポイント 14,326.21	% -	% 29.0	% 0.7	% 66.3	% -	% -	% 0.3
2月末	10,068	△0.2	14,301.15	△0.2	29.1	0.7	66.3	-	-	0.3
3月末	10,132	0.4	14,399.28	0.5	29.0	0.8	66.4	-	-	0.3
4月末	10,189	1.0	14,484.00	1.1	29.1	0.6	66.0	-	-	0.2
5月末	10,009	△0.8	14,225.86	△0.7	28.8	0.6	66.7	-	-	0.3
6月末	10,150	0.6	14,430.41	0.7	29.2	0.5	66.1	-	-	0.3
7月末	10,206	1.2	14,511.61	1.3	29.4	0.3	66.3	-	-	0.3
8月末	10,166	0.8	14,464.98	1.0	29.2	0.6	65.9	-	-	0.3
9月末	10,271	1.8	14,613.13	2.0	29.1	0.8	67.2	-	-	0.3
10月末	10,408	3.2	14,799.60	3.3	29.1	0.7	66.3	-	-	0.3
11月末	10,468	3.8	14,893.30	4.0	29.0	0.7	66.5	-	-	0.3
12月末	10,520	4.3	14,966.49	4.5	29.1	0.5	66.9	-	-	0.3
2020年1月末	10,511	4.2	14,960.54	4.4	28.7	0.8	66.1	-	-	0.3
(期末) 2020年2月25日	10,477	3.9	14,913.60	4.1	28.1	0.7	67.1	-	-	0.3

(注1) 騰落率は期首比です。

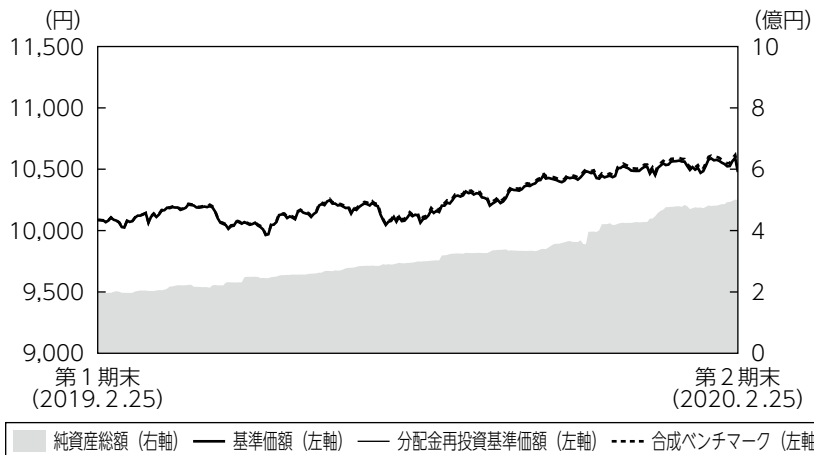
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、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。

## ■当期の運用経過（2019年2月26日から2020年2月25日まで）

### 基準価額等の推移



第2期首：10,087円  
 第2期末：10,477円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率：3.9%  
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額および合成ベンチマーク（委託会社が独自に合成した指数）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

米中通商協議の進展期待や主要国の金利が低下傾向で推移したこと等を材料に、国内外の株式市場は上昇しました。また、多くの中央銀行がハト派姿勢を強めたこと等を背景に主要国の金利が低下（債券価格は上昇）しました。新型コロナウイルスについては感染拡大懸念等から国内外の株価の上昇幅の縮小および主要国の金利低下要因となりました。外国株式、国内外の債券中心にプラス寄与となりました。その結果、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	2.4%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.6%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.7%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.4%

## 投資環境

国内株式市場は、期初から2019年4月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。しかし、5月に入ると世界景気の後退懸念が広がり下落しました。その後、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され、再び下落しました。しかし、9月から2020年1月前半にかけては、欧米中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどが好感され、上昇しました。期末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大が嫌気され急落しました。

国内債券市場では、利回りが低下（価格は上昇）しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念や、世界景気の先行き不透明感の高まり、米欧中央銀行の金融緩和観測などを背景に、10年国債利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きや、国内債券需給の緩みが意識されたことなどから、低下幅は縮小しました。

外国株式市場では、米国株式市場は、パウエルFRB（米連邦準備理事会）議長が金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから2019年4月下旬にかけて堅調に推移しました。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の進展期待から上昇傾向となりました。期末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大による経済への悪影響が警戒され下落しましたが、前期末比で上昇となりました。欧州株式市場もほぼ同様の動きとなり、欧州主要株式市場は前期末比で上昇となりました。

外国債券市場では、米国債、ドイツ債の利回りは、ともに前期末比で低下（価格は上昇）しました。米中貿易摩擦やブレグジット（英国のEU離脱）等の不透明感があり、FRBが政策金利を引き下げ、ECB（欧州中央銀行）も追加的に金融緩和を行ったことから、期初から2019年8月にかけて利回りは低下しました。その後、米中貿易協議やブレグジット交渉の進展見込みから利回りは上昇に転じる場面もありましたが、新型コロナウイルスの流行による世界的な景気減速懸念もあり、利回りは低下しました。

為替市場では、米ドル／円相場は、2019年5月から8月にかけて米国の長期金利低下による日米金利差縮小を背景に円高米ドル安となりました。9月以降は、米中貿易協議の進展期待の高まり等から市場心理が好転し、円安米ドル高の動きとなったことから前期末比で概ね横ばいとなりました。その他主要通貨については対米ドルと同様、市場センチメント好転により英ポンドやユーロに対して円安基調となりましたが、2020年の年明け以降は概ね横ばいで推移する動きとなりました。

## ポートフォリオについて

当ファンドでは、各資産クラスのベンチマークを以下の基本配分比率で合成したベンチマーク（合成ベンチマーク）に連動した投資成果をめざし、各資産への投資比率が基本配分比率から大きく乖離しないよう運用を行いました。

### <基本配分比率>

国内株式20%、国内債券52%、先進国株式（除く日本）10%、先進国債券（除く日本）15%、短期金融資産3%

#### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

#### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

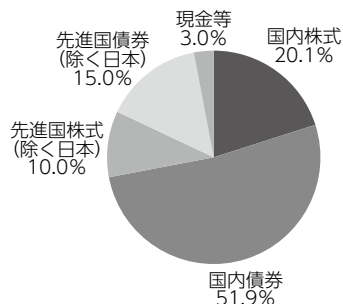
#### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

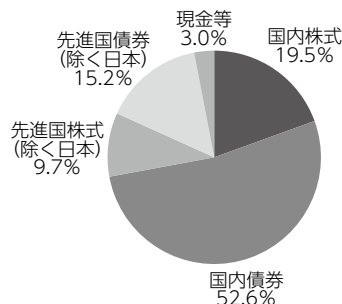
### 【運用状況】

#### ○マザーファンド組入比率

期首（前期末）



期末

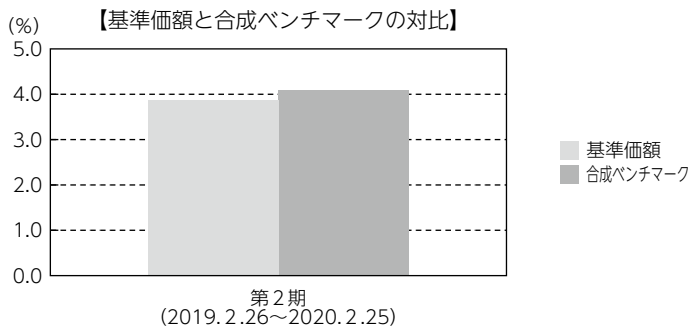


(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

## 合成ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で4.1%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.2%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。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本配分比率の間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2019年2月26日 ～2020年2月25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	477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

当ファンドでは、引き続き、合成ベンチマークに概ね連動した投資成果が得られるよう、各マザーファンドへの投資比率が基本配分比率から大きく乖離しないよう運用を行います。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動したファンドパフォーマンスをめざします。

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第2期		項目の概要
	(2019年2月26日 ～2020年2月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	16円	0.152%	(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10,265円です。
(投信会社)	( 7)	(0.065)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	( 7)	(0.065)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	( 2)	(0.022)	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
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(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、組入価値証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 0)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(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)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.010	(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)	( 0)	(0.002)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	( 0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	( 0)	(0.004)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	17	0.163	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

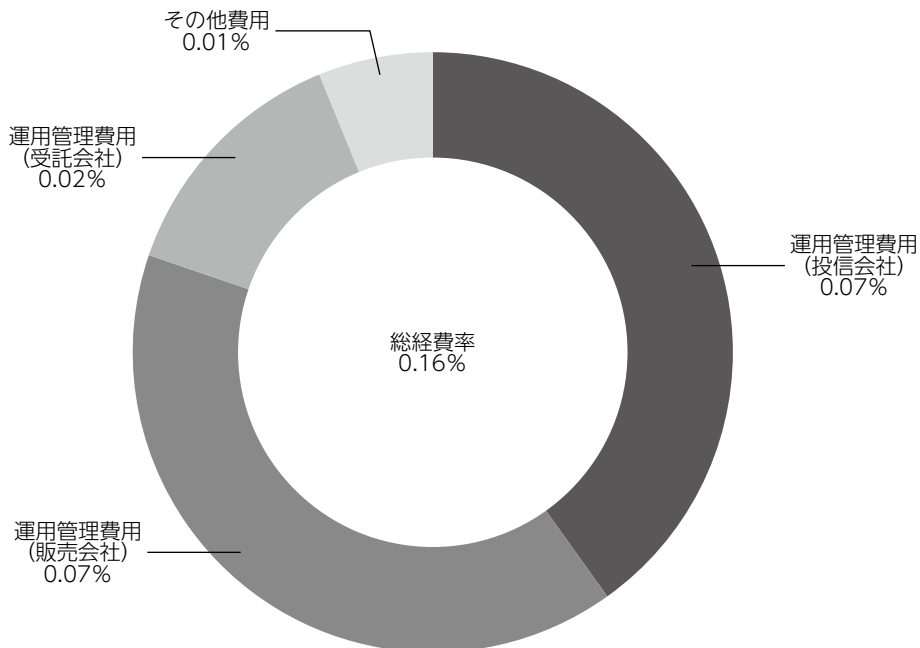
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.16%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年2月26日から2020年2月25日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	30,327	78,043	8,150	21,145
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	151,043	199,499	31,269	41,224
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	9,652	36,294	3,306	12,706
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	28,890	54,075	6,144	11,508

■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	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	140,330,634千円	88,697,551千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	254,160,767千円	335,421,941千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.55	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26日から2020年2月25日まで）

【4資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.003千円
(B)／(A)	0.2%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

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

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 54,443	百万円 24	% 0.0	百万円 85,887	百万円 376	% 0.4

平均保有割合 0.0%

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

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 497	百万円 799	百万円 2,345

### (3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 98

## 【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

### 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 104,188	百万円 8,065	% 7.7	百万円 174,126	百万円 18,207	% 10.5

平均保有割合 0.1%

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細  
親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	15,741	37,918	97,159
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	78,020	197,794	262,631
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	5,581	11,927	48,216
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	16,166	38,912	76,027

