

運用報告書(全体版)

第1期<決算日2019年1月11日>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合（インデックス型）
信託期間	2018年7月30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	<p>9 資産分散投資・スタンダード <DC年金></p> <p>以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>国内株式パッジ・ファンド 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。</p> <p>国内債券パッジ・ファンド・マザーファンド わが国の公社債を主要投資対象とします。</p> <p>外国株式パッジ・ファンド・マザーファンド 海外の株式を主要投資対象とします。</p> <p>外国債券パッジ・ファンド・マザーファンド 海外の公社債を主要投資対象とします。</p> <p>為替フルハッジ外国債券パッジ・ファンド・マザーファンド 海外の公社債を主要投資対象とします。</p> <p>エマージング株式パッジ・マザーファンド 海外の証券取引所に上場している株式[※]を主要投資対象とします。 ※DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p> <p>エマージング債券パッジ・マザーファンド 新興国との公社債を主要投資対象とします。</p> <p>J-REITインデックスファンド・マザーファンド 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <p>外国リート・パッジ・ファンド・マザーファンド 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券[※]を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものと含みます。）されている不動産投資信託証券とします。</p>
運用方法	主としてマザーファンドへの投資を通じて、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）、先進国債券（除く日本・為替ヘッジあり）、新興国株式・新興国債券、国内リート、先進国リート（除く日本）に投資し、基本配分比率による成績ベンチマークに概ね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。
組入制限	マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。 実質組入外貨建資産のうち、先進国債券については、その一部につき為替フルハッジ外国債券パッジ・ファンド・マザーファンドへの投資を通じて対円での為替ヘッジを行います。
分配方針	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。 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。

<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

お客様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。

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>

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、「9資産分散投資・スタンダード<DC年金>」は、2019年1月11日に第1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/>

9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 ペ ン チ マ ー ク	期 中 騰落率	株式組入比	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	純資産額	
	(分配額)	税込み分配金										
(設 定 日) 2018年7月30日	円 10,000	円 -	% ポイント (7月27日) 14,950.15	% - 14,950.15	% - -	% - -	% - -	% - -	% - -	% - -	百万円 1	
1期(2019年1月11日)	9,904	0	△1.0	14,825.49	△0.8	11.0	0.5	79.4	-	-	3.3	0.9

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産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) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注6) 合成ペンチマークは委託会社が独自に合成した指標です。

(注7) △(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 ペ ン チ マ ー ク	騰 落 率	株式組入比	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	
	(分配額)	騰 落 率									
(設 定 日) 2018年7月30日	円 10,000	% -	ポイント (7月27日) 14,950.15	% - 14,950.15	% - -	% - -	% - -	% - -	% - -	% - -	
7月末	10,000	0.0	14,941.30	△0.1	-	-	-	-	-	-	-
8月末	9,983	△0.2	14,914.38	△0.2	11.8	0.6	76.9	-	-	-	3.1
9月末	10,003	0.0	14,956.68	0.0	12.4	0.4	78.4	-	-	-	3.1
10月末	9,861	△1.4	14,749.59	△1.3	11.2	0.5	77.8	-	-	-	3.1
11月末	9,931	△0.7	14,858.70	△0.6	11.7	0.3	78.2	-	-	-	3.2
12月末	9,874	△1.3	14,767.78	△1.2	10.5	0.4	78.2	-	-	-	3.0
(期 末) 2019年1月11日	9,904	△1.0	14,825.49	△0.8	11.0	0.5	79.4	-	-	-	3.3

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

(注2) 謄落率は設定日比です。

(注3) 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。

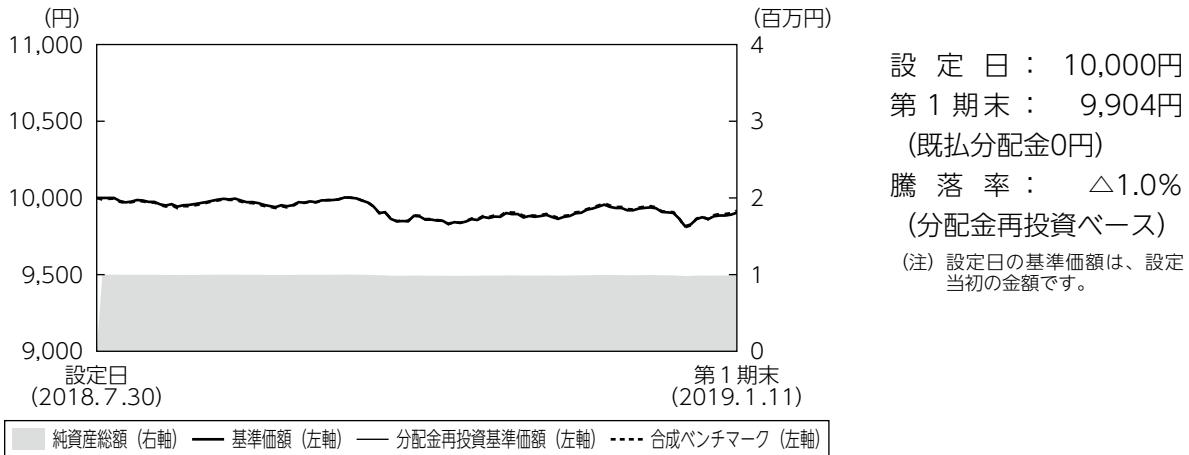
(注4) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注5) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注6) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年7月30日から2019年1月11日まで）

基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(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) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。

(注4) 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、設定日前日を10,000として指数化しています。

基準価額の主な変動要因

株式市場の下落や世界的な景気減速懸念等を背景に国内外の債券が上昇したことや、国内の長期金利が低位で推移する中、相対的な利回りの高さが買い材料視され国内リートが上昇したこと等がプラスに寄与しました。一方、米中問題の激化懸念や世界的な景気減速懸念、英国のＥＵ（欧州連合）離脱を巡る懸念等を背景に新興国を含め世界的に株式市場が下落したこと、主要通貨に対して円高が進行したこと等がマイナスに寄与し、基準価額は下落しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	△12.6%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.2%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	△10.4%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△1.9%
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.6%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	△10.3%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	△2.5%
J－REITインデックスファンド・マザーファンド	5.5%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△4.5%

投資環境

国内株式市場は2018年9月半ばまでは、米中貿易摩擦、為替動向、シリアや北朝鮮などの地政学リスクなどの動向次第で、一進一退の展開となりました。9月後半には、米国の長期金利上昇に伴い円安が進行したことや自動車関税問題が後退したことなどを要因として上昇しました。10月以降は、米国長期金利の上昇を受けて米国株式が下落したことや世界景気の減速懸念、米中貿易摩擦の激化などを嫌気し、国内株式市場は急落しました。

国内債券市場は上昇（利回りは低下）しました。設定から2018年10月にかけては、日銀による国債買い入れオペ（公開市場操作）の運営見直しを巡る思惑などから10年国債利回りは上昇基調で推移し、一時0.16%程度まで上昇しました。10月から期末にかけては、世界景気の減速懸念などを受けて低下基調に転じ、通期では10年国債利回りは低下（価格は上昇）しました。

先進国株式市場では、米国市場は米中貿易摩擦が警戒されながらも、9月までは良好な企業決算などを背景に底堅く推移しました。10月に入ると、米国長期金利の上昇が嫌気され世界同時株安の展開となり、期末にかけてやや値を戻したものの、設定日比では下落となりました。欧州では、9月までは方向感の定まらない展開が続いていましたが、10月以降は、イタリア財政への懸念などから軟調に推移し、各国市場は設定日比で下落となりました。

先進国債券市場では、米国債利回りが堅調な経済情勢を背景とした段階的な利上げを受けて上昇（価格は下落）基調で推移しましたが、2018年末には米中貿易摩擦の経済への影響が懸念される中で利回りは低下（価格は上昇）に転じました。期末の利回りは設定日と比べ小幅低下となりました。欧州圏では ECB（欧州中央銀行）が金融緩和政策を継続する中で金利の上昇は抑えられ、欧州債利回りは概ね低下する展開となりました。

新興国株式市場は下落しました。米国長期金利の上昇を背景に新興国通貨が下落したことや、米国トランプ政権が通商面での対外強硬姿勢を強めたために米中貿易摩擦拡大への不安が強まったことなどが嫌気されました。期の後半には世界景気の先行きに警戒感が台頭してきたことや中国通信機器大手ファーウェイの副会長逮捕なども市場の重しとなりました。

新興国債券の利回りは上昇しました。ベースとなる米国の長期金利は、F R B（米連邦準備理事会）による利上げや良好な米雇用統計等に伴って上昇した後、期末にかけて利上げペースの鈍化観測などから低下しました。対米国債スプレッド（利回り格差）は、貿易摩擦や原油価格の下落などを背景に、リスク回避の動きが強まったことから拡大しました。

国内リート市場は、国内長期金利が相対的に低位で安定的に推移したことに加え、米中貿易摩擦の悪化懸念からリスク回避姿勢が強まる中、比較的リスクが低いと見られて選好される展開となり上昇しました。2018年12月に入ると世界的にリスク性資産全般の下落基調が強まったことから下落しましたが、期末にかけて一部値を戻す展開となり、通期で上昇しました。

外国リート市場では、米国リート市場は米国長期金利の上昇や米中貿易摩擦への警戒感からリスク回避姿勢が強まる中、下落しました。米国金利上昇が一服する局面では、上昇する場面も見られましたが、設定日比では下落しました。欧州リート市場はフランスやイギリスを中心に大幅下落となりました。豪州リート市場は、9月中旬から11月初にかけ米豪長期金利の上昇等により調整しましたが、堅調な小売売上高などを背景とした豪州経済への期待などから、設定日比では上昇しました。

為替市場では、米ドル／円相場は、2018年夏場に米長期金利が上昇し、日米金利差が拡大したこと等を背景に円安ドル高となったものの、12月に入るとリスク回避姿勢が強まつたことから円高ドル安となり、設定日比でも円高ドル安となりました。一方、米ドル以外の主要通貨に対しては、政治情勢に対する不透明感等を背景に英ポンドやユーロに対して円高基調で推移したほか、世界的な景気減速懸念等を背景に新興国通貨に対しても円高が進むなど、円は独歩高の動きとなりました。

ポートフォリオについて

当ファンドでは、以下の基本配分比率による合成ベンチマークに概ね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 5%、国内債券37.5%、先進国株式（除く日本） 5%、先進国債券（除く日本） 2%、先進国債券（除く日本、為替ヘッジあり） 37.5%、新興国株式2.5%、新興国債券2.5%、国内リート1.5%、先進国リート（除く日本） 1.5%、短期金融資産 5%

●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（T O P I X）（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N O M U R A - B P I 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M S C I コクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

● J-R E I T インデックスファンド・マザーファンド

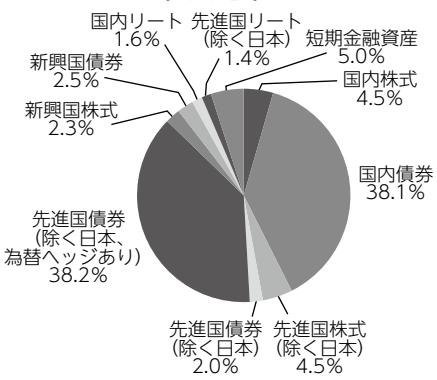
配当落ち以外の場合ではリートの実質組入比率を高め、ベンチマークである東証 R E I T 指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持しました。

● 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークである S & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致し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

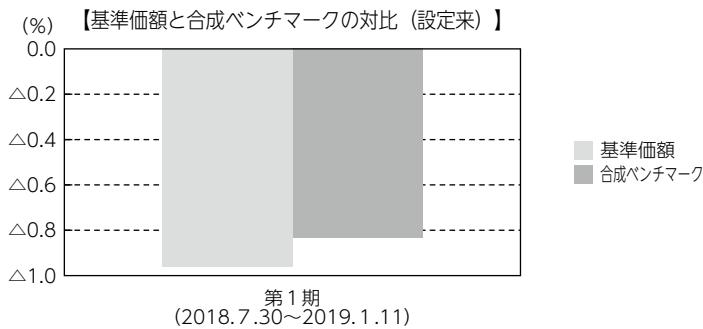


(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

合成ベンチマークとの差異について

合成ベンチマークは設定来で0.8%下落しました。

当ファンドの騰落率は合成ベンチマーク比で△0.1%と、信託報酬の影響を除くと合成ベンチマークにほぼ連動した投資成果となりました。



(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、市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期	
	2018年7月30日 ～2019年1月11日	
当期分配金（税引前）	－円	
対基準価額比率	－%	
当期の収益	－円	
当期の収益以外	－円	
翌期繰越分配対象額	73円	

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切り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アロケーション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目標と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、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を概ね一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

●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。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

●J－REITインデックスファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざし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1期		項目の概要	
	(2018年7月30日 ～2019年1月11日)			
	金額	比率		
(a) 信託報酬	8円	0.079%	(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9,923円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、 口座内でのファンドの管理等の対価 受託銀行分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価	
(投信会社)	(4)	(0.036)		
(販売会社)	(3)	(0.033)		
(受託銀行)	(1)	(0.010)		
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料	
(株式)	(0)	(0.001)		
(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	0.001	(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)	(0.001)		
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)		
(投資証券)	(0)	(0.000)		
(d) その他費用	0	0.004	(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)	(0.003)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用	
(その他)	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用	
合計	8	0.084		

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

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2018年7月30日から2019年1月11日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
国内株式パッジブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	千口 18	千円 50	千口 -	千円 -
国内債券パッジブ・ファンド・ マザーファンド	290	375	-	-
外国株式パッジブ・ファンド・ マザーファンド	13	50	-	-
外国債券パッジブ・ファンド・ マザーファンド	11	20	-	-
為替フルヘッジ外国債券 パッジブ・ファンド・マザーファンド	283	375	-	-
エマージング株式パッジブ・ マザーファンド	20	25	-	-
エマージング債券パッジブ・ マザーファンド	13	25	-	-
J-R E I Tインデックスファンド・ マザーファンド	8	15	-	-
外国リート・パッジブ・ファンド・ マザーファンド	12	15	-	-

■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	国内株式パッジブ・ ファンド（最適化法）・ マザーファンド	外国株式パッジブ・ ファンド・ マザーファンド	エマージング株式 パッジブ・ マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	61,110,253千円	64,090,482千円	22,665,534千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	277,268,776千円	306,109,145千円	51,756,758千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.22	0.20	0.43

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2018年7月30日から2019年1月11日まで）

【9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】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期					
区分	分	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	式	百万円 36,936	百万円 -	% -	百万円 24,173	百万円 5	% 0.0