■投資信託財産の構成

2020年2月25日現在

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	97,159	19.4
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	262,631	52.4
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	48,216	9.6
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	76,027	15.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	17,498	3.5
投 資 信 託 財 産 総 額	501,533	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2月25日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは358,476,209千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは130,168,562千円、99.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2020年2月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.91円、1カナダ・ドル=83.43円、1オーストラリア・ドル=73.30円、1香港・ドル=14.23円、1シンガポール・ドル=79.36円、1ニュージーランド・ドル=70.35円、1イギリス・ポンド=143.31円、1イスラエル・シェケル=32.36円、1スイス・フラン=113.21円、1デンマーク・クローネ=16.10円、1ノルウェー・クローネ=11.85円、1スウェーデン・クローナ=11.39円、1メキシコ・ペソ=5.83円、1マレーシア・リングギット=26.29円、1南アフリカ・ランド=7.34円、1ポーランド・ズロチ=27.94円、1ユーロ=120.33円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	501,533,914円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	17,498,573
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	97,159,120
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	262,631,410
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	48,216,991
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	76,027,820
(B) 負 債	2,409,899
未 払 解 約 金	2,100,532
未 払 信 託 報 酬	301,418
そ の 他 未 払 費 用	7,949
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	499,124,015
元 本	476,387,146
次 期 繰 越 損 益 金	22,736,869
(D) 受 益 権 総 口 数	476,387,146口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,477円

(注) 期首における元本額は194,621,025円、当期中における追加設定元本額は459,829,471円、同解約元本額は178,063,350円です。

## ■損益の状況

当期 自2019年2月26日 至2020年2月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,861円
受 取 利 息	1,470
支 払 利 息	△6,331
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,340,224
売 買 損 益	12,330,777
売 買 損	△2,990,553
(C) 信 託 報 酬 等	△508,682
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	8,826,681
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	581,002
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,329,186
(配 当 等 相 当 額)	(3,376,180)
(売 買 損 益 相 当 額)	(9,953,006)
(G) 合 計(D+E+F)	22,736,869
次 期 繰 越 損 益 金(G)	22,736,869
追 加 信 託 差 損 益 金	13,329,186
(配 当 等 相 当 額)	(3,591,470)
(売 買 損 益 相 当 額)	(9,737,716)
分 配 準 備 積 立 金	9,407,683

(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) (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	4,347,234円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	4,184,072
(c) 収 益 調 整 金	13,329,186
(d) 分 配 準 備 積 立 金	876,377
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	22,736,869
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	477.28
(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基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

## 《お知らせ》

■信託報酬を年率0.14%（税抜）に引き下げる所要の約款変更を行いました。

(2019年5月25日)

### \* 合成ベンチマークについて

(注1) 合成ベンチマークとは、東証株価指数(TOPIX) (配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、コール・ローン(オーバーナイト物)を基本配分比率に基づいて委託会社が合成したものです。基本配分比率については、前掲の「ポートフォリオについて」をご参照ください。

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

(注3) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(注4) 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。

(注5) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

# 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第18期（決算日 2020年2月7日）

（計算期間 2019年2月8日～2020年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰	期中 落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 落率			
14期 (2016年2月8日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期 (2016年2月8日)	19,981	△1.3	1,925.17	△1.2	98.2	1.7	286,897
15期 (2017年2月7日)	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
16期 (2018年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
17期 (2019年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

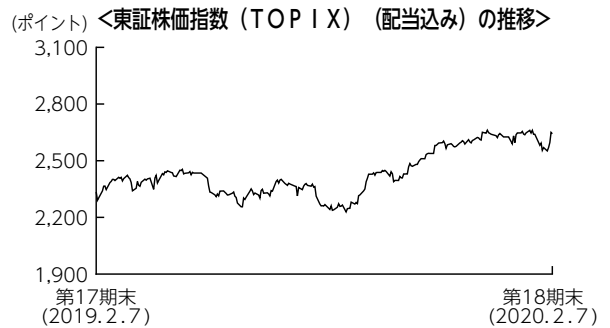
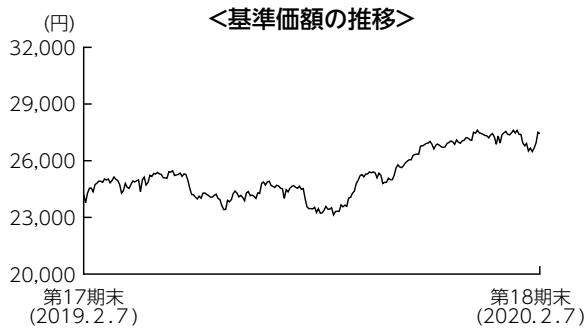
年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物比率
	円	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク) ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2019年 2月7日	24,228	% -	2,334.81	% -	% 98.5	% 1.5
2 月 末	24,833	2.5	2,393.08	2.5	97.7	2.3
3 月 末	24,854	2.6	2,395.21	2.6	97.1	2.9
4 月 末	25,266	4.3	2,434.82	4.3	97.4	2.3
5 月 末	23,624	△2.5	2,275.96	△2.5	97.8	2.2
6 月 末	24,269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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。



## ■当期の運用経過（2019年2月8日から2020年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は27,423円となり、前期末比で13.2%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米中貿易協議の状況次第の相場展開となりましたが、期末にかけては貿易協議が再開し、第1段階の合意に達したことが好感され、国内株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

国内株式市場は、期初から2019年4月までは、米中貿易問題の進展期待などを要因として上昇しました。しかし、5月に入ると世界景気の後退懸念が広がり、反落しました。その後はほぼ横ばいとなりましたが、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され、下落しました。9月から2020年1月前半までは、欧米の中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどが好感され、上昇しました。期末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大が嫌気され、下落する局面がありました。

### ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種

期首 (前期末)

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



期末

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

○組入上位10銘柄

期首 (前期末)

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



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.5%
2	ソニー	日本・円	2.0
3	ソフトバンクグループ	日本・円	1.6
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.6
5	武田薬品工業	日本・円	1.5
6	日本電信電話	日本・円	1.5
7	キーエンス	日本・円	1.4
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.2
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.1
10	KDDI	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,151銘柄	

**ベンチマークとの差異について**

ベンチマークは前期末比で13.2%上昇しました。  
当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

**今後の運用方針**

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (0.002)
合 計	0	0.002

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,270円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については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8日から2020年2月7日まで)

### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株	千円	千株	千円
		29,008.8 (2,820.619)	54,443,054 (-)	46,738.519	91,420,458

(注1) 金額は受渡代金です。

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

### (2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 106,543	百万円 104,700	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

## ■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年2月8日から2020年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 54,443	百万円 24	% 0.0	百万円 91,420	百万円 5,933	% 6.5

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 98

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4,389千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	17千円
(B)/(A)	0.4%

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











銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株数	千株	千円	千株		株数	千株	千円	株数		千株	株数	千株	千円
EIZO		11.3		8.4	ウシオ電機		74.5		62.6	日信工業		22.4		21.9
ジャパンディスプレイ	290.1		33,054		岡谷電機産業		8.8		8.5	トビー工業		10.1		8.9
日本信号	31.2		23,088		ハリオス テクノ ホールディング	11.3			9.9	ティラド		4.5		3.9
京三製作所	26.3		39,538		エノモト	2.6			3.3	曙ブレーキ工業		67.3		59.3
能美防災	16.2		14,288		日本セラミック	12.5			10.9	タチエス		20.8		17.6
ホーチキ	7.7		35,750		遠藤照明	6.3			5.4	NOK		65.9		57.9
星和電機	4.1		11,699		古河電池	8.8			7.6	フタバ産業		34.1		30.1
エレコム	11.1		3,191		双信電機	5.9			5.4	K Y B		12.8		10
パナソニック	1,401.8		50,017		山一電機	8.9			7.9	大同メタル工業		19.9		20.7
シャープ	121.8	1,231.9	1,522,628		図研	7.9			7	プレス工業		60.8		53.5
アンリツ	79		192,910		日本電子	24.2			21.2	ミクニ		15.5		13.7
富士通ゼネラル	37.4		149,355		カシオ計算機	108.5			95.4	太平洋工業		25.7		22.5
ソニー	822.6	681.6	5,334,201		ファナック	116.6			102.4	ケーヒン		28.2		24.8
TDK	64.2		2,139,648		日本シイエムケイ	31.2			25.4	河西工業		15		14.5
帝国通信工業	5.4		627,640		エンプラス	5.5			5.5	アイシン精機		101.1		88.7
タムラ製作所	47.2		5,870		大真空	4.5			4	マツダ		385.1		317.2
アルプスアルパイン	127.7	95.5	23,256		ローム	59.3			47.8	今仙電機製作所		11.4		10
池上通信機	3.9		191,764		浜松ホトニクス	88.1			77.3	本田技研工業	1,035.2	849		2,426,017
パイオニア	204.5		3,888		三井ハイテック	13.6			11.9	スズキ		224.5		213.7
日本電波工業	11.2		—		新光電気工業	41.1			36.2	S U B A R U		381		334.7
鈴木	2.1		4,753		京セラ	187.1			151.7	安永		5.9		5.2
日本トリム	6.4		4,547		太陽誘電	54.6			47.9	ヤマハ発動機		173.2		140.6
ロランド ディー. ジー.	6.3		6,167		村田製作所	128.8			316.7	ショーワ		29		25.4
フォスター電機	14.4		12,000		ユーシン	19.4			—	T B K		14.8		12.9
クラリオン	10.7		18,543		双葉電子工業	20			17	エクセディ		16.6		14.7
SMK	3.4		—		北陸電気工業	4.6			4.3	豊田合成		39.7		34.8
ヨコオ	8.8		8,764		ニチコン	38.6			36.6	愛三工業		19.2		16.9
ティアック	8.6		20,838		日本ケミコン	8.8			8.2	盟和産業		1.9		1.6
ホシデン	36.1		1,592		K O A	18.6			16.2	日本プラスト		9.6		8.4
ヒロセ電機	17.5		37,229		市光工業	18.4			16.1	ヨフ		11.5		10.1
日本航空電子工業	28.2		232,965		小糸製作所	73.6			64.6	エフ・シー・シー		22.1		17.6
T O A	13.3		50,412		ミツバ	22.6			19.9	シマノ		49.5		40.4
マクセルホールディングス	26.4		12,420		SCREENホールディングス	21.3			18.7	テイ・エス テック		28.5		25
古野電気	15.8		34,181		キャノン電子	11.3			11.3	ジャムコ		6.2		5.4
ユニデンホールディングス	3.7		15,429		キャノン	660.6			580.4	<b>精密機器 (2.4%)</b>				
スミダコーポレーション	10.4		6,306		リコー	369			274.3	テルモ	173.6	305.1		1,202,399
アイコム	6.8		9,777		象印マホービン	22.9			31.6	クリエートメディック		4.2		3.6
リオン	5.6		15,990		MUTOHホールディングス	1.6			1.4	日機装		39.7		32.3
本多通信工業	10.5		14,917		東京エレクトロン	81.9			71.9	日本エム・ディ・エム		7		6.2
船井電機	12.5		5,094		<b>輸送用機器 (7.6%)</b>					島津製作所	157.9	128.8		390,908
横河電機	122.8	98.9	7,662		トヨタ紡織	42.9			31.4	J M S		11.1		9.2
新電元工業	4.4		197,008		芦森工業	2.6			2.2	クボテック		2.6		2.8
アズビル	79.2		3,338		ユニプレス	23.8			20.9	長野計器		9.6		7.8
東亜ディーケーケー	6.1		204,680		豊田自動織機	99.3			87.3	パイ・テクノロジ		2.9		5
日本光電工業	54.1		5,469		モリタホールディングス	21.4			18.9	東京計器		7.7		6.9
チノー	4.3		155,654		三櫻工業	15.5			13.7	愛知時計電機		1.6		1.3
共和電業	13		5,154		デンソー	270.2			237.4	インターアクション		6.5		5.8
日本電子材料	4.7		4,892		東海理化電機製作所	32.8			28.4	オーバル		11.7		9.8
堀場製作所	24.3		4,588		E&Sホールディングス	44.3			39	東京精密		22.2		19.5
アドバンテスト	83.6		153,573		川崎重工	95.5			83.9	マニ		14.9		42.9
小野測器	5.7		453,130		名村造船所	36.8			34.7	ニコン	213.8	174.4		233,347
エスベック	10.9		2,553		サノリスホールディングス	16.3			13.2	トプコン		65.8		54.3
キーエンス	60.2		22,600		日本車輻製造	4.5			4	オリンパス		182.8		596.7
日置電機	6.4		3,743,864		三菱ロジスネクスト	14.6			14.3	理研計器		10.9		9.5
シスメックス	95.6		23,072		近畿車輛	1.9			1.6	タムロン		10.9		8.7
日本マイクロニクス	19.8		631,554		日産自動車	1,447.3			1,271.6	HOYA	247.1	215.3		2,190,677
メガチップス	9.7		24,289		いすゞ自動車	387.9			312.4	シード		5.2		4.6
O B A R A G R O U P	7.1		18,290		トヨタ自動車	1,367.5			1,203.1	ノーリツ鋼機		9.7		7.2
滝藤電機	1.5		20,608		日野自動車	153.2			134.6	エー・アンド・デイ		11.2		9.8
原田工業	3.8		2,802		三菱自動車工業	454.2			399	朝日インテック		5.2		91.6
コーセル	17		5,100		エフテック	8.7			7.5	シチズン時計		134.2		126.3
イリソ電子工業	11.2		15,272		レシップホールディングス	4.5			4.4	リズム時計工業		4.1		3.4
オプテックスグループ	21.6		39,084		GMB	2.5			2	大研医器		9.8		7.5
千代田インテグレ	5.1		27,385		ファルテック	2.1			1.9	メニコン		16.8		14.8
アイ・オー・データ機器	5.1		10,630		武蔵精密工業	28.9			24	シンシア		1.9		1.1
レーザーテック	25.1		4,172		日産車体	24			21.1	松風		6.2		4.9
スタンレー電気	86.9		259,677		新明和工業	57.1			29.1	セイコーホールディングス		19		15.2
岩崎電気	4.8		234,601		極東開発工業	24.4			20	ニプロ		84.9		74.7
			6,997						29,720					99,052













## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期		末
	買 建 額	売 建 額	額
国内 T O P I X	百万円 6,514		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2020年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
株 式	千円 263,153,477		% 95.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,850,991		4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	275,004,469		100.0

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



■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月7日)現在

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

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

投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	5,883,416円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	4,725,965円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,914,158円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	13,386,629円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	35,525,818円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,093,711,974円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	217,750,260円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	900,539円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	766,807円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	889,213円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	197,398円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	97,721,972円
D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,537,910円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	748,659,317円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	42,276,864円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	90,882,753円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	205,217,487円
D I AM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,081,740円
D I AM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	49,099,169円
D I AM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	14,085,281円
D I AM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	11,090,446円
D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,577,334円
D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,241,538円
D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	856,834,056円
D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	856,427,853円
D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,443,533,162円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	174,658,821円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	48,206,798円
D I AM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	469,721,881円
D I AM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家限定)	125,441,570円
D I AM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,312,004円
D I AM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	35,583,091円
D I AM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	490,063,850円
D I AM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	37,551,836円
D I AM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	134,171,540円
D I AM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	347,374,438円
D I AM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	876,490,927円
D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	53,451,662円
D I AM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	23,728,407円
D I AMバランス20VA(適格機関投資家限定)	13,986,618円
D I AMバランス40VA(適格機関投資家限定)	104,317円
D I AMバランス60VA(適格機関投資家限定)	121,717円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	380,720,505円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,210,952,937円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,605,155,025円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	65,047,821円
期末元本合計	98,370,254,055円
(注3) 担保資産	
代用として担保を提供している資産は次の通りです。	
株式	1,965,500,000円

## ■損益の状況

当期 自2019年2月8日 至2020年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	6,474,619,048円	
	受取配当金	6,470,932,929	
	その他の収益	6,596,035	
	支払利息	△2,909,916	
(B)	有価証券売買損益	25,090,512,011	
	売却益	37,376,506,942	
	売却損	△12,285,994,931	
(C)	先物取引等取引損益	549,897,040	
	取引益	1,316,074,846	
	取引損	△766,177,806	
(D)	当期損益金(A+B+C)	32,115,028,099	
(E)	前期繰越損益金	163,951,791,282	
(F)	解約差損益金	△85,804,876,036	
(G)	追加信託差損益金	61,128,060,131	
(H)	計(D+E+F+G)	171,390,003,476	
	次期繰越損益金(H)	171,390,003,476	

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

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

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

# 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第17期 (決算日 2020年2月14日)

(計算期間 2019年2月15日～2020年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率				
13期 (2016年2月15日)	12,614	3.7	ポイント 373.37	% 3.7	% 98.6	% -	% -	百万円 400,593
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	-	-	379,734
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	-	-	355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	-	-	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	-	-	222,859

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

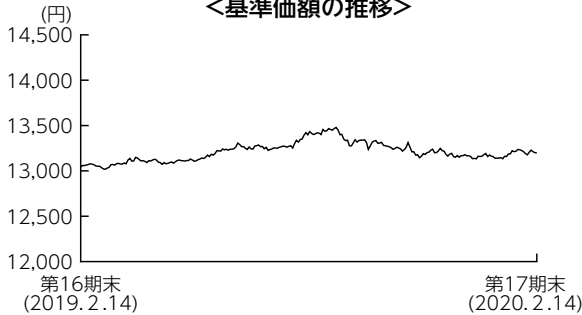
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率 比	新株予約債 権付社債 (転換社債) 比	債券先物率 比
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2019年 2月14日	円 13,042	% -	ポイント 386.15	% -	% 99.3	% -	% -
2月 末	13,051	0.1	386.43	0.1	99.2	-	-
3月 末	13,142	0.8	389.14	0.8	99.4	-	-
4月 末	13,101	0.5	387.94	0.5	98.8	-	-
5月 末	13,183	1.1	390.32	1.1	99.4	-	-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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2019年2月15日から2020年2月14日まで）

### <基準価額の推移>



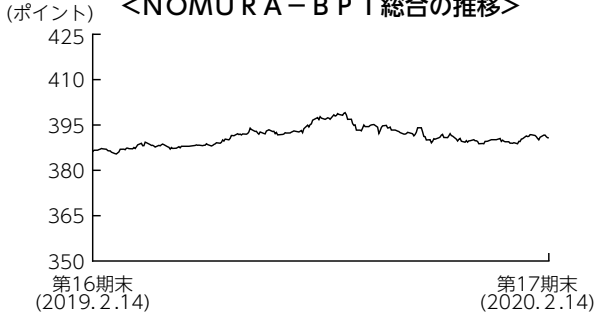
### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は13,197円となり、前期末比で1.2%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

国内債券市場の上昇を受けて、基準価額は上昇しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念や、世界景気の先行き不透明感の高まり、米欧中央銀行の金融緩和観測などを背景に、基準価額は概ね上昇基調で推移しました。9月から期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きや、国内債券需給の緩みが意識されたことから、上昇幅は縮小しました。

### <NOMURA-BPI総合の推移>



### 投資環境

国内債券市場では、利回りが低下（価格は上昇）しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念や、世界景気の先行き不透明感の高まり、米欧中央銀行の金融緩和観測などを背景に、10年国債利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きや、国内債券需給の緩みが意識されたことから、低下幅は縮小しました。

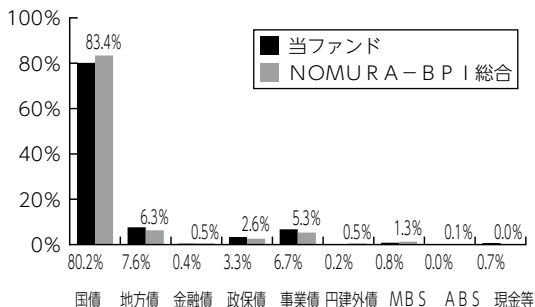
### ポートフォリオについて

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

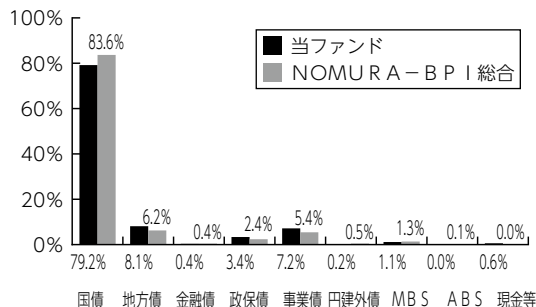
**【運用状況】** (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

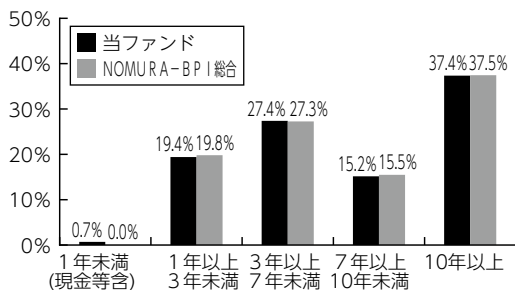


期末

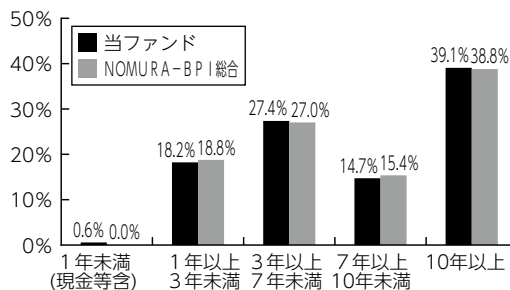


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



**ベンチマークとの差異について**

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で1.2%上昇しました。

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

**今後の運用方針**

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

## ■ 売買及び取引の状況 (2019年2月15日から2020年2月14日まで)

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2019年2月15日から2020年2月14日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 104,053	百万円 8,065	% 7.8	百万円 174,126	百万円 18,207	% 10.5