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 395	百万円 207	百万円 2,947

(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	百万円
株式		28

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期					
区分	分	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	式	百万円 72,877	百万円 5,824	% 8.0	百万円 107,571	百万円 6,862	% 6.4

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ペビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期			
	買付額	売付額	当期末保有額	百万円
債券	百万円 -	百万円 206	百万円 -	百万円 -

【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。

【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
期中の利害関係人との取引等はありません。

【J－REITインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期					
区分	分	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
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投 資 証 券		17,082	514	3.0	21,667	500	2.3

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	当期	買付額	
		百万円	1,121
投 資 証 券			

【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時又は当初運用時における取得

■組入資産の明細

親投資信託残高

	当	期	末
	□	数	評価額
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド		千口 18	千円 44
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド		290	377
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド		13	44
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド		11	19
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド		283	377
エマージング株式パッシブ・マザーファンド		20	22
エマージング債券パッシブ・マザーファンド		13	24
J-REITインデックスファンド・マザーファンド		8	15
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド		12	14

■投資信託財産の構成

2019年1月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	千円 44	% 4.4
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	377	38.1
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	44	4.5
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19	2.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	377	38.1
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	22	2.3
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	24	2.5
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	15	1.6
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	14	1.4
コール・ローン等、その他	49	5.0
投 資 信 託 財 産 総 額	991	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2019年1月11日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは325,110,984千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは184,280,601千円、97.8%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは287,722,384千円、91.9%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは46,339,864千円、99.9%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは94,327,829千円、75.6%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは38,416,984千円、83.5%です。

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

なお、2019年1月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.47円、1カナダ・ドル=81.94円、1オーストラリア・ドル=78.00円、1香港・ドル=13.84円、1シンガポール・ドル=80.27円、1ニュージーランド・ドル=73.60円、1台湾・ドル=3.52円、1イギリス・ポンド=138.22円、1イスラエル・シェケル=29.54円、1イスス・フラン=110.23円、1トルコ・リラ=19.99円、1デンマーク・クローネ=16.72円、1ノルウェー・クローネ=12.79円、1スウェーデン・クローナ=12.19円、1メキシコ・ペソ=5.67円、1フィリピン・ペソ=2.08円、100チリ・ペソ=16.04円、100コロンビア・ペソ=3.46円、1カタール・リアル=29.85円、1インド・ルピー=1.55円、1パキスタン・ルピー=0.78円、100インドネシア・ルピア=0.78円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.58円、1ブラジル・レアル=29.20円、1チェコ・コルナ=4.88円、100韓国・ウォン=9.72円、1オフショア・人民元=15.97円、1マレーシア・リンギット=26.48円、1南アフリカ・ランド=7.83円、1タイ・バーツ=3.40円、1ポーランド・ズロチ=29.05円、100ハンガリー・フォントント=38.84円、1ユーロ=124.84円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年1月11日)現在

項目	当期末
(A) 資産	991,017円
コール・ローン等	49,996
国内株式パッジブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	44,085
国内債券パッジブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	377,500
外国株式パッジブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	44,992
外国債券パッジブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	19,641
為替フルヘッジ外国債券パッジブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	377,952
エマージング株式パッジブ・マザーファンド(評価額)	22,485
エマージング債券パッジブ・マザーファンド(評価額)	24,435
J-REITインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	15,631
外国リート・パッジブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	14,300
(B) 負債	660
未払信託報酬	660
(C) 純資産総額(A-B)	990,357
元本	1,000,000
次期繰越損益金	△9,643
(D) 受益権総口数	1,000,000口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,904円

(注) 設定当初の投資元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。

■損益の状況

当期 自2018年7月30日 至2019年1月11日

項目	当期
(A) 配当等収益	△4円
支 払 利 息	△4
(B) 有価証券売買損益	△8,979
売 買 益	6,083
売 買 損	△15,062
(C) 信託報酬等	△660
(D) 当期損益金(A+B+C)	△9,643
(E) 合計(D)	△9,643
次期繰越損益金(E)	△9,643
分配準備積立金	7,325
繰越損益金	△16,968

(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) 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	7,325円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	7,325
(f) 1万口当たり当期分配対象額	73.25
(g) 分配金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準、市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。

*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）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）、東証REIT指数（配当込み）、S&P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）、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）および東証REIT指数は、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、指標の算出、指標値の公表、利用など同指標に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXおよび東証REIT指標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、責任を負いません。
- (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、同指標の正確性、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・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指標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。
- (注6) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- (注7) S&P先進国REITインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズLLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいづれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REITインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第16期（決算日 2018年2月7日）
(計算期間 2017年2月8日～2018年2月7日)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク)		株式組入率	株式先物比率	純資産額
		期騰落率	中率			
12期（2014年2月7日）	円 16,556	% 25.0	ポイント 1,594.55	% 25.1	% 96.5	% 312,225
13期（2015年2月9日）	20,237	22.2	1,949.47	22.3	99.0	0.9 324,677
14期（2016年2月8日）	19,981	△1.3	1,925.17	△1.2	98.2	1.7 286,897
15期（2017年2月7日）	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3 284,249
16期（2018年2月7日）	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8 289,238

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（株東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指標値の公表、利用など同指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、保証又は販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

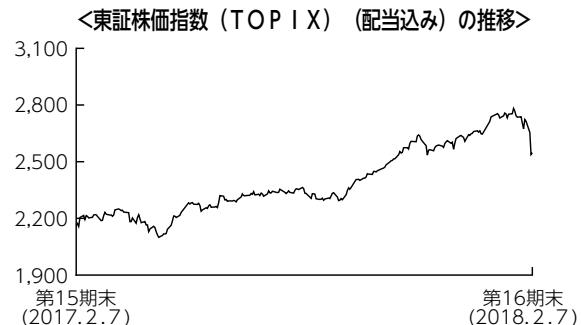
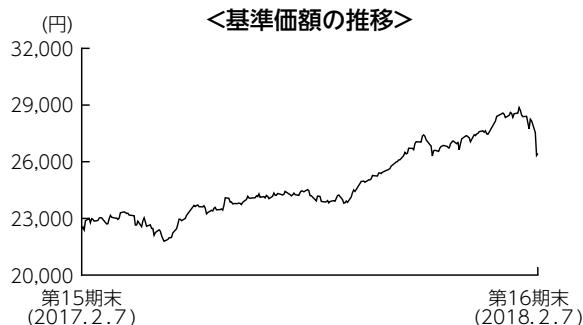
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	東証株価指数(T O P I X)		株式組入比	株式先物比率
		騰 落 率 (配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2017年 2月 7日	円 22,429	% —	ポイント 2,161.36	% —	% 97.6
2 月 末	22,724	1.3	2,189.71	1.3	98.3
3 月 末	22,587	0.7	2,176.87	0.7	97.8
4 月 末	22,878	2.0	2,204.51	2.0	96.1
5 月 末	23,439	4.5	2,257.27	4.4	97.7
6 月 末	24,116	7.5	2,324.06	7.5	97.1
7 月 末	24,218	8.0	2,333.91	8.0	97.5
8 月 末	24,207	7.9	2,332.80	7.9	98.4
9 月 末	25,258	12.6	2,434.16	12.6	97.2
10 月 末	26,636	18.8	2,566.81	18.8	96.9
11 月 末	27,036	20.5	2,604.86	20.5	97.8
12 月 末	27,452	22.4	2,645.77	22.4	97.8
2018年 1 月 末	27,744	23.7	2,673.82	23.7	99.1
(期 末) 2018年 2 月 7 日	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1
					0.8

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、賃建比率－売建比率です。

■当期の運用経過 (2017年2月8日から2018年2月7日まで)



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

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



期末

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

○組入上位10銘柄

期首（前期末）

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.4%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.5
3	日本電信電話	日本・円	1.7
4	ソフトバンクグループ	日本・円	1.7
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.6
6	本田技研工業	日本・円	1.4
7	KDDI	日本・円	1.3
8	みずほフィナンシャルグループ	日本・円	1.2
9	ソニー	日本・円	1.1
10	日本たばこ産業	日本・円	1.0
組入銘柄数		1,968銘柄	



期末

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

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは17.9%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比△0.0%とベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.001 (0.001)
合 計	0	0.002

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(24,829円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2017年2月8日から2018年2月7日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 4,509.2 (△31,741.633)	千円 8,822,924 (-)	千株 25,205.212	千円 45,248,827

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内 株 式 先 物 取 引	百万円 74,538	百万円 80,180	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	54,071,752千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	291,923,007千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.18

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2017年2月8日から2018年2月7日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株式	百万円 8,822	百万円 -	% -	百万円 45,248	百万円 4	% 0.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 64	百万円 401	百万円 3,091

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	当期	
	買付額	額
株式		百万円 443

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期数	期末	銘柄	期首(前期末)	当期数	期末	銘柄	期首(前期末)	当期数	期末
	株	株	千円		株	株	千円		株	株	千円
水産・農林業 (0.1%)				矢作建設工業	千株	千株	千円	昭和産業	千株	千株	千円
極洋	5.7	5	19,400	ピース三菱	19.2	17.3	14,947	昭和産業	58	10.4	28,246
日本水産	182.8	143	77,649	日本カワスホーリングス	14.9	15.1	13,091	鳥越製粉	11.6	10.1	9,211
マルハニチロ	26.7	24.1	80,132	大東建託	28.7	24.3	15,454	中部飼料	15.5	13.9	28,064
カネコ種苗	4.9	4.4	6,960	新日本建設	51.7	46	822,710	フィード・ワン	85.7	76.6	17,541
サカタのタネ	20.8	18.8	67,868	N I P P O	16.8	15.1	14,133	東洋精糖	23	2	2,430
ホクタ	14.4	12.9	25,735	東亜道路工業	33	29.4	69,854	日本甜菜製糖	7.3	6.5	16,666
ホクリヨウ	1.6	1.6	2,272	前田道路	27	2.6	10,517	三井製糖	10	9	36,810
鉱業 (0.3%)				日本道路	44	40	92,040	塩水港精糖	16.3	13.7	3,616
住石ホールディングス	39.8	33.7	5,122	東亜建設工業	42	3.4	19,788	日新製糖	6	5.4	11,340
日鉄鉱業	3.9	3.5	25,830	若築建設	82	6.9	11,454	森永製菓	27.5	26.7	142,845
三井松島産業	8.7	6.5	9,366	東洋建設	40.5	39.9	23,261	中村屋	3.4	2.9	13,630
国際石油開発帝石	740.9	617.8	834,030	五洋建設	156.2	151.1	117,102	江崎グリコ	35.2	31.8	159,954
日本海洋掘削	4.9	4.4	12,311	大林道路	14.6	—	—	名糖産業	6.3	5.5	8,508
石油資源開発	22.2	20.1	55,918	世紀東急工業	20.4	17.2	10,474	井村屋グループ	—	4.5	18,450
K&Oナシザーグループ	9.5	7.5	12,780	福田組	23	4.1	25,338	不二家	81	7.3	17,541
建設業 (3.1%)				田友林業	96.7	81.2	148,352	山崎製パン	103.1	93.1	194,020
ショーボードホールディングス	13.6	12	97,920	日本基礎技術	15.8	14.2	5,310	第一屋製パン	23	2	2,306
ミラト・ホールディングス	43.3	39.1	62,520	日成ビルド工業	42	18.8	24,364	モロゾフ	22	1.9	12,502
タマホーム	10.8	9.6	10,608	ヤマ・エスバイルホーム	74	58	4,698	亀田製菓	7.9	7.1	35,571
サンヨーホームズ	3.2	2.3	1,828	巴コーポレーション	17.6	15.9	8,824	寿スピリッツ	10.1	11	62,040
ファーストコーポレーション	—	4.3	6,308	パナホーム	53	—	—	カルビー	57.4	51.8	181,559
ペスチラ	—	1.8	3,438	大和ハウス工業	415.4	375.3	1,504,202	森永乳業	126	22.8	106,590
インベスタークラウド	1.3	11.2	17,651	ライト工業	27.1	24.5	27,636	六甲パター	6.3	5.7	15,070
ダセキ環境リユーション	3.3	3	3,591	積水ハウス	442.4	413.3	779,897	ヤクルト本社	75.5	68.1	563,187
第一カッターエンタ	—	1.3	2,246	日特建設	12.2	10.9	6,997	明治ホールディングス	83.3	75.3	646,074
安藤・間	101.1	97.8	81,858	北陸電気工事	6.9	7.1	7,802	雪印メグミルク	30.4	27.4	78,994
東急建設	49.9	48.9	53,349	ユアテック	22	20	17,180	プリマハム	89	80	51,680
コムスホールディングス	55	44.7	124,310	西部電気工業	2.4	2.1	5,882	日本ハム	95	98	240,394
ミサワホーム	16.6	10.6	9,169	四電工	6	1.9	5,234	林兼産業	4.7	4.1	3,390
ビーアールホールディングス	13.2	12.6	5,657	中電工	17.7	16.4	49,134	丸大食品	68	61	29,280
高能コストラシングループ	10.6	8.2	24,928	関電工	56	50.6	59,050	S Foods	7.6	8	35,560
東建コーポレーション	5.2	4.7	54,426	きんでん	93.6	84.5	145,762	伊藤ハム久ホールディングス	81.3	73.3	66,922
ソネック	—	1.6	1,227	東京エニシス	15	14.4	16,012	サップロホールディングス	46.1	41.6	129,376
ヤマウラ	6.9	6	5,412	トーエニック	20	3.6	11,052	アサヒグループホールディングス	263.9	238.4	1,263,520
大成建設	715	126.5	642,620	住友電設	9.7	10.1	22,533	キリンホールディングス	605.7	547	1,402,234
大林組	421.8	381	465,201	日本電設工業	22.9	19.5	42,822	宝くじホールディングス	102	85.2	106,670
清水建設	430	388.6	399,092	協和エクシオ	55.1	45.6	121,178	オエノホールディングス	37	32.5	13,162
飛島建設	135.5	115.9	19,934	新日本空調	10.9	9.8	14,298	養命酒製造	4.5	3.5	8,295
長谷工コーポレーション	164.1	148.3	239,356	N D S	2.2	2	8,470	コ・コ・ホーリングループ	47.7	79.9	294,431
松井建設	15.5	14	11,816	九電工	27.3	25.1	120,480	コカ・コーラ	54.8	—	—
錢高組	20	1.8	10,422	三機工業	31.2	26.9	30,908	ライ・グループ	96.4	87	435,000
鹿島建設	618	558	550,188	日揮	131.2	109.4	236,741	サントリーグループ	6.5	5.8	37,352
不動テトラ	113.8	96.5	16,694	中外炉工業	43	3.9	8,763	ダイドーグループ	41.8	37.7	167,765
大末建設	5.1	4.1	4,227	ヤマト	12.9	10.5	9,019	伊藤園	54.8	11.2	23,587
鉄建建設	85	7.7	23,485	太平電業	19	8.6	23,030	キーニーヒー	12.5	11.2	23,587
西松建設	162	29.3	82,655	高砂熱学工業	38.7	35	67,795	ユニカフエ	4.2	3.5	3,944
三井住友建設	538.3	91.6	54,135	三晃金属工業	1.3	1.4	5,691	ジャパンフーズ	2.1	1.6	2,368
大豊建設	51	46	24,702	朝日工業社	3.2	2.6	7,930	日清オイオリグループ	81	13.4	41,540
前田建設工業	87	90.6	126,296	明星工業	25.6	23	17,411	不二製油グループ本社	37.6	30.8	93,478
佐田建設	9.8	8.4	3,805	大氣社	18.6	16.8	60,564	J一オイルミルズ	6.6	5.9	22,036
ナカノフード一建設	10.8	9.7	5,839	ダイダン	19	8.5	20,629	キッコーマン	98	88.9	373,824
奥村組	115	20.9	93,841	日比谷総合設備	15.7	14.2	28,073	味の素	289.8	261.7	514,633
東鉄工業	16.9	15.3	48,654	東芝プラントシステム	22.8	27.5	58,602	キユーピー	71.6	63.4	188,044
イチケン	13	2.3	5,177	O S J B ホールディングス	43.3	56.3	16,946	ハウス食品グループ本社	52.1	43.4	152,117
浅沼組	45	45	16,740	東洋エンジニアリング	83	15	18,345	カゴメ	50.6	45.6	165,300
戸田建設	163	148	116,624	時代化工建設	101	82.5	78,705	焼津水産化學工業	7	5.5	6,561
熊谷組	221	19.9	57,371	新興プランティック	28.8	24.5	24,328	アリケージャパン	11.5	10.4	90,168
青木あすなろ建設	9.2	8.3	8,125	日本製粉	41.9	37.7	59,113	ピエトロ	1.7	1.5	2,496
北野建設	29	27	11,637	日清製粉グループ本社	154.3	139.3	289,465	エバラ食品工業	3.6	2.5	5,270
植木組	18	1.6	4,283	日東富士製粉	0.8	0.8	3,756	ニチレイ	69.3	54.2	139,673
三井ホーム	18	16	10,432					イートアンド	1.7	3.2	6,768

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)					
	株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円		
大冷	千株	千株	千円		千株	千株	千円		巴川製紙所	21	18	5,292		大倉工業	千株	千株	千円		千株	千株	千円			
ショムラ・ホールディングス	—	1.3	2,804		—	1.7	2,935		大王製紙	52.5	47.3	68,159		積水化成工業	32	28	16,436		—	32	28	16,436		
日清食品ホールディングス	55	49.6	375,472		5	12	17,136		ア波製紙	—	2.9	1,908		群栄化学工業	18.2	14.9	16,702		—	18.2	14.9	16,702		
永谷園ホールディングス	7	5	4.4	5,174	7	12	17,136		レンゴー	127	114.5	103,393		タイガースポリマー	3.1	2.8	9,940		—	3.1	2.8	9,940		
一正蒲鉾	5	4.4	5,174		5	4.4	5,174		トーモク	42	6.8	14,552		ミライアル	6.5	5.9	4,696		—	5	3.9	7,441		
フジッコ	13.7	12.3	28,253		14.7	12.3	25,264		ザ・パック	9.3	8.4	29,274		ダイキアクシス	2.2	4	5,628		—	2.2	4	5,628		
ロック・フィールド	14.7	12.3	25,264		日本たばこ産業	779.5	704.1	2,324,234		化学(7.1%)	221.2	199.9	376,611		ダイキヨーニシカワ	23.1	23.4	38,469		—	1.3	3,013		
ケンコーマヨネーズ	5	7.5	28,800		ケンコーマヨネーズ	5	7.5	19,762		クラレ	820	740.7	985,871		竹本容器	—	—	—		森六ホールディングス	4.5	4.5	13,212	
わらべや日洋ホールディングス	8.3	7.5	19,762		わらべや日洋ホールディングス	8.3	7.5	19,762		旭化成	7.7	6.9	6,610		日本化粧	85	77.1	108,402		—	11	11	12,122	
などり	7.2	6.4	12,550		などり	7.2	6.4	12,550		共和レザー	87.5	79.1	367,024		カーリットホールディングス	12.3	11	12,122		昭和電工	11	9.9	11,394	
イフジ産業	—	2	1,524		イフジ産業	—	2	1,524		住友化学	968	874	609,178		日本精化	9.4	8.4	24,166		住友精化	9.4	8.4	24,166	
ピッカルスコ-ボレーション	—	1.7	2,966		ピッカルスコ-ボレーション	—	1.7	2,966		日産化学工業	72	69.1	279,509		A D E K A	56.5	51.1	95,454		ラサ工業	51	4.2	9,727	
北の達コ-ボレーション	3.1	10.9	28,034		北の達コ-ボレーション	45.3	43.9	45,260		クリエ	9.9	10.3	72,615		油日	106	45.9	130,815		多木化学	8	1.6	8,512	
ユープレナ	45.3	43.9	45,260		ユープレナ	45.3	43.9	45,260		ティカ	20	9.1	26,299		新日本理化	21.6	18.9	4,725		花王	11.3	9.2	8,031	
ミヨシ油脂	50	4.4	6,142		ミヨシ油脂	4.2	4.3	17,565		石原産業	23.6	21.3	39,724		第一工業製薬	333.9	278.8	2,142,020		石原産業	23.6	21.3	39,724	
織研ビタミン	4.2	4.3	17,565		織研ビタミン	4.2	4.3	17,565		片倉産業	17	2.9	3,833		日華化学	29	23	19,136		片倉産業	17	2.9	3,833	
織維製品(0.7%)	—	—	—		片倉産業	16.5	13.7	18,440		片倉コーポアグリ	7.7	6.9	5,409		ニイタカ	—	1.7	2,874		東洋紡	521	43.9	87,009	
片倉工業	16.5	13.7	18,440		片倉産業	98	8.9	53,400		日本曹達	79	82	51,988		三洋化成工業	8.2	8.2	4,202		日本曹達	98	8.9	53,400	
グンゼ	98	8.9	53,400		グンゼ	98	8.9	53,400		東ソーラ	380	171.7	389,930		有機合成薬品工業	9.4	8	40,425		東ソーラ	380	171.7	389,930	
東洋紡	521	43.9	87,009		東洋紡	521	43.9	87,009		トクヤマ	205	34.5	103,845		日本塗料	75	13.6	21,828		トクヤマ	205	34.5	103,845	
ユニチカ	361	34.6	25,154		ユニチカ	361	34.6	25,154		セントラル硝子	134	24.2	56,991		日本ペイントホールディングス	101.5	91.7	331,954		セントラル硝子	134	24.2	56,991	
富士筋ホールディングス	6.4	6.6	27,522		富士筋ホールディングス	6.4	6.6	27,522		東亜合成	82.2	69.7	90,958		関西ペイント	138.1	124.8	315,993		東亜合成	82.2	69.7	90,958	
倉敷紡績	132	120	40,200		倉敷紡績	132	120	40,200		大阪ソーダ	57	10.7	28,911		神東塗料	10	9	2,295		大阪ソーダ	57	10.7	28,911	
シキボウ	72	6	7,710		シキボウ	72	6	7,710		関東電化工業	27	28.4	33,568		中国塗料	37.7	34.1	31,167		関東電化工業	27	28.4	33,568	
日本毛織	37	33.4	37,374		日本毛織	37	33.4	37,374		デンカ	272	43.6	174,182		日本特殊塗料	9.2	7.5	15,315		デンカ	272	43.6	174,182	
ダイトイワボウ	20	18.8	1,992		ダイトイワボウ	20	18.8	1,992		信越化学工業	235.8	197.8	2,282,612		藤倉化成	17.9	15	9,990		信越化学工業	235.8	197.8	2,282,612	
トーワ筋コ-ボレーション	5.5	5.1	2,942		トーワ筋コ-ボレーション	5.5	5.1	2,942		日本カーバイド工業	45	3.8	7,125		太陽ホールディングス	10.7	9.1	45,090		日本カーバイド工業	45	3.8	7,125	
ダイドーリミテッド	15	13.5	6,115		ダイドーリミテッド	15	13.5	6,115		堺化学工業	49	8.1	22,177		D I C	51.9	46.9	185,958		堺化学工業	49	8.1	22,177	
帝国織維	13.8	12.4	26,015		帝国織維	13.8	12.4	26,015		エア・ウォーター	108.4	97.9	209,310		サカタインクス	26.8	24.2	43,342		エア・ウォーター	108.4	97.9	209,310	
帝人	107.4	97	214,758		帝人	107.4	97	214,758		大陽日酸	101.3	91.5	143,014		東洋イキシホールディングス	130	117	73,125		大陽日酸	101.3	91.5	143,014	
東レ	954	861.5	869,253		東レ	954	861.5	869,253		日本化学工業	49	4.4	10,480		T & K T O K A	9.5	7.9	11,060		日本化学工業	49	4.4	10,480	
サカイオーベックス	3.3	3.1	7,393		サカイオーベックス	3.3	3.1	7,393		東邦アセチレン	—	1.7	2,555		富士フイルムホールディングス	260.7	235.5	1,070,818		東邦アセチレン	—	1.7	2,555	
住江織物	33	3	8,805		住江織物	33	3	8,805		日本バカライング	67.1	60.7	117,818		資生堂	249.5	211.2	1,159,065		日本バカライング	67.1	60.7	117,818	
日本フルート	7.9	6.4	3,315		日本フルート	7.9	6.4	3,315		高圧ガス工業	19.5	17.6	15,171		ライオン	163	158	314,894		高圧ガス工業	19.5	17.6	15,171	
イチカワ	9	8	2,960		イチカワ	9	8	2,960		チタン工業	16	1.3	3,650		高砂香料工業	8.6	7.1	22,684		チタン工業	16	1.3	3,650	
イ東製綱	1.5	1.3	2,281		イ東製綱	1.5	1.3	2,281		四国化成工業	19	17.1	27,342		マンダム	13.2	22.1	82,101		四国化成工業	19	17.1	27,342	
アツギ	108	7.9	9,511		アツギ	108	7.9	9,511		戸田工業	26	2.4	9,744		ミルボン	7.1	15.2	52,592		戸田工業	26	2.4	9,744	
ダイニック	26	4.6	4,857		セーレン	32.8	27.3	55,992		ステラ ケミファ	6.2	6.1	20,496		ファンケル	28	27.5	90,750		セーレン	32.8	27.3	55,992	
セーレン	32.8	27.3	55,992		ソートー	5	4.4	4,857		保土谷化学工業	4.6	3.9	19,402		コーセー	21.3	19.2	364,416		保土谷化学工業	4.6	3.9	19,402	
小松精練	19	1.7	2,609		小松精練	18.6	18.2	15,979		日本触媒	20.7	18.7	136,323		コタ	5	4.9	9,187		日本触媒	20.7	18.7	136,323	
ワコールホールディングス	78	32.8	103,156		ワコールホールディングス	78	32.8	103,156		大日精化工業	54	9.2	43,194		シーズ・ホールディングス	17.1	15.4	85,008		大日精化工業	54	9.2	43,194	
ホギメディカル	8.3	7.5	59,775		ホギメディカル	8.3	7.5	59,775		カネカ	177	160	149,440		シー・ボン	1.6	1.4	4,655		カネカ	177	160	149,440	
レナウン	35.7	32.3	5,555		レナウン	35.7	32.3	5,555		三菱瓦斯化学	122.5	97.9	270,693		ボラ・オルスホールディングス	13.4	48.4	200,134		三菱瓦斯化学	122.5	97.9	270,693	
クラウディアホールディングス	3.4	2.9	1,618		クラウディアホールディングス	3.4	2.9	1,618		日興オカケム	16.1	18.2	54,418		ノエビアホールディングス	8.3	7.2	56,592		日興オカケム	16.1	18.2	54,418	
T S I ホールディングス	54.1	44.8	33,600		T S I ホールディングス	54.1	44.8	33,600		ダイセル	177.3	160.2	195,764		アジュバンコスメジャパン	2.8	2.6	2,698		ダイセル	177.3	160.2	195,764	
マツオカ-ボレーション	—	2.1	9,198		マツオカ-ボレーション	—	2.1	9,198		J S R	132.1	119.4	286,321		エステー	9.1	8.1	17,998		J S R	132.1	119.4	286,321	
三陽商会	69	6.2	12,623		三陽商会	69	6.2	12,623		東京応化工業	24.6	20.6	94,451		アグロ カネショウ	5.2	4.6	9,853		東京応化工業	24.6	20.6	94,451	
ナイガイ	49	4.4	2,371		ナイガイ	49	4.4	2,371		大阪有機化学工業	8.7	7.7	11,958		コニシ	20.6	18.6	34,447		大阪有機化学工業	8.7	7.7	11,958	
オワードホールディングス	85	70.9	66,433		オワードホールディングス	85	70.9	66,433		三菱ケミカルホールディングス	885.6	795.4	865,395		長谷川香料	16.6	15	33,000		三菱ケミカルホールディングス	885.6	795.4	865,395	
ルックホールディングス	24	20	7,060		ルックホールディングス	24	20	7,060		K H ネオカケム	16.1	18.2	54,418		星光P M C	7.2	6.5	7,163		K H ネオカケム	16.1	18.2	54,418	
キムラタン	566	55.5	2,497		キムラタン	566	55.5	2,497		ダイセル	177.3	160.2	195,764		小林製薬	36.5	31.8	218,784		ダイセル	177.3	160.2	195,764	
ゴールドウイン	5.6	3.4	42,636		ゴールドウイン	5.6	3.4	42,636		積水化学工業	298.4	246.7	478,104		荒川化学工業	11.3	10.2	19,859		積水化学工業	298.4	246.7	478,104	
デサンクト	30	27.1	43,739		デサンクト	30	27.1	43,739		日本ゼオン	111	100.2	155,811		メリック	10.2	7.8	15,927		日本ゼオン	111	100.2	155,811	
キング	6.6	5.8	3,851		キング	6.6	5.8	3,851		宇部興産	662	59.8	201,526		コニシ	20.6	18.6	34,447		宇部興産	662	59.8	201,526	
ヤマインターナショナル	8.3	8.1	3,750		ヤマインターナショナル	8.3	8.1	3,750		横水樹脂	20.3	18.3	43,901		タカラバイオ	28.2	29.7	51,381		横水樹脂	20.3	18.3	43,901	
バルブ・紙(0.3%)	7.7	6.5	26,747		特種東海製紙	7.7	6.5	26,747		旭有機材	42	7	14,189		J C U									