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

## ■組入資産の明細

### 公社債

#### (A) 債券種類別開示

##### 国内（邦貨建）公社債

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

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

(注2) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

#### (B) 個別銘柄開示

##### 国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
313回 利付国庫債券(10年)	1.3000	1,180,000	1,198,526	2021/03/20
314回 利付国庫債券(10年)	1.1000	800,000	810,816	2021/03/20
399回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,000,000	1,002,790	2021/04/01
128回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,200,000	2,207,348	2021/06/20
315回 利付国庫債券(10年)	1.2000	1,500,000	1,527,015	2021/06/20
316回 利付国庫債券(10年)	1.1000	1,000,000	1,016,670	2021/06/20
129回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,120,000	2,128,437	2021/09/20
317回 利付国庫債券(10年)	1.1000	600,000	611,892	2021/09/20
318回 利付国庫債券(10年)	1.0000	1,400,000	1,425,522	2021/09/20
130回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,780,000	1,788,188	2021/12/20
319回 利付国庫債券(10年)	1.1000	800,000	818,352	2021/12/20
320回 利付国庫債券(10年)	1.0000	900,000	918,990	2021/12/20
408回 利付国庫債券(2年)	0.1000	800,000	803,752	2022/01/01
131回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,420,000	1,427,412	2022/03/20
321回 利付国庫債券(10年)	1.0000	800,000	819,152	2022/03/20
322回 利付国庫債券(10年)	0.9000	500,000	510,925	2022/03/20
132回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,200,000	1,207,032	2022/06/20
323回 利付国庫債券(10年)	0.9000	750,000	768,375	2022/06/20
324回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,050,000	1,073,257	2022/06/20
133回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,180,000	1,187,811	2022/09/20
325回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,300,000	1,331,915	2022/09/20
134回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,180,000	1,188,566	2022/12/20
326回 利付国庫債券(10年)	0.7000	500,000	512,110	2022/12/20
327回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,200,000	1,232,484	2022/12/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
135回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,040,000	1,048,216	2023/03/20
328回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,090,000	1,115,331	2023/03/20
136回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,250,000	1,260,900	2023/06/20
329回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,770,000	1,826,392	2023/06/20
137回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,400,000	1,412,880	2023/09/20
330回 利付国庫債券(10年)	0.8000	450,000	465,507	2023/09/20
331回 利付国庫債券(10年)	0.6000	650,000	667,706	2023/09/20
138回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,450,000	1,464,268	2023/12/20
332回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,410,000	1,451,101	2023/12/20
139回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,300,000	1,313,351	2024/03/20
333回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,650,000	1,701,199	2024/03/20
140回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,300,000	1,313,611	2024/06/20
334回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,770,000	1,827,949	2024/06/20
141回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,410,000	1,425,298	2024/09/20
335回 利付国庫債券(10年)	0.5000	1,900,000	1,957,057	2024/09/20
72回 利付国庫債券(20年)	2.1000	350,000	386,298	2024/09/20
142回 利付国庫債券(5年)	0.1000	500,000	505,595	2024/12/20
336回 利付国庫債券(10年)	0.5000	700,000	722,526	2024/12/20
337回 利付国庫債券(10年)	0.3000	1,090,000	1,114,176	2024/12/20
73回 利付国庫債券(20年)	2.0000	340,000	375,533	2024/12/20
338回 利付国庫債券(10年)	0.4000	1,730,000	1,778,751	2025/03/20
75回 利付国庫債券(20年)	2.1000	140,000	156,100	2025/03/20
339回 利付国庫債券(10年)	0.4000	1,790,000	1,842,464	2025/06/20
78回 利付国庫債券(20年)	1.9000	190,000	210,841	2025/06/20



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

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

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	266,730	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	860,000	972,333	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	320,000	438,108	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	780,000	808,087	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	274,728	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	850,000	852,694	2036/06/20
24回 利付国庫債券(30年)	2.5000	190,000	261,846	2036/09/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	860,000	904,324	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	269,956	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	850,000	907,596	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	400,000	548,096	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	700,000	759,073	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	800,000	854,328	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	420,000	586,126	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	800,000	854,368	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	770,000	822,336	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	480,000	673,862	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	910,000	955,145	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	740,000	776,519	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	560,000	780,802	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	750,000	814,290	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	800,000	839,000	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	570,000	788,595	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	700,000	720,433	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	750,000	757,612	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	600,000	823,098	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	630,000	635,877	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	250,000	252,122	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	760,000	1,063,042	2040/03/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	740,000	996,498	2040/09/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	670,000	933,544	2041/03/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	820,000	1,113,937	2041/09/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	800,000	1,091,864	2042/03/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	790,000	1,065,291	2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	570,000	759,507	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	480,000	651,763	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	450,000	602,014	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	460,000	605,967	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	510,000	673,398	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	500,000	661,015	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	490,000	649,318	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	500,000	639,430	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	630,000	807,307	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	540,000	706,131	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	590,000	744,231	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	560,000	706,865	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	540,000	601,678	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	570,000	563,804	2046/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	580,000	602,625	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	600,000	638,364	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	600,000	669,276	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	590,000	657,879	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	550,000	613,041	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	650,000	725,114	2047/12/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	710,000	791,699	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	580,000	631,515	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	500,000	571,465	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	500,000	543,700	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	280,000	420,064	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	500,000	516,390	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	570,000	573,003	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	500,000	501,990	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	200,000	200,802	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	290,000	439,016	2050/03/20
4回 利付国庫債券(40年)	2.2000	430,000	657,624	2051/03/20
5回 利付国庫債券(40年)	2.0000	480,000	711,532	2052/03/20
6回 利付国庫債券(40年)	1.9000	450,000	658,768	2053/03/20
7回 利付国庫債券(40年)	1.7000	480,000	678,360	2054/03/20
8回 利付国庫債券(40年)	1.4000	520,000	689,535	2055/03/20
9回 利付国庫債券(40年)	0.4000	780,000	778,767	2056/03/20
10回 利付国庫債券(40年)	0.9000	770,000	900,145	2057/03/20
11回 利付国庫債券(40年)	0.8000	580,000	658,851	2058/03/20
12回 利付国庫債券(40年)	0.5000	380,000	391,517	2059/03/20
小 計	-	159,940,000	176,414,100	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
23年度1回 千葉市公募公債	1.3700	200,000	203,200	2021/04/21
23年度2回 埼玉県公募公債	1.1900	200,000	202,994	2021/05/25
697回 東京都公募公債	1.1100	500,000	507,330	2021/06/18
99回 共同発行市場公募地方債	1.1700	700,000	710,983	2021/06/25
701回 東京都公募公債	0.9900	700,000	710,843	2021/09/17
23年度4回 横浜市公募公債	1.0450	450,000	458,073	2021/11/12
23年度9回 静岡県公募公債	1.0450	200,000	203,660	2021/11/25
356回 大阪府公募公債	1.0600	200,000	203,896	2021/12/27
106回 共同発行市場公募地方債	0.9700	300,000	305,568	2022/01/25
23年度20回 愛知県公募公債	1.0820	500,000	511,295	2022/03/29
109回 共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	511,340	2022/04/25
708回 東京都公募公債	0.8900	500,000	510,255	2022/06/20
111回 共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	714,427	2022/06/24
364回 大阪府公募公債	0.7900	300,000	306,081	2022/09/27
194回 神奈川県公募公債	0.7910	300,000	306,624	2022/12/20
24年度7回 千葉県公募公債	0.7400	300,000	306,201	2022/12/22
119回 共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	511,875	2023/02/24
121回 共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	508,885	2023/04/25
25年度4回 愛知県公募公債	0.8560	300,000	308,331	2023/05/30
720回 東京都公募公債	0.8700	300,000	308,628	2023/06/20
25年度4回 札幌市公募公債	0.8000	200,000	205,284	2023/06/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(地方債証券)</b>	%	千円	千円	
25年度2回 横浜市公募公債	0.8880	400,000	411,976	2023/07/14
374回 大阪府公募公債	0.9380	300,000	309,600	2023/07/28
25年度5回 千葉県公募公債	0.8400	200,000	205,852	2023/08/25
128回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	307,359	2023/11/24
726回 東京都公募公債	0.7300	400,000	411,076	2023/12/20
25年度11回 福岡県公募公債	0.6940	200,000	205,508	2024/02/26
208回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	307,050	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	314,259	2024/06/26
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	410,696	2024/07/29
488回 名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	462,159	2024/09/20
26年度11回 京都府公募公債	0.4760	350,000	357,896	2024/12/19
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	508,275	2025/01/24
26年度7回 兵庫県公募公債	0.4600	200,000	204,372	2025/02/26
5回 東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	110,630	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	409,184	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	411,220	2025/05/23
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	514,485	2025/07/25
1回 静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	112,072	2025/09/19
9回 東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	230,576	2026/06/19
10回 東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	345,534	2026/09/18
4回 京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	116,363	2026/09/18
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	505,370	2027/01/25
29年度4回 大阪市公募公債	0.1500	200,000	201,820	2027/09/21
30年度1回 神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	305,499	2028/09/20
第91回 川崎市公募公債	0.1850	200,000	202,484	2028/09/20
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	300,000	303,438	2028/12/28
30年度19回 愛知県公募公債	0.1150	200,000	200,996	2029/03/28
8回 静岡県公募公債 15年	0.8280	200,000	214,750	2030/06/07
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	1.6350	300,000	353,565	2032/08/16
14回 千葉県公募公債 20年	1.1370	100,000	112,016	2033/04/15
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	355,014	2034/05/08
17回 北九州市公募公債 20年	1.5290	100,000	118,039	2034/06/20
小計	-	17,450,000	18,054,906	-
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	100,000	102,181	2021/03/26
24回 地方公共団体金融機構債券	1.2080	300,000	304,548	2021/05/28
18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.2000	300,000	310,470	2021/08/30
14回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	400,000	407,636	2021/11/30
36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	306,246	2022/05/20
96回 高速道路機構債	0.7960	700,000	714,196	2022/09/20
44回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	410,020	2023/01/20
55回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	512,865	2023/03/20
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	509,015	2023/04/28
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	515,305	2023/06/30
50回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	515,975	2023/07/14
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	340,688	2023/07/31
116回 高速道路機構債	0.7220	100,000	102,579	2023/09/20
56回 政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	558,444	2024/01/19

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	307,824	2024/09/13
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	512,180	2025/03/31
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	401,348	2026/04/28
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	200,000	202,492	2027/04/13
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	809,208	2027/04/30
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	303,123	2027/11/19
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	304,176	2028/02/18
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	234,556	2028/12/20
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	238,634	2029/09/20
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	215,540	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	236,862	2030/10/29
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	592,285	2030/10/31
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	423,048	2031/06/13
19回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	238,268	2031/12/26
13回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.9600	13,092	13,312	2032/05/10
14回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.7000	65,775	66,712	2032/05/10
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	118,487	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	236,520	2032/09/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	400,000	538,836	2033/12/20
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	342,360	2035/02/28
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	230,018	2035/06/28
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	199,156	2036/06/20
6回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	38,001	39,292	2037/05/10
8回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	26,704	27,709	2037/05/10
9回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	39,924	41,489	2037/05/10
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	212,890	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	279,906	2037/09/18
2回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	2.2700	42,426	44,458	2037/11/10
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	14,127	14,853	2041/06/10
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	54,016	56,417	2041/07/10
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	40,311	42,042	2042/02/10
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	66,765	69,041	2042/05/10
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	142,365	153,423	2044/10/10
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	242,352	257,370	2045/05/10
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	246,734	2045/10/31
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	234,732	2047/03/20
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	258,345	260,466	2051/11/10
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	272,001	276,067	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	272,523	276,398	2053/01/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	277,092	280,680	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	276,636	280,229	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	284,412	289,520	2053/10/10
小計	-	14,698,867	15,758,836	-
<b>(金融債券)</b>	%	千円	千円	
220号 利附商工債(3年)	0.1100	300,000	300,324	2021/05/27
325回 利附信金中金債	0.0400	400,000	400,144	2021/12/27
い第828号 利附商工債	0.1400	100,000	100,361	2024/05/27
小計	-	800,000	800,829	-