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)				
	株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円	
北興化学工業	千株	千株	千円		千株	千株	千円		ビービー・カストロール	千株	千株	千円		丸一鋼管	千株	千株	千円		丸一鋼管	千株	千株	千円	
大成ミック	13	11.7	8,026		富士石油	5.4	4.9	8,918	M O R E S C O	30.6	27.6	13,744		モリ工業	3.8	4.2	13,986		モリ工業	43.9	39.7	129,025	
クミアイ化学工業	3.8	3.5	10,902		出光興産	4.5	4.1	8,040	J X T G ホールディングス	1,458.2	1,809.7	1,243,082		大同特殊鋼	220	19.9	117,410		大同特殊鋼	46	4.2	3,427	
日本農業	27.2	51.6	33,694		コモエルギーホールディングス	62.4	95.2	371,756		日本高周波鋼業	46	4.2	117,410		日本冶金工業	108.8	92.8	30,438		日本冶金工業	220	19.9	117,410
アキレス	30	29.6	17,760			39.7	32.8	134,152		山陽特殊製鋼	78	12.9	32,379		愛知製鋼	7.7	6.3	29,799		愛知製鋼	7.7	6.3	29,799
有沢製作所	10.7	8.6	19,135							日立金属	133.7	120.8	172,985		日立金属	133.7	120.8	172,985		日立金属	43.9	39.7	129,025
日東電工	22	19	19,627							日本金属	3.2	2.8	8,150		日本金属	3.2	2.8	8,150		日本金属	3.2	2.8	8,150
レック	94.8	85.6	740,012							大平洋金属	84	6.9	23,770		大平洋金属	84	6.9	23,770		大平洋金属	84	6.9	23,770
さもと	4.1	6.7	20,368							新日本電工	74.4	67.2	31,785		新日本電工	74.4	67.2	31,785		新日本電工	74.4	67.2	31,785
藤森工業	23.4	19.4	7,740							栗木鐵工所	6.3	5.7	12,659		栗木鐵工所	6.3	5.7	12,659		栗木鐵工所	6.3	5.7	12,659
前澤化成工業	9.8	9.5	35,910							虹 技	19	1.7	3,486		虹 技	19	1.7	3,486		虹 技	19	1.7	3,486
J S P	8.7	7.8	9,126							日本鋸鉄管	14	12	2,016		日本鋸鉄管	14	12	2,016		日本鋸鉄管	14	12	2,016
エフピコ	6.1	6.6	20,757							三菱製鋼	91	8.3	22,011		三菱製鋼	91	8.3	22,011		三菱製鋼	91	8.3	22,011
天馬	11.7	9.3	55,521							日亜鋼業	18.4	16.5	5,758		日亜鋼業	18.4	16.5	5,758		日亜鋼業	18.4	16.5	5,758
信越ボリマー	8.7	8.8	19,395							日本精線	9	1.8	8,514		日本精線	9	1.8	8,514		日本精線	9	1.8	8,514
東リ	25.8	23.3	29,078							シンニッタン	10.8	8.7	7,099		シンニッタン	10.8	8.7	7,099		シンニッタン	10.8	8.7	7,099
二フコ	31.5	28.2	10,659							新家工業	29	2.6	6,505		新家工業	29	2.6	6,505		新家工業	29	2.6	6,505
日本バルカーカ工業	23	20.8	156,000																				
ユニ・チャーム	10.1	9.2	28,382																				
医薬品(4.5%)	266.2	240.4	690,789																				
協和発酵キリン	157.3	142.1	286,757																				
武田薬品工業	492.9	417.7	2,517,895																				
アステラス製薬	1,343.1	1,165.4	1,707,311																				
大日本住友製薬	93.1	84.1	126,402																				
塙野義製薬	177.9	162.2	910,590																				
田辺三菱製薬	153.2	138.4	306,832																				
わかもと製薬	7	14	3,794																				
あすか製薬	14.3	12.9	26,393																				
日本新薬	30.1	29.7	198,693																				
ビオフェルミン製薬	2.2	1.9	5,359																				
中外製薬	130.9	118.2	621,732																				
科研製薬	24.5	20.5	114,595																				
エーザイ	161.8	135.7	827,091																				
ロート製薬	64.4	62.3	172,820																				
小野薬品工業	298.6	267.8	755,731																				
久光製薬	37.1	33.5	246,560																				
持田製薬	9	7.9	62,568																				
参天製薬	237.3	214.7	361,984																				
扶桑製品工業	4.5	4	10,876																				
日本ケミファ	1.8	1.5	6,840																				
ツムラ	44.1	40.5	144,585																				
日医工	30.7	29.9	50,321																				
キッセイ薬品工業	23.3	21	60,270																				
生化学工業	24.4	22	36,652																				
荣研化学	11	9.2	44,528																				
日水製薬	5.3	4.8	6,648																				
鳥居薬品	9	7.1	19,035																				
J C R ファーマ	10.1	8	41,200																				
東和製品	6	5.4	34,236																				
富士製薬工業	4.3	3.9	14,878																				
沢井製薬	22.3	22.8	108,300																				
ゼリア新薬工業	26.9	24.3	52,026																				
第一三共	386.9	324.5	1,308,384																				
キヨーリン製薬ホールディングス	32.1	31.7	66,379																				
大幸製品	6.6	6	13,926																				
ダイト	7.4	6.6	23,892																				
大塚ホールディングス	282.7	235.7	1,083,041																				
大正製薬ホールディングス	28.1	25.4	237,744																				
ペプチドリーム	24.6	50.8	215,392																				
石油・石炭製品(0.7%)	107	96.1	10,667																				
日本コクス工業	117.5	106.1	159,680																				
昭和シェル石油	16.1	14.5	19,517																				
ニチレイ	214	—	—																				
東燃ゼネラル石油	7.1	6.4	10,432																				
ユシロ化学工業																							

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末
株	数	株	数	評価額	株	数	株	評価額	株	数	評価額
ノーリツ	千株 25.7	千株 25	千円 51,300	ユニオントール	千株 5.7	千株 5.1	千円 19,941	蛇の目ミシン工業	千株 12.2	千株 10.3	千円 7,889
長府製作所	14	12.6	30,996	オイレス工業	16.9	14.5	31,146	マックス	19	17.4	25,438
リンクナイ	22.4	20	196,600	日精エース・エス・ビー機械	4.2	3.8	24,624	グローリー	40.1	33.8	138,918
ダイニチ工業	7	6	5,094	サトー・ホールディングス	16.3	14.8	50,320	新晃工業	8.8	11.5	22,310
日東精工	19	15.5	9,145	技研製作所	—	5.7	15,897	大和冷機工業	20.1	18.2	24,169
三洋工業	17	1.4	2,881	日本エアーテック	4.4	3.9	3,646	セガミ・ホールディングス	124.5	112.5	166,387
岡部	27.3	22.7	24,220	日精樹脂工業	10.4	9.4	14,946	日本ピストンリング	4.9	4.1	8,938
ジーテクト	13.7	12.4	25,866	オカダアイヨン	2.8	3.3	6,250	リケン	5.8	5.2	31,148
中国工業	2.3	1.7	1,361	ワエイシ・ホールディングス	5	3.8	3,784	T P R	14.1	12.7	41,783
東プレ	25.3	20.9	65,521	小松製作所	606.1	547.5	2,221,207	ツバキ・ナカシマ	14.1	11.4	33,231
高周波熱鍊	24.4	21.6	23,133	住友重機械工業	383	64.9	293,348	ホシザキ	27.5	35.7	352,716
東京製綱	8.9	8.1	14,369	日立建機	58.7	53	235,850	大豊工業	10.2	9.2	14,241
サンコール	7.1	6.3	4,762	日工	4	3.1	7,402	日本精工	257.8	232.9	382,654
モリテックスチール	7.2	6.6	6,256	巴工業	5.4	4.8	9,321	N T N	290	262.4	129,100
パイオラックス	6.6	16.6	50,381	井関農機	134	11.3	28,589	ジエイテクト	133.7	120.8	210,192
エイチワ	—	8.3	11,578	T O W A	10.8	8.8	17,670	不二越	126	105	72,450
日本発条	123.5	111.7	120,300	丸山製作所	28	2.5	4,820	日本トムソン	40.1	36.3	27,914
中央発條	15	1.3	4,699	北川鉄工所	6	5.4	15,379	T H K	88.7	70.7	295,879
アドバンテクス	2.3	1.8	7,110	ローチュ	4.7	5.6	13,440	ユーシン精機	5.6	5	18,075
立川ブライド工業	5.5	5	6,640	タカキタ	3.6	3.6	3,024	前澤給装工業	4.8	4.4	7,946
三益半導体工業	9.7	8.7	17,478	クボタ	628.7	608.2	1,248,026	イーグル工業	13.6	14	27,734
機械(5.7%)	在原実業	3.7	3.3	6,217	前澤工業	9.3	7.8	3,151			
日本ドライケミカル	1.7	1.5	3,750	三菱化工業	43	3.9	8,712	日本ピラー工業	12.7	11.5	21,562
日本製鋼所	43.4	36.6	115,290	月島機械	24.9	22.5	28,620	キッソ	60.1	50.5	43,480
三浦工業	53.7	48.5	142,541	帝國電機製作所	9.6	7.9	10,751	日立工機	33.6	—	—
タフマ	42.1	38	51,832	東京機械製作所	50	4.5	2,484	マキタ	81.8	147.9	740,979
ツガミ	35	30	46,620	新東工業	29.7	26.9	34,324	日立造船	99.3	89.9	49,714
オーフマ	85	13.1	88,818	澁谷工業	11	9.9	41,283	三菱重工業	2,103	190	790,210
東芝機械	78	63	50,652	アイチコ・ポレーション	18.6	19.6	13,739	I H I	965	87.1	310,511
アマダ・ホールディングス	176.7	173	257,943	小森コ・ポレーション	31.5	28.5	39,900	スター精密	22	18.2	38,311
アイダエンジニアリング	37.3	28.5	41,154	鶴見製作所	9.8	9.5	17,774	電気機器(13.9%)	69.6	69.3	99,722
海運鉄工所	39	3.5	7,567	住友精密工業	21	19	7,448	日清紡・ホールディングス	87.8	69.4	115,620
富士機械製造	40	33.6	70,660	酒井重工業	25	2.1	9,334	コニカミノルタ	293.8	265.4	259,561
牧野フライス製作所	65	56	62,608	在原製作所	59.5	46.6	187,798	プラザー工業	162.3	138.5	356,083
オースズ	59.8	51.7	127,647	石井鐵工所	2	1.8	3,443	ミネベアミツミ	228.345	210.5	482,045
ダイジェット工業	17	1.4	2,940	西島製作所	12.9	11.6	12,029	日立製作所	3,014	2,723	2,212,437
旭ダイヤモンド工業	37.6	33.3	39,393	北越工業	14.1	12.8	15,232	東芝	2,808	—	—
DMG森精機	77.7	62.1	137,489	ダイキン工業	171.4	154.8	1,891,656	三菱電機	1,338.9	1,133.9	2,114,723
ソディック	33.3	24.4	33,574	オルガノ	25	4.1	13,817	富士電機	378	342	275,310
ディスコ	15.4	15.2	352,184	トヨコ・カネツ	60	4.8	19,032	東洋電機製造	5	4.5	7,515
日東工具	7.6	6.9	19,830	栗田工業	74.3	61.4	199,233	安川電機	145.5	131.4	662,256
日進工具	—	3	10,440	椿本チエイン	75	67	57,553	シフニカ・テクノロジー	81	73	26,791
パンチ工業	4.8	9.4	11,862	大同工業	26	4.3	6,561	明電舎	115	96	38,496
富士ダイス	—	4.3	4,669	木村加工機	11.5	9.6	4,780	オリジン電気	18	3.3	5,326
豊和工業	7.6	6.2	9,182	アネスト岩田	22.8	19.1	22,385	山洋電気	33	5.5	43,285
O K K	48	4.3	5,074	ダイフク	62.7	57.7	383,705	デンヨー	11.6	10.5	17,619
石川製作所	3.5	2.9	8,308	サムコ	3.3	3.1	3,785	東芝テック	79	81	50,787
東洋機械金属	8.9	8.8	8,448	加藤製作所	6.9	5.4	17,172	芝浦メカトロニクス	21	17	7,072
津田駒工業	30	27	7,074	油研工業	24	2.2	6,067	マブチモーター	35.4	31.6	185,492
エンジンユウ	34	29	5,452	タダノ	65.6	54.7	95,068	日本電産	162.7	136.5	2,213,347
島精機製作所	17.1	14.2	94,004	フジテック	36.5	36.3	51,037	ヨ・イ・エ・シ・エレクトロニクス	1.5	4.1	11,861
オプトラン	—	8.2	28,208	C K D	37.6	31.5	79,821	東光高岳	6.4	5.7	9,131
NCホールディングス	4.4	3.6	2,757	キトー	15.8	8.6	14,069	ダブル・スコープ	12.1	16.5	31,515
フリュー	2.6	8	8,408	平和	38.9	35.1	73,253	宮越ホールディングス	4.5	4.3	2,752
ヤマシングフィルタ	2.6	15.3	18,145	理想科学工業	12.5	11.2	21,761	ダイヘン	69	62	51,832
日阪製作所	17.8	16.1	17,291	S A N K Y O	34.8	28.4	98,548	田端電機	19.1	15.8	4,518
やまびこ	24.1	21.7	35,588	日本金銭機械	11.6	10.5	11,361	ヤーマン	1.6	16.4	26,453
平田機工	—	3.1	32,643	マースエジニアリング	7.1	7.2	17,006	J V C ケンウッド	92.2	83.3	29,654
ベガサミシン製造	12.7	10.5	7,402	福島工業	7.8	7	31,990	ミマキエジニアリング	11.3	10.2	10,302
ナブテスコ	68.3	61.7	290,915	オーエイズミ	5.5	4.8	2,424	第一精工	5.9	5.3	14,490
三井海洋開発	13.2	11.9	33,891	ダイコク電機	5.2	5.2	8,840	日新電機	25.2	26.6	28,595
レオン自動機	11.1	10	20,280	竹内製作所	22.9	19	49,096	大崎電気工業	25	24.3	20,047
SMC	39.4	35.6	1,767,540	アマノ	38.9	35.1	97,297	オムロン	133.4	120.5	774,815
新川	11	9.2	12,006	J U K I	19.8	16.8	29,080	日東工業	18.4	18.2	33,142
ホソカワミクロン	22	4.2	30,282	サンデンホールディングス	77	13.8	30,912				