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

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	102,955	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	102,566	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	208,052	2023/11/24
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	214,718	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	309,522	2023/12/20
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	415,628	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	414,280	2024/02/23
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	204,432	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	108,529	2024/03/19
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	109,866	2024/09/20
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	204,332	2024/10/28
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債	0.8650	200,000	205,188	2024/11/28
321回 北海道電力社債	0.8860	161,000	165,995	2024/12/25
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	330,489	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	219,160	2025/06/20
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	221,934	2025/09/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	136,720	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	105,066	2026/06/25
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	203,128	2027/02/16
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	303,363	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	201,258	2027/05/07
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	200,000	201,994	2028/01/18
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	201,686	2028/06/06
14回 プリダストン社債	0.3750	200,000	201,412	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	108,193	2029/04/27
43回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	101,863	2038/07/12
小 計	-	10,181,000	10,545,134	-
合 計	-	203,069,867	221,573,805	-

## ■投資信託財産の構成

2020年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	221,573,805	99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,482,460	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	223,056,266	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月14日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	223,056,266,615円		
コ ー ル ・ 公 司 未 前	925,968,916		
社 債(評価額)	221,573,805,885		
利 費	530,848,633		
未 払 収 入	25,643,181		
(B) 負 債	196,906,000		
未 払 収 入	196,906,000		
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	222,859,360,615		
元 次 期 繰 越 損 益	168,870,516,479		
(D) 受 益 権 総 額	53,988,844,136		
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	168,870,516,479円		
	13,197円		
(注1) 期首元本額	223,973,156,427円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	4,843,326円
追加設定元本額	120,614,812,838円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	3,778,447円
一部解約元本額	175,717,452,786円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (D/C)	4,877,007円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	9,781,550円
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	21,184,712,153円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	191,589,421円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	69,986,260円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,735,395,954円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	68,506,951円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,293,364,512円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	18,787,911円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	723,181円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	987,848,234円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	610,771円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	253,839,832円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	708,717円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	25,260,802円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	498,022円
たわらノーロード 国内債券	10,015,397,101円	D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	644,889,238円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	1,002,734,258円
たわらノーロード バランス (堅実型)	198,546,011円	D I A M国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	10,109,222,296円
たわらノーロード バランス (標準型)	329,055,628円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	342,183,786円
たわらノーロード バランス (積極型)	41,366,056円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	5,071,969,240円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	14,261,260円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定)	5,050,603,156円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	422,619,412円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII (適格機関投資家限定)	5,102,756,119円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	415,409,126円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定)	5,076,506,178円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	104,078,457円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドV (適格機関投資家限定)	5,113,422,319円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	8,657,075円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	618,326,873円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	5,579,866円	D I A Mグローバル・バランスファンド25VA	219,862,252円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	8,704,630円	D I A Mグローバル・バランスファンド50VA	165,143,096円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,632,593円	D I A M国際分散バランスファンド30VA	61,558,322円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,871,083円	D I A M国際分散バランスファンド50VA	148,494,901円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	243,993円	D I A M国内重視バランスファンド30VA	70,976,271円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,054,492,139円	D I A M国内重視バランスファンド50VA	29,810,777円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	6,915,364,061円	D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	80,376,845円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	9,496,684,077円	D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	167,069,857円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,799,837,596円	D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,589,661,319円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	1,841,604,708円	D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,581,596,662円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,047,028,967円	D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,902,110,574円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	317,181,619円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA	528,103,309円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	82,330,193円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	243,077,089円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,373,109,117円	D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA	2,833,060,371円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,459,038円	D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	252,830,217円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	3,565,751,861円	D I A M世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	14,003,137円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	1,006,035,152円	D I A M世界アセットバランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	59,261,134円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	214,761,880円	D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	2,634,815,087円
投資のソムリエ	6,982,653,969円	D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	74,826,164円
グループコントロール	1,214,453,782円	D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	541,115,349円
投資のソムリエ<DC年金>	663,342,952円	D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	933,900,682円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,041,421,611円	D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	2,409,352,967円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	354,073,730円	D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	352,962,064円
グループコントロール<DC年金>	1,228,781円	D I A M国内アセットバランス30VA (適格機関投資家限定)	110,662,909円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,760,959円	D I A M国内アセットバランス20VA (適格機関投資家限定)	256,171,767円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	7,262,628円	D I A Mアセットバランス40VA (適格機関投資家限定)	739,037円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	522,448,330円	D I A Mアセットバランス60VA (適格機関投資家限定)	410,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,526,677,877円	期末元本合計	168,870,516,479円

## ■損益の状況

当期 自2019年2月15日 至2020年2月14日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

# 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第18期（決算日 2020年2月17日）

（計算期間 2019年2月16日～2020年2月17日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	円	%	（円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	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

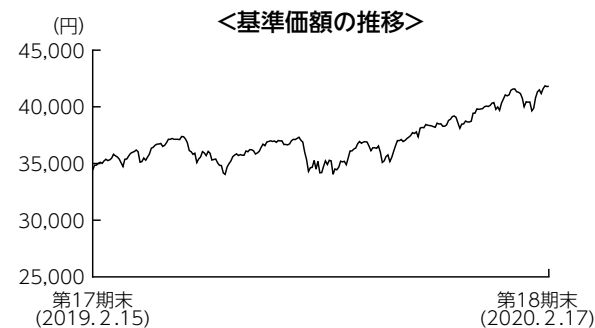
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2019年 2月 15日	34,418	% -	1,111,144.35	% -	% 95.3	% 2.0
2 月 末	35,326	2.6	1,141,179.46	2.7	95.4	2.0
3 月 末	35,574	3.4	1,149,447.69	3.4	95.6	1.7
4 月 末	37,169	8.0	1,201,500.33	8.1	96.0	1.1
5 月 末	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）

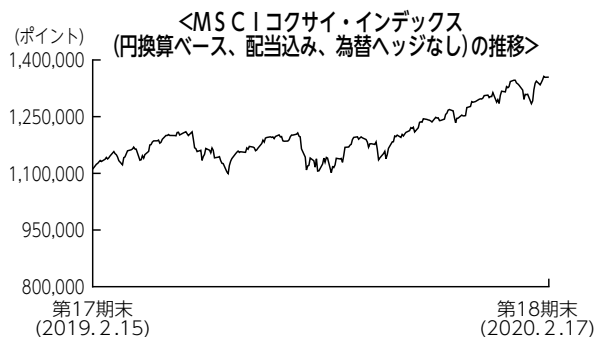


### 基準価額の推移

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月以降は米中対立の緩和期待や、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
<b>アメリカ</b>	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	(7.863)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	(-)	(-)	1.862	389
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	(△11.649)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	(-)	(-)	3.465	302
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8.128	974	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	(6.813)	(-)	8.885	151
MID AMERICA	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	2.065	151	1.424	169
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	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	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>カナダ</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>オーストラリア</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
LENDLEASE GROUP	-	-	17.897	223
	(△42.974)	(△572)	(-)	(-)
DEXUS	20.313	265	16.334	212
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	-	-	15.521	230
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	-	-	56.688	217
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>香港</b>	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
<b>シンガポール</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>イギリス</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (オランダ)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	(-)	(-)	1.163	153
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (フランス)</b>	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	
			千円	千ドル			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
MOODY'S CORP	154.93	129.22	3,590	394,195			資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	503.31	423.7	2,898	318,305			情報技術サービス
TARGET CORP	436.5	394.21	4,597	504,824			複合小売り
DEERE & CO	262.37	238.24	4,004	439,650			機械
MORGAN STANLEY	1,132.17	951.98	5,315	583,681			資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	198.91	180.81	1,815	199,383			商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	29.94	27.85	2,036	223,647			専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,280.37	1,394.4	19,457	2,136,428			娯楽
DOLLAR TREE INC	200.78	186.97	1,658	182,053			複合小売り
DOVER CORP	126.35	111.13	1,332	146,254			機械
OMNICOM GROUP	193.25	173.65	1,356	148,987			メディア
DTE ENERGY CO	160.34	148.17	1,985	218,038			総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	611.77	568.01	5,752	631,658			電力
FLOWERVE CORP	131.39	98.82	458	50,356			機械
DARDEN RESTAURANTS INC	109.9	97	1,180	129,628			ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	832.27	637.71	2,432	267,058			インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	8,277.12	6,844.79	23,854	2,619,179			銀行
CITIGROUP INC	2,166.9	1,746.72	13,762	1,511,112			銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	130.09	94.23	704	77,319			化学
E*TRADE FINANCIAL CORP	216.24	171.04	755	82,989			資本市場
EATON CORP PLC	384.09	318.18	3,294	361,763			電気設備
EATON VANCE CORP	91.84	91.84	451	49,563			資本市場
CADENCE DESIGN SYS INC	249.22	226.28	1,782	195,683			ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	217.62	177.49	709	77,895			メディア
ECOLAB INC	221.92	204.79	4,245	466,156			化学
PERKINELMER INC	-	83.38	796	87,486			ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	272.14	224.91	2,467	270,880			娯楽
SALESFORCE.COM INC	624.35	644.04	12,233	1,343,242			ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	-	22.43	366	40,281			保険
EMERSON ELECTRIC CO	543.24	467.05	3,433	376,974			電気設備
ATMOS ENERGY CORP	102.2	86.5	1,041	114,399			ガス
ENERGY CORP	162.59	150.31	2,016	221,368			電力
EOG RESOURCES INC	507.26	446.03	3,341	366,913			石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	102.31	91.61	1,492	163,917			専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	194.24	173.46	3,729	409,506			パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	147.92	125.15	918	100,848			航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,696.52	3,276.09	19,869	2,181,669			石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	126.34	102.09	1,076	118,226			化学
NEXTERA ENERGY INC	412.34	374.04	10,417	1,143,870			電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	-	28.75	861	94,557			資本市場
ASSURANT INC	40.89	45.94	654	71,890			保険
FASTENAL CO	254.18	458.91	1,758	193,088			商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	600.5	581.44	1,721	188,972			銀行
M&T BANK CORP	124.94	99.99	1,697	186,399			銀行
FISERV INC	357.37	443.49	5,424	595,639			情報技術サービス
FLIR SYSTEMS INC	116.23	116.23	668	73,394			電子装置・機器・部品
MACY'S INC	247.41	-	-	-			複合小売り
FORD MOTOR CO	3,243.91	3,108.36	2,517	276,451			自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	285.48	237.13	577	63,425			資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,172.69	1,149.93	1,407	154,545			金属・鉱業
FLEX LTD	676.69	351.27	477	52,377			電子装置・機器・部品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	164.78	142.7	1,557	171,036			保険
GAP INC/THE	182.95	182.95	331	36,439			専門小売り
DENTSPLY SIRONA INC	174.77	183.86	1,063	116,786			ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	221.43	188.21	3,539	388,634			航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	527.09	461.41	2,459	270,083			食品
GENUINE PARTS CO	134.32	116.05	1,119	122,924			販売

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
GILEAD SCIENCES INC	1,133.77	978.31	6,609	725,718	バイオテクノロジー
GARTNER INC	84.12	73.84	1,125	123,568	情報技術サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	180.97	—	—	—	自動車部品
MCKESSON CORP	168.48	145.58	2,446	268,590	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	504.9	447.12	12,957	1,422,688	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	7,610.66	6,747.57	8,657	950,553	コングロマリット
WW GRAINGER INC	43.31	37.62	1,157	127,080	商社・流通業
HALLIBURTON CO	737.63	668.43	1,478	162,346	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	363.73	327.28	2,286	251,044	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	307.11	249	5,903	648,181	資本市場
HARLEY-DAVIDSON INC	129.01	129.01	443	48,671	自動車
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	100.33	175.86	4,019	441,316	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	109.27	94.73	925	101,631	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	138	115.16	830	91,205	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	—	22.78	295	32,456	航空宇宙・防衛
HELMERICH & PAYNE INC	100.55	—	—	—	エネルギー設備・サービス
HERSHEY FOODS CORP	121.35	112.92	1,810	198,799	食品
HP INC	1,376.54	1,174.82	2,628	288,562	コンピュータ・周辺機器
F5 NETWORKS INC	48.74	48.74	621	68,238	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	104.72	104.72	837	91,986	容器・包装
UNITED THERAPEUTICS CORP	34.47	—	—	—	バイオテクノロジー
JUNIPER NETWORKS INC	277.4	279.39	677	74,361	通信機器
HOLLYFRONTIER CORP	153.39	118.55	513	56,388	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	233.77	196.88	1,043	114,615	ヘルスケア機器・用品
UNUM GROUP	207.2	151.85	455	50,036	保険
HOME DEPOT INC	998.38	846.67	20,745	2,277,905	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	150.79	131.85	1,173	128,860	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	241.61	241.61	1,173	128,876	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	430.2	376.78	1,024	112,444	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	35.69	29.13	713	78,292	建設関連製品
HUMANA INC	119.62	103.84	3,902	428,530	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	73.59	60	660	72,514	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	936.48	795.17	1,119	122,932	銀行
RED HAT INC	158.43	—	—	—	ソフトウェア
NEKTAR THERAPEUTICS	156.89	—	—	—	医薬品
BIOGEN INC	173.88	141.19	4,701	516,238	バイオテクノロジー
IDEX CORP	71.74	61.54	1,075	118,107	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	264.25	247.55	4,650	510,622	機械
INTUIT INC	208.8	200.54	6,102	670,025	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	74.02	67.91	1,961	215,329	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	109.6	659	72,360	バイオテクノロジー
INGERSOLL-RAND PLC	219.89	182.44	2,673	293,567	機械
INTEL CORP	4,016.49	3,428.07	23,060	2,532,056	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	74.46	79.65	1,082	118,826	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	329.83	294.11	1,270	139,474	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	291.57	288.62	706	77,546	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	96.31	101.08	1,017	111,718	建設・土木
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	72.47	60.19	1,035	113,725	情報技術サービス
INCYTE CORP	156.01	137.98	1,082	118,853	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,336.1	2,043.38	30,677	3,368,363	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	294.41	287.53	1,699	186,583	保険
KLA CORPORATION	136.39	127.24	2,242	246,279	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	448.78	333.12	760	83,467	石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	215.64	191.81	1,298	142,602	食品
EAST WEST BANCORP INC	146	115.6	552	60,671	銀行
KEYCORP	885.11	794.97	1,568	172,218	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	301.75	261.25	3,802	417,542	家庭用品

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

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
			千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
NIKE INC-CL B	1,120.86	967	10,012	1,099,352		繊維・アパレル・贅沢品
NOBLE ENERGY INC	394.36	394.36	755	82,964		石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	94.87	94.87	382	41,958		複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	245.31	202.6	4,241	465,709		陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	270.88	247.68	2,319	254,710		電力
NISOURCE INC	315.48	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		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	371.25	315	1,501	164,910	保険
ROSS STORES INC	328.58	288.14	3,508	385,284	専門小売り
ROLLINS INC	123.78	123.78	492	54,119	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	92.48	79.49	3,121	342,774	コンピュータソフト
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	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	
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
SS&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
SERVICENOW 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)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円	
BURLINGTON STORES INC	60.07	50.95	1,251	137,441	専門小売り
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	99.85	—	—	—	保険
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	295.78	916	100,612	医薬品
ANTERO RESOURCES CORP	131.63	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
VEEVA SYSTEMS INC	108.52	97.33	1,546	169,781	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	562.56	575.62	2,124	233,282	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	171.81	132.14	645	70,919	電気設備
EVERGY INC	244.27	183.88	1,330	146,054	電力
PLAINS GP HOLDINGS LP	149.35	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
COMMSCOPE HOLDING CO INC	129.2	—	—	—	通信機器
ALLEGION PLC	73.25	74.69	1,037	113,911	建設関連製品
STERIS PLC	—	66.58	1,121	123,188	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	—	72.2	645	70,880	ソフトウェア
WIX.COM LTD	40	40	593	65,115	情報技術サービス
DROPBOX INC	—	175.73	325	35,753	ソフトウェア
KKR & CO INC	—	373.07	1,251	137,390	資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	105.53	609	66,869	医薬品
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	239.27	206.55	2,338	256,796	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	217.72	181.44	770	84,629	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA CORP	328.31	290.83	6,408	703,614	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	129.6	129.6	685	75,248	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	—	564.34	2,744	301,333	化学
AMCOR PLC	—	1,300	1,327	145,737	容器・包装
PINTEREST INC	—	131.83	306	33,610	インタラクティブ・メディアおよびサービス
XEROX HOLDINGS CORP	—	174.55	660	72,484	コンピュータ・周辺機器
FOX CORP-A	—	262.57	992	108,978	メディア
FOX CORP-B	—	130.09	485	53,293	メディア
UBER TECHNOLOGIES INC	—	133.12	527	57,969	陸運・鉄道
CORTEVA INC	—	593.22	1,821	200,031	化学
BLACKSTONE GROUP INC	—	508.89	3,203	351,740	資本市場
GRUBHUB INC	81.58	81.58	411	45,136	インターネット販売・通信販売
PAYCOM SOFTWARE INC	—	39.23	1,233	135,439	ソフトウェア
SABRE CORP	258.26	198.09	436	47,937	情報技術サービス
PARSLEY ENERGY INC	174.54	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ARISTA NETWORKS INC	44.41	44.41	992	108,968	通信機器
IHS MARKIT LTD	349.91	297.96	2,406	264,214	専門サービス
FNF GROUP	253.11	213.72	963	105,786	保険
SYNCHRONY FINANCIAL	605.68	439.86	1,484	163,001	消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	403.2	358.2	1,385	152,090	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	—	34.57	411	45,147	ソフトウェア
CDK GLOBAL INC	127.15	99.69	519	57,028	ソフトウェア
WAYFAIR INC	50.91	50.91	419	46,094	インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	155.15	139.54	1,369	150,395	電子装置・機器・部品
QORVO INC	108.87	88.71	940	103,267	半導体・半導体製造装置
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	160.89	168.88	589	64,733	各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	100.18	83.07	1,138	125,022	メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	231.55	170.18	508	55,851	化学
GODADDY INC	146.41	123.28	966	106,109	情報技術サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	328.27	262.04	560	61,543	専門サービス
TRANSUNION	172.08	150	1,471	161,620	専門サービス
SQUARE INC	268.2	264.87	2,168	238,071	情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	1,993.38	587.57	3,119	342,575	化学
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	171	193.21	1,065	116,997	飲料
WESTROCK CO	223.94	182.84	741	81,367	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	546.03	511.63	1,375	151,003	食品
FORTIVE CORP	267.79	225	1,750	192,229	機械
MATCH GROUP INC	—	45.99	351	38,630	インタラクティブ・メディアおよびサービス

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(シンガポール)</b>	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<比率>	株数 銘柄数	17,314 —	1,366,497 <0.4%>	
<b>(ニュージーランド)</b>	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<比率>	株数 銘柄数	4,993 —	352,616 <0.1%>	
<b>(イギリス)</b>	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	
<b>(イギリス)</b>	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%>
<b>(イスラエル)</b>	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%>
<b>(スイス)</b>	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	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(ユーロ…オランダ)</b>	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 銘柄 数	株 数 銘柄 数	51.646	6,143,817	
	16,459.79	16,007.99	—	<1.7%>	
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>	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 銘柄 数	株 数 銘柄 数	10,266	1,221,337	
	1,730.65	1,531.51	—	<0.3%>	
<b>(ユーロ…ルクセンブルグ)</b>	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 銘柄 数	株 数 銘柄 数	2,476	294,652	
	2,054.39	1,852.02	—	<0.1%>	
<b>(ユーロ…フランス)</b>	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	
	銘柄数<比率>	銘柄数	—	<3.5%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	163.56	139	4,008	476,882	繊維・アパレル・贅沢品

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

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
INNOGY SE-TEMPORARY	97.69	—	—	—	総合公益事業
ZALANDO SE	143.53	99.64	472	56,267	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	158.02	127.08	496	59,109	化学
UNIPER SE	138.97	142.52	420	50,048	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	72.38	80.81	640	76,193	インターネット販売・通信販売
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	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・金額 銘柄数<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・金額 銘柄数<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	
<b>(アメリカ)</b>	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
<b>(カナダ)</b>	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
<b>(オーストラリア)</b>	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
<b>(香港)</b>	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
<b>(シンガポール)</b>	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	
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
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	350,796,430,193
未 収 入 当 金 証 拠	821,917,447
未 収 入 委 託 証 拠	9,281,030,671
未 収 入 委 託 証 拠	981,917,778
未 収 入 委 託 証 拠	425,800,789
(B) 負 債	2,480,411,891
未 収 入 委 託 証 拠	916,378,668
未 収 入 委 託 証 拠	704,679,668
(C) 純 資 産	211,699,000
元 本	370,420,447,198
次 期 繰 越 損 益	88,590,932,378
(D) 受 取 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	281,829,514,820
	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 (安成成長型)	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 (安成成長型)	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>	144,219,376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)	17,536,268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 受取 受取 支取 の他 の払 有価 証券 売買 損益	等配 取 取 利 収当	益金 7,745,119,922円 7,694,676,622 12,104,811 38,840,064 △501,575
(B)	買 買 損益	損益	益金 59,213,874,771 74,270,892,711 △15,057,017,940
(C)	先物 取引 取引 損益	取引 取引 損益	損益金 1,575,644,220 1,915,607,176 △339,962,956
(D)	そ の 他 費 用	費用	費用 △122,413,484
(E)	当期 損益 繰越	損益	金(A+B+C+D) 68,412,225,429
(F)	前期 繰越	繰越	損益金 248,087,509,699
(G)	解約 差損 益金	差損 損益	損益金 △99,035,323,364
(H)	追加 信託 差損 益金	差損 損益	損益金 64,365,103,056
(I)	合計 繰越 損益 金(I)	合計 損益	計(E+F+G+H) 281,829,514,820 281,829,514,820

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

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

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

# 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2020年2月21日）

（計算期間 2019年2月22日～2020年2月21日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
13期（2016年2月22日）	17,881	△5.0	ポイント 111,769.89	% △5.0	% 97.6	% -	百万円 267,780
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9	108,792.68	△2.7	97.9	-	248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