銘柄	期首(前期末)			当期			期末			銘柄	期首(前期末)			当期			期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
I D E C	千株 16.4	千株 14	千円 39,326	日本光電工業	千株 52.5	千株 47.4	千円 137,744	ユニプレス	千株 24.2	千株 21.9	千円 58,254								
不二電機工業	1.4	1.3	1,716	チノー	4.6	3.9	5,951	豊田自動織機	114.3	91.8	636,174								
ジエス・ユサ コーポレーション	242	204	116,484	共和電業	14.4	13	5,395	モリタホールディングス	22	18.2	36,072								
サクサホールディングス	32	2.9	5,576	日本電子材料	5.1	4.5	2,556	三櫻工業	16.1	14.4	11,419								
メルコホールディングス	7	5.5	19,525	堀場製作所	24.9	22.5	152,325	デンソー	309.5	251.6	1,625,587								
テクノ・メディア	2.9	2.7	5,130	アドバンテスト	85.6	63.2	134,173	東海理化電機製作所	33	29.8	67,258								
日本電気	1,725	146.7	465,772	小野測器	6.3	4.8	3,792	三井造船	453	41	74,538								
富士通	1,210	1,166	751,603	エスペック	11.1	10.1	25,977	川崎重工業	977	88.2	366,030								
沖電気工業	54.3	46	67,206	パナソニック パイオ SUNX	11.1	—	—	名村造船所	37.6	34	21,284								
岩崎通信機	56	5	4,035	ギーエンス	56.9	55.7	3,569,256	サノヤスホールディングス	15.3	13.8	3,436								
電気興業	36	6.4	17,664	日置電機	6.6	5.9	19,912	日本車輪製造	46	41	12,054								
サンケン電気	73	66	55,968	シスマックス	97.5	88.2	741,762	三菱ロジスネクスト	14.5	13.5	12,339								
ナカヨ	13	2.2	4,617	日本マイクロニクス	23.4	19.7	22,753	近畿車輛	1.9	1.7	4,839								
アイホン	7.2	6.4	11,078	メガチップス	11.7	8.9	31,417	日産自動車	1,480.3	1,337.3	1,540,569								
ルネサスエレクトロニクス	65.1	58.7	70,322	OBARA GROUP	7.3	6.6	45,144	いすゞ自動車	363.7	328.6	579,650								
セイコーエプソン	186.9	168.8	368,996	澤藤電機	8	1.2	2,505	トヨタ自動車	1,526	1,378.5	10,162,302								
ワコム	97.5	88	47,080	コーセル	17.4	15.7	25,732	日野自動車	179.1	161.8	237,684								
アルパック	21.2	26.1	168,345	イリソ電子工業	4	9.5	63,935	三菱自動車工業	460.1	419.7	351,708								
アクセル	5.3	4.7	3,774	新日本無線	9.9	6.9	5,789	エフティック	6.7	7.3	10,782								
E I Z O	12.4	10.4	51,896	オプテックスグループ	9.5	9.2	59,524	レシップホールディングス	4.3	4.1	3,636								
ジャパンディスプレイ	234.5	233	50,561	千代田インテグレ	6.6	5.5	12,809	GMB	2.1	1.9	3,387								
日本信号	34.6	31.3	33,647	アイ・オー・データ機器	4	4.7	4,822	ファルテック	2.3	2	2,860								
京三製作所	29	27	18,144	レザーテック	13.8	23.2	87,928	武藏精密工業	14.6	12.1	41,200								
能美防災	14.2	15	33,105	スタンレー電気	89.5	86.7	356,770	日産車体	55.1	44.3	49,305								
ホーチキ	9.1	8.2	17,179	岩崎電気	46	4.4	7,084	新明和工業	51	49.3	44,222								
エレコム	10.9	9.8	22,559	ウシオ電機	76.2	68.8	102,305	極東開発工業	25	21.1	36,207								
日本無線	7.7	—	—	岡谷電機産業	7	6.1	3,916	日信工業	28	23	45,287								
パナソニック	1,434	1,295.4	2,071,992	ハリオ テクノホールディング	11.8	9.7	9,379	トピー工業	10.3	9.3	31,899								
シャープ	—	79	286,770	日本セラミック	10.3	11.5	32,740	ティラード	49	4.1	16,564								
アンリツ	91.4	82.7	102,878	遠藤照明	6.4	5.8	6,345	曙ブレーキ工業	58.5	52.7	16,389								
富士通ゼネラル	43	34.6	71,933	古河電池	9	8.1	8,448	タチエス	21.3	19.2	35,712								
日立国際電気	32.9	—	—	双信電機	6.5	5	3,285	NOK	60.7	60.9	141,470								
ソニー	886.2	757.5	4,103,377	山一電機	11.8	8.2	15,243	フタバ産業	38.3	34.7	34,908								
TDK	70.7	59.3	549,118	図研	8.2	7.4	13,127	K Y B	140	11.8	69,384								
帝国通信工業	27	5	6,590	日本電子	46	41	25,625	大同メタル工業	15.8	14.3	15,529								
タムラ製作所	48	43.7	34,566	カシオ計算機	101	91.2	135,705	プレス工業	66.6	60.2	39,972								
アルプス電気	115.9	97.7	277,858	フナック	127.3	107.8	2,926,770	ミクニ	16	14.4	10,080								
池上通信機	40	36	5,796	日本シエムケイ	27.1	20	19,440	カルソニックカンセイ	85	—	—								
パイオニア	188.7	189	41,580	エンプラス	5.7	5.1	19,099	太平洋工業	25.8	23.7	35,336								
日本電波工業	12.2	10.3	7,179	大真空	4.6	4.2	6,413	ケーピン	28.8	26	60,918								
鈴木	4.9	4.5	4,783	ローム	60.7	50.9	557,355	河西工業	16.7	13.9	20,502								
日本トリム	3.1	2.4	13,632	浜松ホトニクス	97.9	82.6	341,551	アイシン精機	114.8	93.4	589,354								
ローランド ディー.ジー.	6.4	5.8	16,698	三井ハイテック	16.6	15	28,275	富士機工	12.5	—	—								
フォスター電機	14.7	13.3	38,716	新光電気工業	47.4	42.8	36,765	マツダ	397.4	355.9	539,010								
クラリオン	66	60	21,360	京セラ	206	186.1	1,171,127	今仙電機製作所	11.5	10.5	12,831								
SMK	32	29	13,166	太陽誘電	61	50.9	88,667	本田技研工業	1,129.5	1,020.4	3,918,336								
ヨコオ	9	7.4	14,163	村田製作所	131.7	119	1,811,775	スズキ	248.8	224.7	1,353,592								
ティアップ	92	84	3,780	シーシン	16.8	17.1	11,935	S U B A R U	389.7	352	1,272,480								
ホシデン	38.1	28.6	43,043	双葉電子工業	20.5	18.5	41,791	安永	4.3	5.5	13,502								
ヒロセ電機	20.3	18.3	280,905	北陸電気工業	51	4.6	7,820	ヤマハ発動機	177.3	160.1	553,145								
日本航空電子工業	36	29	47,212	ニチコン	39.5	35.7	47,481	ショーワ	32.7	29.4	43,365								
T O A	14.8	12.2	18,605	日本ケミコン	108	9.2	26,689	T B K	16.3	13.5	7,087								
マクセルホールディングス	18.7	22.5	48,307	K O A	17.4	15.7	37,224	エクセディ	17	13.7	47,402								
古野電気	16.2	13.5	10,044	市光工業	26	17	16,133	豊田合成	40.5	41.2	104,030								
ユニデンホールディングス	37	31	9,393	小糸製作所	75.2	67.9	507,892	愛三工業	22	19.9	26,964								
アルパイン	29.9	27	60,939	ミツバ	23.1	20.9	28,800	盟和産業	1.8	1.7	2,295								
スマートコーポレーション	10.3	11.6	20,914	SCREENホールディングス	25.7	21.5	180,600	日本プラス	—	4.6	4,291								
アイコム	6.9	6.3	16,140	キヤノン電子	11.4	10.4	27,736	ヨロズ	11.7	11.5	25,472								
リオン	4.9	4.8	13,060	キヤノン	675.7	610.4	2,477,003	エフ・シー・シー	20.5	18.5	55,777								
本多通信工業	3.6	8.8	10,313	リコー	377.3	340.9	373,626	シマノ	50.6	45.7	712,006								
船井電機	13.8	11.5	9,154	MUTOHホールディングス	16	1.6	3,793	タカタ	22.7	—	—								
横河電機	136.1	113.5	246,635	東京エレクトロン	83.7	75.6	1,418,256	ティ・エス テック	29.1	26.3	110,723								
新電元工業	48	4	35,800	輸送用機器 (9.2%)	43.9	33	79,035	ジャムコ	7.4	5.7	13,189								
アズビル	38	34	158,270	トヨタ紡織	29	2.4	6,261	精密機器 (1.6%)	192.4	173.8	870,738								
東亜ディーケー	6.4	5.6	6,014	芦森工業	—	—	—	デルモ	—	—	—								

銘柄	期首(期末)	当期末			銘柄	期首(期末)	当期末			銘柄	期首(期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
クリエートメディック		千株	千株	千円		千株	千株	千円			千株	千株	千円	
日機装	4.4	3.8	4,571		アシックス	124.7	112.6	194,572		神戸電鉄	31	2.6	10,166	
島津製作所	43.4	39.2	46,412		ソツミ	4.7	3.5	7,115		名古屋鉄道	457	83.3	228,825	
J M S	161.5	135.5	364,224		小松オワール工業	4.3	3.8	8,869		山陽電気鉄道	46	8.3	22,526	
クボテック	2.8	2.5	1,390		ヤマハ	84.6	76.4	326,992		日本通運	485	42.2	307,638	
長野計器	8.5	8.9	10,181		河合楽器製作所	5	3.8	11,856		ヤマトホールディングス	224.4	188.3	524,227	
ブイ・テクノロジー	2.5	2.7	53,352		クリナップ	14.8	10.5	8,914		山九	165	27.6	141,864	
東京計器	43	7.2	9,086		ピジョン	75.9	68.5	287,015		丸運	7.1	6	1,932	
愛知時計電機	1.7	1.5	6,570		兼松サステック	14	9.0	1,827		丸全昭和運輸	42	38	18,810	
インタークション	—	4.4	3,942		キングジム	10.6	9.4	9,165		センコーグループホールディングス	56.4	64.6	49,871	
オーパル	12.5	11.2	3,192		リンテック	29.8	26.9	79,731		トナミホールディングス	26	2.6	13,338	
東京精密	24.2	20.5	88,355		T A S A K I	2.7	—	—		福山通運	42.5	40.8	114,484	
マニー	16.7	13.8	51,543		イトーキ	26.5	23.9	17,064		日本石油輸送	1.4	1.3	4,108	
ニコン	218.7	197.6	396,978		任天堂	77.3	69.8	313,4718		セイノーホールディングス	76	15.7	62,721	
トブコン	63.2	60.9	145,733		三菱鉛筆	10.3	18.7	42,505		神奈川中央交通	15	2.7	9,828	
オリンパス	200.3	168.9	689,956		タカラスタンダード	25.9	23.4	41,441		日立物流	26.1	23.6	63,838	
理研計器	11	10.8	23,403		コクヨ	65.2	54.4	103,033		丸和運輸機関	3.2	5.7	22,800	
タムロン	11.1	9.1	20,393		ナカバヤシ	23	11.1	7,437		C&ジョホールディングス	13.1	11.8	16,697	
H O Y A	258.2	230.9	1,251,478		グローブライド	6.2	5.1	11,526		九州旅客鉄道	93.5	90.1	297,330	
シード	—	1.2	6,768		岡村製作所	43.9	39.6	54,489		S G ホールディングス	—	76.1	172,899	
ノーリツ鋼機	12.3	11.5	27,933		美津濃	68	11.2	34,496		海運業(0.2%)				
エー・アンド・ディ	11.6	10.4	7,477		電気・ガス業(1.5%)	1,064.8	905.1	376,521		日本郵船	1,060	89.8	223,512	
シチズン時計	137.2	135.3	103,639		東京電力ホールディングス	413.5	346.9	475,426		商船三井	658	67.9	242,742	
リズム時計工業	51	4.3	9,331		中部電力	512.3	462.7	610,764		川崎汽船	476	49.6	134,019	
大研医器	10.8	10.1	7,514		関西電力	173.4	156.7	189,607		N S ユナイテッド海運	56	5.1	11,775	
メニコン	8.6	15.6	47,502		中国電力	122.8	111.1	93,768		明治海運	11.4	11.4	4,856	
松風	6.6	5.6	7,716		北陸電力	313.5	265.5	365,859		飯野海運	64.9	54.7	30,413	
セイコーホールディングス	89	17.5	51,555		東北電力	113	102.1	121,805		共栄タンカー	11	0.8	1,588	
ニプロ	86.8	78.5	122,931		四国電力	277.3	250.4	292,968		乾汽船	9.2	8.3	6,772	
その他製品(2.1%)					九州電力	117.5	113.7	75,610		空運業(0.6%)				
中本パックス	—	1.1	4,889		北海道電力	18.5	18.3	51,020		日本航空	226.1	199.2	791,820	
スノーピーク	1.6	3.5	4,942		沖縄電力	99.8	90.2	256,438		ANAホールディングス	2,330	210.5	887,257	
パラマウントペドールディングス	12	12	62,160		電源開発	5.3	5.7	6,469		パスコ	12	10	3,180	
トランザクション	2.8	5.1	5,089		エフオン	5.3	5.7	—		倉庫・運輸関連業(0.2%)				
S H O - B I	5	3.9	1,583		イーラックス	1,346	241.9	639,946		トランコム	3.6	3	22,050	
ニホンフラッシュ	5.3	5.3	12,243		東京瓦斯	1,218	220	473,110		日新	51	9.3	23,631	
前田工織	12.6	11.4	22,366		大阪瓦斯	316	56.2	179,840		三菱倉庫	82	37.1	96,274	
永大産業	16	15	8,085		東邦瓦斯	31	31	9,114		三井倉庫ホールディングス	73	61	20,984	
アートネイチャー	13.4	12.1	8,857		広島ガス	26	23.4	8,564		住友倉庫	91	74	54,538	
ダンロップスポーツ	8	—	—		西部瓦斯	142	13.8	38,239		澁澤倉庫	33	5.9	10,755	
パンダイムホールディングス	138.4	117.2	390,862		静岡ガス	38.6	32.2	29,913		東洋倉庫	22.2	19.5	6,591	
アイティジャパン	2.4	2.4	1,540		メタウォーター	7.1	6.4	18,707		日本トランシスティ	29	26	11,128	
共立印刷	21.6	18.9	6,804		陸運業(4.0%)	12.4	11.2	11,984		ケイヒン	23	2.1	3,675	
S H O E I	5.7	5.1	22,618		S B S ホールディングス	201.1	168.6	385,082		中央倉庫	7.4	6.6	7,048	
フランスペドールディングス	15.8	13.4	13,480		東武鉄道	670	121.2	419,352		川西倉庫	—	2.2	4,228	
パロットコーポレーション	21.9	19.8	100,188		相鉄ホールディングス	201	36.3	106,467		安田倉庫	9.7	9.7	8,827	
萩原工業	3.5	6.3	11,497		東京急行電鉄	682	308	546,084		東洋埠頭	37	3.2	5,612	
トップパン・フォームズ	22.4	24.3	29,475		京浜急行電鉄	344	155.3	309,512		宇德	10.4	9.4	4,521	
フジシラインターショナル	28.2	25.4	92,456		小田急電鉄	201.1	168.6	385,082		上組	150	67.6	157,710	
タカラトミー	48.9	47.5	71,535		京王電鉄	351	63.4	304,637		サンリツ	1.7	2.8	2,293	
廣済堂	12.7	10.6	4,727		京成電鉄	94.1	78.9	272,205		ギムラユニティー	3.3	2.9	3,311	
A s - me エステール	—	3.4	2,927		富士急行	34	15.5	47,430		キューソー物流システム	3.9	3.1	8,007	
アーカ	53.5	47.9	5,795		新京成電鉄	16	2.9	6,353		郵船ロジスティクス	11.5	—	—	
タカノ	5.7	5	4,810		東日本旅客鉄道	242.8	203.7	2,130,702		近鉄エクスプレス	22.5	20.3	45,309	
プロネクサス	11.8	10.6	14,235		西日本旅客鉄道	120.8	102.3	818,400		東海運	7.2	6.1	2,562	
ホクシン	9.7	8.2	1,566		東海旅客鉄道	104.4	101.5	2,053,345		エーアイティー	7.7	7.7	9,278	
ウッドワン	22	3.8	5,863		西武ホールディングス	173.3	144.5	300,704		内外両ランスライン	3.8	3.8	6,619	
大建工業	8.9	8.8	23,443		鴻池運輸	17.7	16	30,224		日本コンセプト	—	2.1	3,021	
凸版印刷	354	320	304,960		西日本鉄道	151	31.4	90,589		情報・通信業(7.2%)				
大日本印刷	362	148.4	338,945		ハマキヨウエラックス	8.2	8	29,560		N E C ネッツエスアイ	13.6	12.3	33,357	
図書印刷	17	7.6	6,984		サカイセイセンター	4.3	6	29,490		システィナ	9.9	8.9	38,982	
共同印刷	39	3.5	11,305		近畿グローバルディングス	1,263	107.4	449,469		デジタルアーツ	5.5	5.5	20,432	
N I S S H A	21.1	23.3	61,418		阪急阪神ホールディングス	158.5	143.2	587,120		新日本住金リューションズ	20.7	17.5	48,737	
光村印刷	3	1	2,342		南海電気鉄道	265	50.9	141,043		キユーピッシュシステム	5.6	6.5	5,076	
宝印刷	6.2	5.9	10,218		京阪ホールディングス	281	47.8	155,350		エイジア	—	1.7	2,344	