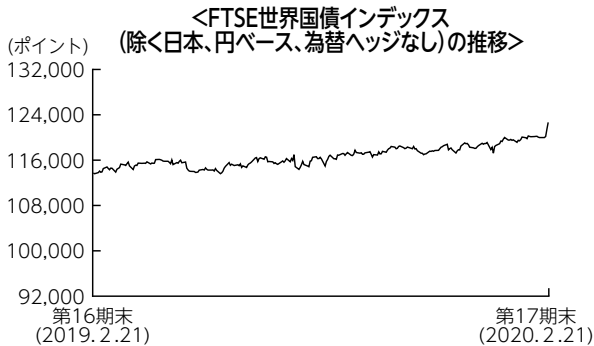
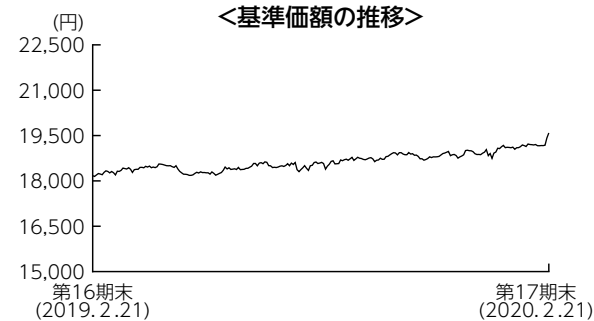
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2019年2月22日から2020年2月21日まで）



### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は19,586円となり、前期末比で7.8%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

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

### 投資環境

外国債券市場では、米国債、ドイツ債の利回りは、ともに低下しました。米中貿易摩擦やブレグジット等の不透明感があり、FRBが政策金利を引き下げ、ECBも追加的に金融緩和したことから、利回りは低下しました。その後、米中貿易協議やブレグジット交渉の進展見込みから利回りは上昇に転じる場面もありましたが、新型コロナウイルス感染症の流行による世界的な景気減速懸念もあり、利回りは低下しました。

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

## ポートフォリオについて

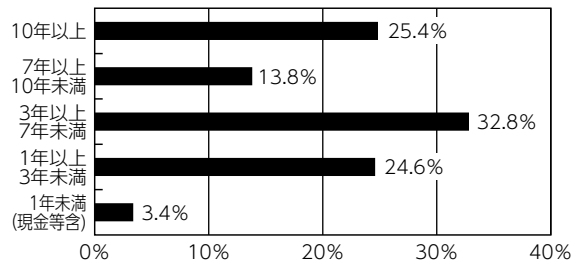
ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

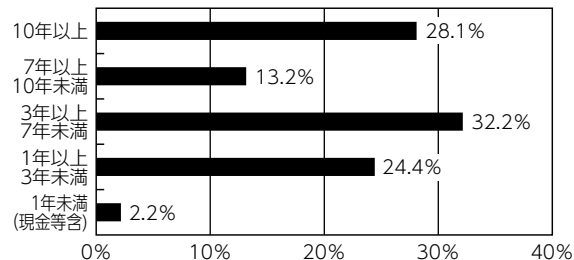
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○残存別構成比

#### 期首（前期末）



#### 期末



### ○国別構成比

#### 期首（前期末）

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

#### 期末

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

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

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で7.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.06%と、ベンチマークにはほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

## 今後の運用方針

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（18,642円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については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22日から2020年2月21日まで)

### 公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 107,300	千アメリカ・ドル 405,150
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 188	千カナダ・ドル 19,520
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 3,427	千オーストラリア・ドル 25,741
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル -	千シンガポール・ドル 2,415
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 2,451	千イギリス・ポンド 44,126
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ -	千デンマーク・クローネ 25,089
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ -	千ノルウェー・クローネ 10,045
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 14,936	千スウェーデン・クローナ 47,435
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 8,060	千メキシコ・ペソ 117,770
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット -	千マレーシア・リンギット 2,205
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド -	千南アフリカ・ランド 42,074
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 1,276	千ポーランド・ズロチ 15,660
国	ユーロ	アイルランド	千ユーロ 833	千ユーロ 6,664
		オランダ	1,643	14,408
		ベルギー	1,491	17,459
		フランス	13,545	74,730
		ドイツ	5,785	51,063
		スペイン	3,915	41,082
		イタリア	9,222	62,374
		フィンランド	380	5,630
	オーストリア	1,021	10,482	

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

## ■利害関係人との取引状況等 (2019年2月22日から2020年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	期		末		
									額			額	償
									外	貨			
(アメリカ)					%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	
US T N/B 2.75 04/30/23		国	債	証	券	2.7500	2,490		2,597		291,170	2023/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24		国	債	証	券	2.2500	3,300		3,417		383,142	2024/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30		国	債	証	券	6.2500	710		1,027		115,233	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40		国	債	証	券	4.3750	1,300		1,859		208,492	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41		国	債	証	券	4.3750	1,040		1,496		167,722	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42		国	債	証	券	3.0000	980		1,171		131,360	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39		国	債	証	券	4.2500	810		1,134		127,196	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43		国	債	証	券	2.8750	2,720		3,188		357,493	2043/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44		国	債	証	券	3.3750	2,420		3,078		345,131	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45		国	債	証	券	3.0000	2,500		3,007		337,162	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47		国	債	証	券	3.0000	2,350		2,857		320,369	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46		国	債	証	券	2.5000	2,790		3,083		345,702	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48		国	債	証	券	3.1250	2,660		3,323		372,556	2048/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/22		国	債	証	券	1.7500	5,400		5,444		610,360	2022/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49		国	債	証	券	2.8750	3,700		4,443		498,157	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38		国	債	証	券	4.5000	700		1,000		112,209	2038/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23		国	債	証	券	1.7500	5,990		6,063		679,723	2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24		国	債	証	券	2.5000	6,240		6,529		731,975	2024/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/21		国	債	証	券	3.1250	8,000		8,160		914,922	2021/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25		国	債	証	券	2.1250	5,150		5,341		598,792	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28		国	債	証	券	2.8750	4,430		4,906		550,075	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29		国	債	証	券	2.3750	4,840		5,196		582,630	2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27		国	債	証	券	2.3750	3,100		3,295		369,452	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37		国	債	証	券	5.0000	500		745		83,578	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26		国	債	証	券	1.6250	4,290		4,339		486,512	2026/05/15	
US T N/B 2.0 05/31/21		国	債	証	券	2.0000	10,130		10,197		1,143,260	2021/05/31	
US T N/B 1.625 05/31/23		国	債	証	券	1.6250	2,900		2,924		327,887	2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24		国	債	証	券	2.0000	4,770		4,893		548,635	2024/05/31	
US T N/B 2.125 05/31/26		国	債	証	券	2.1250	2,050		2,135		239,395	2026/05/31	
US T N/B 2.75 05/31/23		国	債	証	券	2.7500	3,270		3,414		382,781	2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25		国	債	証	券	2.8750	2,530		2,720		305,021	2025/05/31	
US T N/B 1.375 06/30/23		国	債	証	券	1.3750	3,460		3,462		388,233	2023/06/30	
US T N/B 2.125 06/30/22		国	債	証	券	2.1250	6,530		6,642		744,718	2022/06/30	
US T N/B 2.75 06/30/25		国	債	証	券	2.7500	790		845		94,773	2025/06/30	
US T N/B 1.875 06/30/26		国	債	証	券	1.8750	720		739		82,894	2026/06/30	
US T N/B 2.625 06/30/23		国	債	証	券	2.6250	1,820		1,895		212,472	2023/06/30	
US T N/B 1.75 06/30/24		国	債	証	券	1.7500	1,340		1,361		152,621	2024/06/30	
US T N/B 1.75 06/15/22		国	債	証	券	1.7500	830		837		93,847	2022/06/15	
US T N/B 2.875 07/31/25		国	債	証	券	2.8750	3,390		3,652		409,506	2025/07/31	
US T N/B 1.875 07/31/26		国	債	証	券	1.8750	2,370		2,434		272,903	2026/07/31	
US T N/B 1.75 07/31/24		国	債	証	券	1.7500	3,690		3,749		420,408	2024/07/31	
US T N/B 2.75 07/31/23		国	債	証	券	2.7500	3,270		3,422		383,640	2023/07/31	
US T N/B 6.25 08/15/23		国	債	証	券	6.2500	1,000		1,165		130,695	2023/08/15	
US T N/B 3.75 08/15/41		国	債	証	券	3.7500	410		544		61,058	2041/08/15	
US T N/B 5.5 08/15/28		国	債	証	券	5.5000	650		858		96,253	2028/08/15	
US T N/B 3.875 08/15/40		国	債	証	券	3.8750	1,110		1,493		167,452	2040/08/15	
US T N/B 2.75 08/15/42		国	債	証	券	2.7500	1,800		2,068		231,925	2042/08/15	
US T N/B 3.125 08/15/44		国	債	証	券	3.1250	2,830		3,465		388,483	2044/08/15	

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

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	3,022	338,809	2049/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	10,400	10,504	1,177,648	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,190	5,430	608,761	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,840	5,481	614,550	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	5,620	5,657	634,316	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	6,020	6,323	708,963	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	4,140	4,286	480,525	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	6,590	6,702	751,387	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	4,040	4,270	478,755	2027/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	3,480	3,762	421,780	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	5,640	5,951	667,274	2023/11/30
US T N/B 2.875 11/15/21	国債証券	2.8750	4,880	5,000	560,624	2021/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,400	2,448	274,445	2029/11/15
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	4,830	4,991	559,597	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,203	359,190	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,446	274,261	2025/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	9,160	9,279	1,040,325	2021/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	5,520	5,636	631,949	2022/12/31
US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	2.6250	3,770	3,851	431,751	2021/12/15
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	740	754	84,588	2026/12/31
小計	—	—	526,820	563,002	63,118,202	—
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	548	46,416	2024/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	1,160	1,171	99,128	2023/03/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	800	808	68,387	2026/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	230	335	28,371	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,100	1,519	128,577	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	720	1,101	93,205	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	870	1,347	114,029	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,600	1,676	141,799	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	880	1,293	109,452	2041/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	4,700	4,801	406,168	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	2,240	2,305	195,010	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,214	102,704	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	1,020	1,073	90,824	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,500	1,570	132,873	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	800	781	66,143	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	659	55,814	2029/06/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	600	593	50,204	2021/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	740	755	63,915	2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	800	791	66,974	2022/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	1,020	1,473	124,634	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	980	1,285	108,783	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	420	483	40,925	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	507	42,903	2064/12/01
小計	—	—	24,880	28,099	2,377,248	—
<b>(オーストラリア)</b>		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	870	1,138	84,513	2047/03/21