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	
株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円	
コアソリューションシステムズ	5.3	4.7	6,016	PCIホールディングス	1.5	1.9	5,766	テレビ朝日ホールディングス	33.8	30.5	74,359	
ソフトクリエイトホールディングス	6.1	5.4	8,483	パイオニアHD	1.8	1.8	2,296	スカパーJSATホールディングス	80.4	84.9	42,619	
T I S	41.1	37.1	139,681	アイビーシー	—	1.2	1,686	テレビ東京ホールディングス	10.1	9.1	24,806	
ネオス	3.9	3.4	1,431	オーピンドア	1.2	4.4	10,318	日本B S放送	2.8	3.8	5,209	
電算システム	4.3	3.9	7,410	マイネット	—	2.2	3,190	ビジョン	1.4	2.9	8,262	
グリー	75.5	59.6	40,468	アカツキ	—	2.2	13,486	USEN-NEXT HOLDINGS	3.4	2.9	3,146	
コーニーテックホールディングス	29.4	18.9	42,543	L I N E	20.7	33.6	150,528	ワイヤレスゲート	4.1	5.2	6,583	
三絆総合研究所	4.8	4.8	16,272	シンクロ・フード	—	0.9	2,630	コネクシオ	10.9	7.9	17,632	
ボルテージ	2.5	2.1	1,942	A O I TYO HOLDINGS	10.2	9.1	11,293	日本通信	104.2	100.8	11,188	
電算	1.5	1.3	3,260	マクロミル	—	10.4	26,884	クロップス	1.4	2.4	2,210	
AGS	2.6	6.3	5,247	ソルクシーズ	—	4.3	4,785	日本電信電話	994.5	798.5	3,985,313	
ファインデックス	9.2	9.3	6,956	フェイス	3.4	3.9	4,691	KDDI	1,225.6	1,001.9	2,675,573	
ヒト・ミニケーションズ	2.8	2.5	4,562	ハイマックス	—	1.5	2,517	光通信	14.9	13.4	201,134	
ブレインパッド	1.9	2.4	4,636	野村総合研究所	92.6	74.4	347,076	N T Tドコモ	925.7	823.7	2,194,748	
K L a b	23.7	21.6	35,791	サイバネットシステム	10.2	9.2	6,265	エムティーアイ	19	15	9,960	
ホールディング・ピットホールディングス	8.9	8.1	17,082	C Eホールディングス	1.8	3.2	2,681	GMOインターネット	45.3	40.5	67,959	
イーブン・シティ・ジャパン	2.1	1.8	1,809	日本システム技術	—	1.4	1,849	アドマーケティングコミュニケーションズ	—	1.8	1,242	
ネクソン	135.6	124	419,120	インテージホールディングス	7.1	12.8	16,460	カドカラ	35.9	32.4	42,670	
アイスタイル	26.1	27.9	41,347	東邦システムサインス	4.3	3.8	3,093	学研ホールディングス	41	3.7	21,016	
エムアップ	3.7	3.7	3,944	ソースネスト	6.8	15.7	10,142	ゼンリン	16.4	13.5	45,832	
エイチーム	6.9	7.6	18,810	フォーカスシステムズ	5.1	6.3	4,983	昭文社	6.9	5.1	3,728	
テクノスジャパン	9.6	10.1	8,958	フレスコ	2.9	2.5	9,250	インプラスホールディングス	11.1	9.5	1,767	
e n i s h	3.8	3.3	3,356	フジ・メディア・ホールディングス	128.9	116.5	225,194	アイネット	7.1	6.3	10,073	
コロプラ	34.5	36.1	32,165	オービック	42.7	35.1	287,820	松竹	82	7.4	113,960	
モバイルクリエイト	8.6	8.6	2,846	ジャストシステム	20.1	18.1	38,263	東宝	81	73.2	255,468	
オルトプラス	5.3	5.4	4,741	T D C ソフト	5.5	4.9	5,821	東映	46	4.2	44,562	
ブロードリーフ	30.6	27.6	28,621	ヤフー	888.5	802.3	400,347	エヌ・ティ・ティ・データ	76.5	345.6	402,278	
ハーツユナイテッドグループ	6.6	5.9	10,266	トレンドマイクロ	65.6	54.3	294,849	ピー・シー・エー	1.8	1.7	3,029	
メディアドッグホールディングス	2.7	3.6	6,840	イフォメーション・デイブロメント	3.7	3.5	4,662	ビジネスプレイン太田昭和	1.7	1.9	3,323	
ブイキューブ	6.9	6.9	3,429	日本オクラル	19.9	18	150,120	D T S	12.8	11.6	42,456	
サイバーリンクス	2	1.8	2,187	アルファシステムズ	4.1	3.7	8,206	スクウェア・エニックス・ホールディングス	47.7	51.7	226,187	
ディー・エル・イー	3.8	5.1	2,198	フューチャー	16.8	15.1	16,413	シーエーシー	7.4	6.6	20,988	
フィックススターズ	1.8	1.9	11,837	C A C Holdings	9.3	8.4	8,400	カプコン	29	23.8	93,296	
VOYAGE GROUP	4.3	5.7	6,726	ソフトバンク・テクノロジー	3	4.7	8,906	アイ・エス・ピー	2.3	2.2	2,769	
オプティム	1.1	1.9	4,324	トーセ	3.6	3	5,289	ジャステック	7.9	6.5	7,936	
セレス	2.2	3.4	5,531	オービックビジネスコンサルタント	6.3	5.7	33,459	S C S K	33.7	25.7	112,951	
ペリサーブ	1.5	1.4	4,508	伊藤園テクノリューションズ	28.1	25.3	107,778	日本システムウエア	4.1	3.7	10,511	
ティーガイア	12.4	11.1	28,038	アイティフォー	16.4	13.6	9,900	aines	15.6	14.1	15,157	
セック	—	1.1	3,183	東計電算	2.3	2	6,220	T K C	11.5	10.4	39,208	
日本アズガルグループ	14.1	11.7	5,557	エックスネット	1.3	1.8	1,602	富士ソフト	18.4	15.4	56,210	
豆蔵ホールディングス	9.2	8.3	10,275	大塚商会	33.3	33.4	305,276	N S D	26.3	18.3	39,528	
テクマトリックス	3.9	6.1	10,620	サイボウズ	16.8	14.9	7,703	コナミホールディングス	55.9	45.5	249,795	
プロシップ	—	1.6	3,289	ソフトブレーン	17.1	8.9	3,640	福井コンピュータホールディングス	3.6	3.2	9,206	
ガーネット・オンライン・エンターテイメント	259.9	301.7	91,415	電通国際情報報サービス	7.7	6.9	17,650	J B C ホールディングス	10.5	8.8	9,407	
GMOペイメントゲートウェイ	10.2	7.8	66,846	デジタルガレージ	18	20	60,900	ミクロ情報サービス	9.2	9.8	30,527	
ザッパラス	7.5	5.5	2,123	イーエムシステムズ	4.3	3.9	9,110	ソフトバンクグループ	557.7	503.7	4,376,145	
システムムリサーチ	—	1.1	2,392	ウェザーニューズ	4.2	3.8	12,312	卸売業(4.7%)	ホウズイ	12	0.9	1,036
インターネットニアティティブ	18.3	18.1	40,435	C I J	11.6	8.8	5,975	高千穂交易	4.9	4.3	4,760	
さくらインターネット	8.8	13.3	10,014	東洋システムエンジニアリング	1.4	1.1	1,926	伊藤忠食品	3.1	2.7	17,037	
GMOクラウド	2.8	2.5	5,005	日本エンタープライズ	13.4	11.7	2,574	エレマテック	4.9	5.2	12,022	
S R A ホールディングス	6.6	5.9	21,741	WOWOW	5.9	5.3	17,463	J A L U X	4	3.2	9,488	
MINORIリユース	2.7	2.2	3,423	スカラ	7.8	7.8	5,920	あらた	5.6	5.5	26,070	
システムインテグレータ	2	1.6	1,539	日本コロムビア	3.9	—	—	トーメンデバイス	1.9	1.7	4,896	
朝日ネット	11.7	10.2	5,283	イマジ・ロボット・ホールディングス	10.5	9.4	11,364	東京エレクトロン・デバイス	4.6	4	8,904	
e B A S E	—	2.2	2,387	ネットワンシステムズ	53.5	45.4	75,273	フィールズ	9.4	8.5	10,174	
アドソル日進	2.5	4.3	5,525	システムソフト	22.8	26.5	3,630	双日	731.2	660.7	225,298	
フリービット	6.9	7.4	6,852	アルゴグラフィックス	5.7	5.1	16,957	アルフレッサ・ホールディングス	146.6	124.1	296,102	
コムチュア	2.1	5.7	19,722	マーベラス	20.9	18.9	17,293	横浜冷凍	30.9	27	28,782	
サイバーパーコム	1.6	2	2,664	エイベックス	22.8	20.6	31,930	神栄	18	1.5	2,163	
メディカル・データ・ビジョン	2.1	4.2	9,000	日本ユニシス	34.2	30.9	66,589	山下医科器械	1.1	—	—	
g u m i	12.8	12.8	12,864	兼松エレクトロニクス	7.8	7.1	21,584	ラサ商事	5.8	5	4,545	
ショーケース・ティービー	—	2.2	2,796	東京放送ホールディングス	81.6	67	170,314	ラクーン	5.6	6.6	4,580	
モバイルファクトリー	—	2.1	2,541	日本テレビホールディングス	113	102.2	207,363	アルコニックス	7.1	11.8	27,163	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	1.7	5,032	朝日放送	12.1	11	9,801	神戸物産	6.7	7.2	28,404	

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末
株	数	株	数	評価額	株	数	株	評価額	株	数	評価額
ペッパーフードサービス	千株	千株	千円	丸紅	1,219.1	917.8	千円	西鉄Wismettacホールディングス	千株	千株	千円
あいホールディングス	17.6	17.9	25,980	高島	21	1.9	4,252	ヤマシタホールディングス	—	2.3	9,579
ディープイエックス	4.5	4	4944	長瀬産業	74.2	67.3	126,524	ヤマタネ	6.3	5.6	1,367
ダイワポーホールディングス	105	9.5	40,992	蝶理	7.9	7.1	13,411	丸紅建材リース	12	11	10,892
マニカ・富士エコホールディングス	22.9	20.7	62,824	豊田通商	137.9	124.6	513,352	日鉄住金物産	10.8	8.7	53,679
ラクト・ジャパン	—	1.6	6,088	三共生興	18.8	18.9	9,185	泉州電業	—	3.7	10,659
バイタルケイエー・ホールディングス	23.3	21	20,643	兼松	263	47.6	65,878	トラスコ中山	28.3	23.2	70,644
八洲電機	9.8	8.7	7,777	ツカモトコーポレーション	23	2	2,502	オートバックスセブン	45.8	44.4	90,886
メディアホールディングス	—	1.8	4,464	三井物産	1,120.1	948.7	1,806,324	モリト	9.9	8.9	8,312
UKCホールディングス	8	7.2	15,789	日本紙パルプ商事	65	5.8	24,998	加藤産業	19.4	17.4	63,597
ジユーテックホールディングス	—	2.6	3,341	日立ハイテクノロジーズ	43	38.8	186,822	イノテック	10.8	9.7	9,409
大光	—	2.6	2,386	カメイ	16.1	14.5	24,186	イエロー・ハット	11.7	10.5	34,387
OCHIホールディングス	3.3	3.2	4,457	東都水産	2	1.7	3,270	J Kホールディングス	12.4	11.2	9,587
TOKAIホールディングス	54.6	59	60,357	OGUホールディングス	20	1.8	4,622	日伝	5.1	9.3	21,064
大阪工機	—	1.7	1,793	スターゼン	5.2	4.4	21,736	北沢産業	11	9.5	2,479
三洋貿易	6.8	6.1	15,152	山善	47.5	43.6	53,976	杉本商事	7.2	6	10,872
ピューティガレージ	1.1	1.5	2,847	椿本興業	14	2.5	7,800	因幡電機産業	17.3	14.7	72,544
ワイン・パートナーズ	9	8.1	12,538	住友商事	779.8	704.4	1,269,681	パイタッグホールディングス	5.1	5.1	8,981
ミタチ産業	3.3	2.6	4,136	内田洋行	6.1	5.1	17,059	東テク	—	3.7	9,039
シップルスクアホールディングス	23.8	23.3	84,928	三菱商事	929.6	783.7	2,319,752	ミスマグリーピー本社	139.2	129.6	405,000
明治電機工業	4.3	3.8	7,166	第一実業	28	5.1	16,600	アルテック	11.2	9.6	3,004
デリカフーズホールディングス	2.9	2.2	3,082	キヤノンマーケティングジャパン	35.3	31.9	90,213	タキヒヨー	19	3.7	8,473
スター・ティア	2.6	2.5	2,465	西華産業	39	6.9	18,788	蔵王産業	2	1.8	3,425
コメダホールディングス	16.7	20.6	42,909	佐藤商事	11.1	10	11,310	ズクエン	56.4	50.9	219,633
富士興産	4.6	4.1	2,673	菱洋エレクトロ	11.8	10.4	18,189	ジェコス	8.6	7.7	9,178
協栄産業	16	1.4	2,758	東京産業	12.5	11.1	6,549	ルネサスイーストン	11.2	10.2	7,629
小野建	10.8	9.7	19,419	ユニアサ商事	11.7	10.6	39,061	小売業(4.7%)			
佐鳥電機	9.8	8.2	8,495	神鋼商事	3.1	2.5	9,187	ローソン	43	28.3	208,005
エコートレーディング	3.2	2.5	1,872	小林産業	9.4	7.6	2,660	サンエー	9.3	8.4	45,444
伯東	8.4	6.8	11,621	阪和興業	124	20.9	104,500	カワチ薬品	9.6	8.7	22,359
コンドーテック	9.9	8.9	8,650	正味食品工業	—	6.2	24,056	エービーシー・マート	22.5	20.3	141,491
中山福	7.5	6.4	4,838	カナダイン	11.9	10.7	14,348	ハーバーフコボレーション	5.5	4.9	5,826
ナガイレーベン	17.9	14.8	41,632	菱電商事	20	8	14,480	アスクル	12.9	9.7	33,901
三菱食販	13.6	12.3	38,622	フルサト工業	6.8	6.1	10,614	ゲオホールディングス	20.7	20.4	44,451
松田産業	9	8.1	14,928	岩谷産業	137	24.8	91,636	アダストリア	19	17.2	37,220
第一興商	20.1	16.6	94,620	すてきナイスグループ	53	4.8	6,955	ジーフット	7.5	6.7	5,199
メディアホールディングス	123.9	111.9	229,283	昭光通商	46	40	4,920	シ・ヴィ・エス・ベイエリア	1.9	1.5	1,075
S P K	2.8	2.4	7,147	ニチモワ	18	1.7	3,224	くらコボレーション	8.1	6.6	41,448
秋原電気	4.2	3.8	13,091	極東貿易	19	16	7,664	キャンドウ	6.6	5.3	9,126
アズワン	9.7	8.7	59,160	イワキ	19	16	6,672	バルーブホールディングス	6.3	5.7	17,014
スズデン	4.4	3.9	6,567	三愛石油	33.2	30	45,870	エディオン	48	43.4	56,463
尾家庭業	4.4	3.3	4,167	稻畠産業	29.6	26.8	42,102	サーラコボレーション	15.5	19.2	12,864
シモジマ	7.7	6.8	7,609	G S I クレオス	31	3	5,337	ワッツ	5.5	4.5	4,743
ドウジシャ	14.6	11.8	29,358	明和産業	11.6	10.4	5,064	ハローズ	4.1	4.2	10,239
小津産業	2.8	2.5	5,395	ワキタ	26.3	23.8	30,440	あみやき亭	2.4	2.4	12,096
高速	7.5	6.6	7,939	東邦ホールディングス	39.6	33.1	80,797	ひらまつ	17.2	15.4	8,639
たけびし	4.3	3.9	6,961	サンゲツ	42.4	37.7	82,487	ゲンキー	2.5	—	—
黒田電気	16.9	—	—	ミツワコブルー・ホールディングス	20	16.2	12,360	大黒天物産	3	2.7	13,432
リックス	2.9	2.5	4,475	シナネンホールディングス	5.3	5.3	13,414	ハニーズホールディングス	10.9	10.8	11,156
丸文	11	9.9	10,692	伊藤忠エネクス	27.3	24.7	24,798	ファーマライズホールディングス	3.1	2.6	1,580
ハピネット	10.4	7.6	13,588	サンリオ	38.2	31.4	57,210	アルペン	9.5	8.6	21,405
橋本総業ホールディングス	2.6	2.3	4,167	サンワ テクノス	7.3	6.6	14,143	ハブ	—	2.1	2,601
日本ライフライン	10.6	31.8	98,898	リョーザン	18.4	14	55,510	クオール	14	12.3	27,084
エクセル	5.3	4.5	10,944	新光商事	13.5	12.3	23,480	ジンズ	8.4	7.6	38,608
マルカキカイ	4	3.6	7,848	トーホー	5.7	5	12,085	ピックカメラ	71.1	64.7	103,131
I D O M	33.4	33.9	23,560	三信電気	13.7	10.3	19,250	DCMホールディングス	75.2	60.2	63,691
日本エム・ディ・エム	9.4	7.5	7,230	東陽テクニカ	16.4	12.9	12,280	Mon o t a R O	43.9	39.7	134,186
進和	7.3	6.6	15,549	モスフードサービス	16.2	14.6	48,034	東京一番フーズ	2.4	2.4	1,668
エスケイジャパン	2.7	2.4	1,423	加賀電子	11.2	10.1	28,017	DDホールディングス	2.8	2.5	8,900
ダイトイロン	5.7	5.1	10,878	ソーダニッカ	13.1	11.6	7,110	きちり	3.6	3.1	2,197
シーカス	8.8	7.1	32,482	立花エレック	8.4	7.6	15,853	アーランドサービスホールディングス	3.9	9.3	21,510
田中商事	3.9	3.5	2,845	フォーパル	5.5	4.9	4,312	J. フロント リテイリング	156.7	133.4	257,595
オーハシテクニカ	7	6.3	11,138	P A L T A C	19.8	15.7	81,483	ドーム・日スホールディングス	21.7	19.6	49,548
白銅	3.1	4	9,568	三谷産業	13.3	12.1	5,299	マツモトキヨシホールディングス	23.4	46.2	200,046
伊藤忠商事	907.3	819.6	1,696,572	太平洋興発	53	4.7	4,779	プロンコブリー	6.5	5.8	19,575

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末
株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円
スタートトウディ	千株 113.1	千株 109.7	341,715	ワタミ	千株 14.7	千株 13.2	21,040	ケーズホールディングス	千株 57.1	千株 47.3	141,474
トレジャー・ファクトリー	3.7	3.3	2,834	マルシエ	3.1	3	2,412	Olympicグループ	7.4	6.6	3,953
物語コーポレーション	3.3	3.2	30,400	ドンキホーテホールディングス	80.1	72.4	410,508	日産東京販売ホールディングス	18.3	16.4	6,445
ココカラファイン	12.9	11.7	81,081	西松屋チエーン	21.7	24.5	30,698	Genky DrugStores	—	4.4	15,730
三越伊勢丹ホールディングス	246.4	208.8	263,923	ゼンショーホールディングス	64.2	57.9	112,615	AINホールディングス	16.2	15	100,950
Hamee	1.9	2.8	5,028	幸栄苑ホールディングス	8	7.1	12,815	元気寿司	3.2	2.8	7,949
ウェルシアホールディングス	12.3	29.5	131,422	ハーケスレイ	3	2.7	3,007	ヤマダ電機	414.3	374.3	240,300
クリエイツホールディングス	18.2	16.5	42,504	サイゼリヤ	20.4	16.6	52,041	アーカンドサカモト	21	18.9	34,813
丸善CHIホールディングス	14.8	13	4,394	V T ホールディングス	42	37.8	20,903	ニトリホールディングス	53.5	44.3	753,543
ミサワ	1.8	1.8	790	魚力	3.9	3.1	3,605	グルメ杵屋	9	8	9,144
ティーライフ	—	1.5	1,828	ボプラ	3.5	3	2,565	愛眼	9.7	9.1	4,495
エー・ピーカンパニー	2.3	2.2	1,733	フジ・コーポレーション	1.9	1.9	4,670	ケーユーホールディングス	6.5	5.8	6,327
チムニー	3.4	3.4	9,683	ユナイテッドアローズ	16.5	13.8	58,098	吉野家ホールディングス	43.1	36.7	71,895
シュッピン	4.7	6.8	7,792	ハイディ日高	11.3	12.2	40,565	松屋フーズ	6	5.4	20,763
ネクステージ	2.2	11.4	11,468	京都さもの友禅	8.1	7.3	5,548	サガミ cheese	15.6	14.9	20,681
ジョイフル本田	20.1	16.4	57,728	コロワイド	41.1	37.1	78,726	関西スーパー・マーケット	10.2	8.4	9,735
鳥貴族	3.1	4.1	12,628	ビーシードボーコーポレーション	16.5	16.7	12,157	王将フードサービス	9.1	8.2	40,754
キリン堂ホールディングス	4.1	3.9	6,949	啻番屋	8.7	7.9	34,997	プレナス	13.9	12.5	26,375
ホットランド	4.9	6.5	8,846	トップカルチャー	5	4.1	1,972	ミニストップ	9.1	8.3	18,044
すかいらーく	53.2	69.3	108,246	P L A N T	2.8	2.6	3,372	アーツ	23.2	20.9	53,859
綱半ホールディングス	5	4.2	17,577	スキヨホールディングス	27.1	24.5	138,915	パローホールディングス	26.7	26	72,358
ヨシックス	—	1.8	5,940	ヴィア・ホールディングス	9.4	9.8	6,948	藤久	—	0.9	1,525
コメデイ・スザンヌ・ホールディングス	40.9	37.1	40,661	スクロール	18.8	17.4	7,221	ベルク	5.5	5	30,250
ブックオフコーポレーション	7.3	6.4	5,331	ヨンドリホールディングス	9.4	11.4	31,942	大庄	6.7	6	10,290
ゴルフダイジェストオンライン	3.9	4.5	4,914	エー・ピーエー・マートホールディングス	54.3	35.7	256,326	ファーストリテイリング	20.7	18.7	811,206
B E E N O S	1.5	1.5	2,227	木曾路	15.2	13.7	36,935	サンドラッグ	23.6	47.3	214,505
あさひ	9.2	8.3	11,105	S R S ホールディングス	14.8	13.2	12,474	サックスバー・ホールディングス	11.7	10.5	12,022
日本調剤	4.4	3.9	14,371	千趣会	22.3	20.2	12,019	ヤマザワ	2.6	2.3	3,983
コスマス薬品	6.2	5.6	106,120	タカキュー	10.7	9	1,989	やまや	2.6	2.3	6,762
トーエル	6.2	5.5	5,357	上新電機	21	20.7	13,103	ペルーナ	31	27.4	33,729
一六堂	3.3	2.5	1,102	日本瓦斯	29	13.2	41,448	銀行業 (7.5%)			
オンリー	—	1.7	1,521	日本瓦斯	22.7	20.5	90,302	島根銀行	2.8	2.4	3,331
セブン＆アイ・ホールディングス	518.5	468.1	2,085,385	ベスト電器	40.3	—	—	じもとホールディングス	89.2	75.7	13,701
葉王堂	6.2	4.9	17,076	ロイヤルホールディングス	20.5	19.8	57,756	めぐみファインシャルグループ	597.3	581.1	237,117
クリエイト・システムズ・ホールディングス	33.3	30	35,220	東天紅	10	0.8	1,559	東京Y・ファインシャルグループ	17.9	15.1	42,536
ツルハホールディングス	24.8	24.2	358,160	いなげや	13.8	12.4	22,034	九州フィナンシャルグループ	203.1	183.4	114,441
サンマルクホールディングス	8	8	24,120	島忠	32	27	92,475	ゆうちょ銀行	350.8	316.8	459,360
フレッシュ	3.6	2.9	3,659	チヨダ	14.6	13.2	35,508	富山第一銀行	31.6	28.5	14,421
トリニティホールディングス	15.2	13.8	49,680	ライフコーポレーション	9.4	8.5	23,536	コンコニア・ファインシャルグループ	811.1	680	428,400
TOKYO BASE	—	2.2	8,305	リンクコーパート	13.1	13.8	32,678	西日本ファインシャルホールディングス	84	75.8	103,315
サツドラホールディングス	1.7	1.5	2,881	さが美グループホールディングス	11	10	1,160	新生銀行	1,179	96.8	163,979
ダイコ・リックホールディングス	4.2	5.2	7,066	M r Ma x H D	15.6	14	9,940	あおぞら銀行	784	66.6	293,040
パログジャパンリミテッド	7.3	8.9	8,107	テナラーライド	12.5	10.6	4,876	三菱UFJ・ファインシャル・グループ	9,387.8	7,901.7	6,258,146
クリアオカホールディングス	9.8	8.9	51,086	AOKI ホールディングス	24.7	22.3	37,419	りそなホールディングス	1,449.4	1,227.4	774,366
スローゲームホールディングス	—	10.7	45,635	オーワク	18	16	17,264	三井住友カード・ホールディングス	258.6	219.9	979,214
L I X I L ビバ	—	10.6	21,549	コメリ	19.1	17.2	52,116	三井住友信託・ホールディングス	992	846.5	4,064,893
メディカルシステムズネットワーク	14.1	12.7	7,581	青山商事	25.9	21.4	89,987	第四銀行	152	13.7	69,185
総合メディカル	6	4.9	29,743	しまむら	14.4	13	160,160	北越銀行	13.4	11.2	27,540
はるやまホールディングス	5.7	5.2	5,543	はせがわ	4.8	5.9	2,938	千葉銀行	478	401	362,504
ノジマ	14.4	19.6	50,274	高島屋	208	175	193,550	群馬銀行	275.2	227.1	150,113
カッパ・クリエイト	17.5	13.9	17,208	松屋	27	22.5	33,705	武蔵野銀行	19.7	17.8	64,703
ライトオン	9.3	9.4	8,507	エイ・ツー・オー リテイリング	63.4	52.9	110,455	千葉興業銀行	34.1	30.8	15,615
ジーンズメイト	4.6	3.4	3,022	近鉄百貨店	47	4.3	16,555	筑波銀行	51.6	46.6	17,941
良品計画	16.4	14.8	505,420	丸栄	26	—	—	七十七銀行	194	35.1	97,999
三城ホールディングス	15.5	13.8	7,424	パルコ	11.8	10.7	16,017	青森銀行	96	8.7	30,493
アドヴァン	12.6	11.4	11,799	丸井グループ	130.3	107	204,584	秋田銀行	81	7.2	21,420
アルビス	3.3	2.5	8,650	アクシアル リテイリング	9.6	9.3	38,083	山形銀行	70	12.6	30,025
コナカ	15.7	14.3	8,537	井筒屋	7	6.3	2,526	岩手銀行	8.1	7.8	33,774
ハウス オブ ローザ	1.7	1.4	2,465	イオン	509.6	429.7	783,128	東邦銀行	111	99.9	38,861
G-7ホールディングス	3.7	3.3	7,982	イズミ	24.6	20.2	140,188	東北銀行	65	5.8	8,473
イオン北海道	12.4	11.2	9,195	東武ストア	1.5	1.3	3,939	みちのく銀行	63	7.2	13,046
コジマ	18.4	19.3	6,407	平和堂	25.1	22.7	52,595	ふくおかフィナンシャルグループ	503	454	272,400
ヒマラヤ	3.9	3.1	3,676	フジ	13.8	13.1	28,846	静岡銀行	337	295	331,580
コーナン商事	17.6	15.9	41,514	ヤオコー	14	12.7	64,770	十六銀行	166	15	45,150
エコス	4.8	4.5	5,629	ゼビオホールディングス	16.8	15.2	34,215	スルガ銀行	126.7	114.4	246,646