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

銘柄	種類	当	利率	額面金額	期		末	
					評価額			償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(イギリス)</b>			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券		1.2500	960	1,014	146,584	2027/07/22	
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券		0.5000	1,920	1,922	277,671	2022/07/22	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券		0.7500	1,560	1,575	227,575	2023/07/22	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券		4.2500	920	1,458	210,728	2039/09/07	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券		2.2500	1,180	1,254	181,220	2023/09/07	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券		2.7500	1,380	1,522	219,923	2024/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券		2.0000	790	858	124,071	2025/09/07	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券		4.5000	900	1,356	195,903	2034/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券		1.7500	1,540	1,739	251,221	2037/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券		1.7500	1,530	1,580	228,255	2022/09/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券		1.6250	510	603	87,188	2054/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券		1.6250	580	754	108,964	2071/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券		1.6250	1,830	2,002	289,220	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券		0.8750	430	441	63,841	2029/10/22	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券		6.0000	760	1,118	161,619	2028/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券		4.7500	990	1,642	237,229	2038/12/07	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券		4.5000	1,080	1,842	266,174	2042/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券		4.2500	1,170	2,042	295,031	2046/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券		4.2500	1,000	1,987	287,074	2055/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券		4.2500	970	1,250	180,594	2027/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券		4.2500	960	1,545	223,177	2040/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券		4.7500	1,120	1,605	231,852	2030/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券		4.2500	990	1,802	260,337	2049/12/07	
小計	—	—	—	41,680	56,394	8,145,652	—	
<b>(デンマーク)</b>			%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券		4.5000	8,390	16,295	263,824	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券		1.7500	5,320	6,049	97,935	2025/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券		1.5000	5,500	5,948	96,302	2023/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券		0.5000	7,130	7,706	124,761	2027/11/15	
小計	—	—	—	26,340	35,998	582,823	—	
<b>(ノルウェー)</b>			%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券		1.5000	3,770	3,809	45,824	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券		1.7500	3,970	4,079	49,074	2027/02/17	
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券		3.0000	6,200	6,611	79,537	2024/03/14	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券		1.7500	3,800	3,880	46,678	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券		2.0000	2,070	2,170	26,109	2028/04/26	
小計	—	—	—	19,810	20,550	247,224	—	
<b>(スウェーデン)</b>			%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円		
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券		3.5000	3,270	5,206	59,461	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券		0.7500	3,740	4,035	46,082	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券		2.5000	6,180	7,111	81,214	2025/05/12	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券		1.0000	4,250	4,623	52,795	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券		0.7500	2,170	2,349	26,836	2029/11/12	
小計	—	—	—	19,610	23,326	266,391	—	
<b>(メキシコ)</b>			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券		5.7500	14,859	14,326	85,245	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券		8.5000	15,109	17,164	102,129	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券		7.7500	10,000	10,921	64,981	2031/05/29	



銘	柄	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	
<b>(メキシコ)</b>			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	19,118	113,752	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	14,643	16,258	96,736	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	5,000	5,744	34,181	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	11,125	13,202	78,554	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	8,085	10,775	64,116	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	7,732	46,010	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	27,596	31,618	188,129	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,724	87,610	2023/12/07	
小 計	—	—	145,488	161,587	961,447	—	
<b>(マレーシア)</b>			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	850	22,746	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,247	33,363	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,323	88,891	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	2,016	53,928	2030/04/15	
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,850	2,025	54,192	2032/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,297	34,697	2033/04/15	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	2,570	2,669	71,418	2027/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,111	56,472	2028/06/15	
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.1600	4,000	4,073	108,964	2021/07/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,569	68,728	2024/07/15	
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	3,050	81,596	2022/08/15	
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,600	1,871	50,056	2028/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,422	64,803	2043/09/30	
小 計	—	—	27,550	29,527	789,861	—	
<b>(南アフリカ)</b>			%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	国債証券	8.0000	10,900	10,307	76,481	2030/01/31	
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	10,000	8,856	65,712	2044/01/31	
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9.0000	4,860	4,442	32,966	2040/01/31	
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	8,820	7,850	58,250	2037/01/31	
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	16,040	14,065	104,363	2048/02/28	
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	3,570	2,491	18,490	2041/02/28	
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7.7500	3,600	3,719	27,600	2023/02/28	
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	7,030	6,033	44,771	2031/02/28	
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8.8750	8,410	7,892	58,560	2035/02/28	
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	6,590	6,119	45,404	2032/03/31	
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	7,460	5,363	39,800	2036/03/31	
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	16,420	18,601	138,019	2026/12/21	
小 計	—	—	103,700	95,743	710,419	—	
<b>(ポーランド)</b>			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	1,350	1,384	39,139	2023/01/25	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,896	53,615	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	1,900	1,990	56,265	2028/04/25	
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	4,000	4,060	114,798	2022/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,361	66,765	2024/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,440	2,513	71,059	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,547	72,005	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,280	2,348	66,396	2027/07/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	1,720	1,900	53,732	2022/09/23	

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

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

銘柄	柄	当期				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	
<b>(ユーロ…フランス)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	0.0000	3,000	3,043	368,002	2022/05/25	
FRANCE OAT 05/25/21	国債証券	0.0000	2,510	2,528	305,825	2021/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	1,280	1,643	198,741	2039/06/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	3,500	4,131	499,630	2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	1,800	2,472	298,974	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	2,700	3,357	406,048	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,770	3,003	363,187	2038/10/25	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.2500	2,980	3,174	383,851	2021/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,120	3,699	447,366	2032/10/25	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	3,030	3,265	394,870	2022/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,680	2,976	359,967	2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	1,720	1,867	225,874	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	1,380	1,442	174,397	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	2,140	2,338	282,736	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	610	622	75,322	2029/11/25	
小計	-	-	83,180	102,810	12,432,844	-	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	840	1,067	129,067	2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,100	1,646	199,120	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	710	1,192	144,230	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,240	2,059	249,010	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,500	2,590	313,214	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.0000	1,650	1,732	209,565	2022/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,360	1,439	174,074	2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	1,260	1,346	162,775	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,670	1,785	215,972	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	970	1,033	124,989	2023/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,430	1,552	187,720	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,500	1,646	199,107	2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	1,800	1,907	230,666	2027/02/15	
BUNDESUBL 04/08/22	国債証券	0.0000	1,340	1,358	164,301	2022/04/08	
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	1,130	1,153	139,552	2023/04/14	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	630	647	78,283	2024/04/05	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,010	1,103	133,488	2024/05/15	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	850	910	110,091	2023/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	710	1,085	131,313	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	600	871	105,369	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	840	1,570	189,868	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	900	1,579	191,063	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,660	2,696	326,082	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	920	1,852	224,006	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	1,150	1,211	146,466	2021/07/04	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	1,540	1,628	196,902	2022/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,370	2,391	289,210	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	1,730	2,882	348,631	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	1,040	1,401	169,533	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	670	731	88,450	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	1,600	1,730	209,317	2027/08/15	

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

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

銘	柄	当 期					末
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(ユーロ…イタリア)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,900	2,201	266,175	2024/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	740	1,066	128,979	2049/09/01	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	1,150	1,311	158,652	2022/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,020	1,147	138,767	2036/09/01	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	1,500	1,559	188,540	2022/09/15	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	980	1,001	121,096	2023/10/15	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,190	1,580	191,151	2023/11/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	1,080	1,556	188,214	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,790	2,568	310,648	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,030	2,854	345,155	2029/11/01	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	1,960	2,253	272,494	2022/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	1,040	1,099	132,941	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	550	615	74,385	2025/11/15	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国債証券	0.3500	1,700	1,716	207,544	2021/11/01	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	970	1,058	128,015	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,350	1,415	171,157	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	970	1,073	129,785	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,400	1,640	198,340	2028/12/01	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2.1500	1,680	1,751	211,796	2021/12/15	
小 計	—	—	81,140	96,539	11,674,496	—	
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	280	310	37,537	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	380	419	50,722	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	130	169	20,476	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	300	317	38,438	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	230	267	32,369	2034/04/15	
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	170	181	21,932	2023/04/15	
FINLAND 04/15/22	国債証券	0.0000	320	324	39,228	2022/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	430	536	64,824	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	380	479	58,015	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	350	541	65,528	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	270	289	35,043	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	300	323	39,082	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	240	257	31,089	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	300	320	38,704	2027/09/15	
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	400	423	51,178	2022/09/15	
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	230	235	28,422	2023/09/15	
小 計	—	—	4,710	5,396	652,595	—	
<b>(ユーロ…オーストリア)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	250	571	69,171	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	370	485	58,758	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	340	364	44,050	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	820	892	107,980	2028/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	590	782	94,684	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	890	1,509	182,536	2037/03/15	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.6500	280	305	36,999	2022/04/20	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	520	553	66,980	2027/04/20	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	480	645	78,117	2034/05/23	

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

## ■投資信託財産の構成

2020年2月21日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
127,972,430		97.7	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,017,425	2.3	
投 資 信 託 財 産 総 額	130,989,855	100.0	

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、130,489,048千円、99.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.11円、1カナダ・ドル=84.60円、1オーストラリア・ドル=74.21円、1シンガポール・ドル=80.07円、1イギリス・ポンド=144.44円、1デンマーク・クローネ=16.19円、1ノルウェー・クローネ=12.03円、1スウェーデン・クローナ=11.42円、1メキシコ・ペソ=5.95円、1マレーシア・リンギット=26.75円、1南アフリカ・ランド=7.42円、1ポーランド・ズロチ=28.27円、1ユーロ=120.93円です。



# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月21日)現在

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

(注1) 期首元本額	108,789,722,301円	D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	109,167,362円
追加設定元本額	14,409,786,591円	4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	177,161,233円
一部解約元本額	56,414,915,093円	クルーズコントロール<DC年金>	1,269,534円
(注2) 期末における元本の内訳		D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,786,439円
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	8,874,003,827円	D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	7,504,090円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	5,775,654円	4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	38,912,796円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	22,123,281円	9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,359,994円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	25,741,467円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	139,662円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	80,085,833円	D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,165,889,077円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	83,655,608円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	818,056円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	35,465,308円	D I A M指替フルヘルプ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	6,588,503,236円
たわらノーロード 先進国債券	6,509,607,053円	D I A M外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	3,322,079,347円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	149,495,926円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,199,859,662円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	479,712,374円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	6,073,392,201円
たわらノーロード バランス (堅実型)	11,707,903円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	71,552,724円
たわらノーロード バランス (標準型)	55,613,057円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	255,255円
たわらノーロード バランス (積極型)	11,564,861円	D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	606,183,336円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,913,072円	D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	455,700,977円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	134,211,407円	D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	42,453,454円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	176,522,766円	D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	68,261,200円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	60,240,852円	D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	19,577,030円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	36,378,986円	D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,136,190円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	68,332円	D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	55,431,781円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,616,898円	D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	76,799,804円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	4,040,132円	D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,762,682,039円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,282,053円	D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,924,647,331円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,349,638円	D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,376,447,915円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,832,006,477円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	234,213,008円
One D C 先進国債券インデックスファンド	639,979円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	234,213,008円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	585,714,796円	D I A Mアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,604,999,197円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	1,821,374,172円	D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家向け)	639,500,550円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	1,899,253,523円	D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	4,781,172円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	367,533,477円	D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	91,625,774円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	797,283,999円	D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	449,766,733円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	632,041,626円	D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	644,060,493円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	20,946,445円	D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	1,151,182,638円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	607,750,277円	D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	73,750,748円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	22,230,425円	D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	44,525,537円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	125,271,635円	D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	364,076円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	89,691,387円	D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)	170,414円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	147,541,325円	期末元本合計	66,784,593,799円
クルーズコントロール	1,255,331,264円		

## ■損益の状況

当期 自2019年2月22日 至2020年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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