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	
株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円	
八十二銀行	千株 238.9	千株 202.4	129,738	水戸証券	千株 38.5	千株 34.7	13,706	エストラスト	千株 2.4	千株 1.6	1,609	
山梨中央銀行	77	69	30,774	いちよし証券	27.7	23.5	30,949	フージャスホールディングス	16.1	27.2	19,121	
大垣共立銀行	165	17.7	47,754	松井証券	70.6	54.7	55,411	オープンハウス	17.9	18.2	106,834	
福井銀行	106	9.6	24,681	だいこう証券ビジネス	6.2	5.5	3,586	東急不動産ホールディングス	299.5	270.8	213,932	
北國銀行	131	12.7	55,816	カブドットコム証券	132.9	118.7	41,782	飯田グリードホールディングス	103.3	93.3	193,037	
清水銀行	4.2	3.8	11,571	極東証券	92.3	71.6	26,850	ムゲンエステート	4	6.9	7,314	
富山銀行	2.4	2.2	8,602	岩井コモホールディングス	16.6	15	23,655	ファーストブラザーズ	1.3	3.1	4,436	
滋賀銀行	116	105	59,640	藍澤證券	11.7	11.4	15,583	ハウスク	—	1.8	4,305	
南都銀行	12	13.1	39,431	マネーパーナーズグループ	23.2	20.9	15,466	シーアルリー	1.8	1.8	2,874	
百五銀行	111	107.3	58,156	小林洋行	15.9	14.3	5,248	ケイアイスター不動産	—	4	11,300	
京都銀行	222	42.7	259,189	保険業 (2.3%)	4.3	3.3	924	パーク24	62.8	62	160,518	
紀陽銀行	46.5	42	73,710	かんぽ生命保険	46.8	42.2	118,117	パラカ	3.6	3.6	8,722	
三重銀行	5.6	5	11,970	SOMPOホールディングス	259	219.3	910,533	三井不動産	657	558.5	1,453,496	
ほくほくフィナンシャルグループ	82.4	74.4	118,668	アコム ホールディングス	8.4	7.6	24,472	三菱地所	921	832.5	1,606,725	
広島銀行	365	165.1	144,297	MS&Dコンピュータホールディングス	370.2	292.4	1,035,096	平和不動産	23.4	19.8	38,966	
山陰合同銀行	74.4	66.3	69,084	ソニーイナーシャルホールディングス	118.7	91.9	185,546	東京建物	143.7	122.2	206,273	
中国銀行	87.8	77.3	105,746	第一生命ホールディングス	747.1	632.7	1,407,441	ダイビル	31.9	28.8	38,764	
鳥取銀行	4	3.6	6,372	東京海上ホールディングス	501.9	421.3	2,092,175	京阪神ビルディング	20.6	18.6	16,089	
伊予銀行	132.4	159.6	140,288	アドバンスクリエイト	—	2.7	3,099	住友不動産	297	268	1,036,892	
百十四銀行	136	119	43,435	T&Dホールディングス	451.5	345.9	656,518	大京	230	17.8	37,771	
四国銀行	96	17.1	26,983	その他金融業 (1.2%)	3	2.6	4,992	テーオーシー	48.1	38.6	33,350	
阿波銀行	106	90	61,020	全国保険	34.9	31.5	147,735	東京楽天天地	21	1.8	9,504	
大分銀行	71	6.4	26,848	アルビ	9.6	9.6	12,796	レオパレス21	156.3	133.5	112,407	
宮崎銀行	83	7.4	25,345	クレディセゾン	93.9	84.9	156,810	スターワープレーション	12.6	15.2	42,955	
佐賀銀行	75	6.8	17,061	アクリーティブ	10.6	6.3	2,160	フジ住宅	15.8	14.3	11,654	
十八銀行	76	69	20,010	芙蓉総合リース	14.2	12.8	93,056	空港施設	15.1	11.7	7,230	
沖縄銀行	12	10.9	48,559	興銀リース	23.3	21	59,094	明和地所	7	6.2	5,133	
琉球銀行	25.5	21.7	36,173	東京センチュリー	24.9	22.5	132,300	住友不動産販売	11.1	—	—	
セブン銀行	464.4	419.5	158,151	日本証券金融	54.3	45.8	29,586	ゴールドクレスト	11.2	8.8	18,832	
みずほフィナンシャルグループ	16,819.1	15,195.2	3,034,481	アイフル	207.7	187.8	71,364	日本エスリード	4.9	4.4	9,372	
高知銀行	47	4.1	5,559	ポケットカード	9.4	—	—	日神不動産	14.7	14.9	11,934	
山口フィナンシャルグループ	116	105	134,295	リコーアーティス	9.7	8.8	32,340	日本エスコン	16.7	20.1	13,286	
長野銀行	4.1	3.7	7,007	イオンファイナンシャルサービス	79.1	79.4	206,678	タカラーレーベン	54.1	52.4	24,208	
名古屋銀行	10.4	9	36,540	アコム	249	224.9	102,329	サンコウハウジング名古屋	6.4	5.8	6,977	
北洋銀行	202	168.6	63,899	ジャックス	68	13.6	34,272	イオンモール	79.7	72.1	161,648	
愛知銀行	4.2	3.8	20,406	カリエットコボレーション	267.6	242.1	41,641	ファースト住建	4.7	4.2	6,997	
第三銀行	7.1	6.3	10,747	日立キャピタル	29.2	30.8	89,135	ランド	64.4	241.4	3,862	
中京銀行	5.1	4.6	10,626	アプラスファイナンシャル	60.1	54.4	5,657	カチタス	—	11.4	34,884	
大光銀行	44	3.8	9,047	オリックス	877.3	746	1,423,368	トーセイ	17	13.6	17,571	
愛媛銀行	14.7	15.6	21,013	三菱UFJリース	314.2	283.9	193,903	穴吹興産	1.4	1.2	3,756	
トマト銀行	4.9	4.3	6,574	九州リースサービス	—	4.8	4,180	エヌ・ティ・ティ都市開発	76.9	69.5	87,917	
みなど銀行	11.2	10.1	20,886	日本取引所グループ	385.2	328.6	609,553	サンフロントイア不動産	13.3	12.6	14,779	
京葉銀行	101	99	50,589	NECキャピタルリユース	3	3	11,130	エフ・ジェー・ネクスト	10.9	8.6	7,507	
関西アーバン銀行	17.3	15.6	22,011	日本取引所グループ	385.2	328.6	609,553	インテリックス	—	3.2	3,536	
栃木銀行	68.3	57.9	25,070	イー・ギャランティ	3.7	3	3,003	ランドビジネス	8	6.9	2,277	
北日本銀行	3.9	3.5	10,640	アサックス	5	4.6	9,798	グランディハウス	11.1	9.9	4,435	
東和銀行	233	19.6	27,165	NECキャピタルリユース	5	4.6	9,798	日本空港ビルディング	39.5	32.7	131,944	
福島銀行	136	10.6	8,734	不動産業 (2.4%)	117.8	159.8	69,832	サービス業 (4.1%)	日本工営	8.8	7.3	24,382
大東銀行	65	5.4	8,213	いちご	149.6	135.1	24,182	L I F U L L	32.5	37.7	31,969	
トモニホールディングス	102.2	92.2	48,036	日本駐車場開発	258.4	233.5	294,910	ジェイエイシーウルートメント	8.1	8.7	17,982	
フィデアホールディングス	120.4	108.6	20,634	ヒューリック	22.1	22.7	10,850	日本M&Aセンター	37.9	37.5	240,750	
池田泉州ホールディングス	131.4	118.6	49,100	三井建築設計	5	4.5	9,387	メンバーズ	—	2.7	2,076	
証券、商品外取引業 (1.0%)	F P G	44.2	39.1	53,097	スター・マイカ	—	4.1	7,244	中広	1.4	1.2	872
	マキアリアイベントメント	—	2.3	2,849	野村不動産ホールディングス	82.2	74.4	181,684	タケエイ	11.6	11.3	13,752
	S B I ホールディングス	140	126.5	275,770	デイア・ライフ	8.8	11.3	6,802	トラスト・テック	5.4	4.9	14,082
	日本アジア投資	12.2	10.1	3,737	コーセーアーラリー	—	1.9	2,021	コシダカホールディングス	4.5	5.7	34,428
	ジャフコ	20.7	16.1	88,711	エー・ディー・ワックス	116.1	150	6,150	パソナグループ	11.4	10.3	23,051
	大和証券グループ本社	1,159	957	709,806	日本商業開発	6.9	6.3	10,993	C D S	3.2	3	3,807
	野村ホールディングス	2,532.8	1,924	1,264,068	パインズコボレーション	19.3	15.3	23,011	リンクアンドモバペーション	29.8	19.9	16,755
	岡三証券グループ	105	95	64,980	ユニゾホールディングス	10.2	13.1	37,086	G C A	11.7	12.4	11,928
	丸三証券	39.4	35.6	35,813	T H E グローバル社	4.9	5.3	4,897	エス・エム・エス	18.5	21.4	83,246
	東洋証券	44	40	12,520	日本管理センター	8.9	7.4	11,225	バーリホールディングス	101.4	100	247,600
	米国フィナンシャル・ホールディングス	142	123.8	97,059	サンセイランディック	2.7	3.3	4,118	リニカル	7.8	7	10,444
	光世証券	30	2.7	3,815					ツップパッド	29.3	34.1	21,278

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	
株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円	
エスクリ	千株 4.7	千株 3.8	3,792	ビー・エム・エル	千株 17.2	千株 13.9	40,059	長大	千株 —	千株 3.3	2,610	
アイ・ケイ・ケイ	6	6.4	4,800	ワタベウェディング	2.1	1.8	1,144	燐ホールディングス	2.6	2.6	7,173	
学情	5.5	5	7,530	りらいコミュニケーションズ	21.7	17.1	23,563	スバル興業	10	0.8	5,176	
スタジオアリス	5.4	5.4	14,612	リゾー教育	22.4	18.4	14,572	東京テアトル	52	4.5	6,457	
シミツホールディングス	6.7	6	15,144	早稲田アカデミー	1.9	1.6	2,702	タナベ経営	2.7	2.1	3,866	
NJS	3	2.7	4,155	ユー・エス・エス	158.7	132.3	297,542	ナガワ	2.4	2.2	9,856	
総合警備保障	47.7	43.1	218,086	東京個別指導学院	4.4	3.8	4,590	よみうりランド	26	2.4	11,340	
カ力カコム	93.6	83.3	141,526	サイバーエージェント	69	71.2	298,328	東京都競馬	90	8.1	32,562	
アイロムグループ	3.9	3.7	6,571	楽天	670	555.6	521,986	常磐興産	5	4.4	8,052	
セントケアホールディング	—	4.6	3,307	クリーク・アンド・リバー社	4.7	5.6	5,611	カナモト	18.3	16.5	54,202	
サイネット	—	1.6	1,428	テー・オー・ダブリュー	10.6	9.7	8,836	東京ドーム	52.3	43.9	43,504	
ルネサンス	6.8	5.3	9,290	セントラルスピーツ	4.5	4	15,700	西尾レントオール	10.6	9.5	36,812	
ディップ	17	15.3	48,960	フルキャストホールディングス	13.5	9.5	21,422	トランス・コスマス	15.2	12	32,820	
オプトホールディング	9.3	7.6	10,047	リソルホールディングス	13	1.2	4,812	乃村工藝社	28.1	25.3	57,102	
新日本科学	13.9	13.2	6,877	テクノプロ・ホールディングス	21.3	19.3	115,607	藤田観光	43	4.3	14,018	
ツクイ	31.2	25.5	21,726	アトラ	—	1.9	1,577	KNT-CTホールディングス	72	6.7	11,048	
キャリアデザインセンター	2.8	2.5	5,485	インターワークス	2.6	2.4	2,599	日本管財	11.3	11.6	23,977	
エムスリー	113.6	114	440,610	Ke e P e r 技研	1.5	3.5	4,389	トーカイ	5.8	10.5	26,050	
ソラガ・グローバルホールディング	9.6	8.7	5,367	ファーストロジック	0.7	1.7	1,492	白洋舎	0.5	1.2	4,578	
プラス	—	0.6	594	三機サービス	—	1.2	2,144	セコム	136.4	115	923,450	
アウトレーニング	7.5	32.3	61,014	G u o n s y	—	4.9	12,588	セントラル警備保障	5.8	5.2	12,682	
ウェルネット	9.9	11	12,243	デザインワン・ジャパン	—	2.1	2,612	丹青社	22.7	22.2	24,375	
ワードホールディングス	3	3.6	12,042	イー・ガーディアン	4.3	5.5	16,802	マイテック	15.9	12.7	76,454	
ディー・エヌ・エー	58.8	58.4	128,947	リブセンス	9.3	7.1	3,592	アサツー ディ・ケイ	21.4	—	—	
博報堂DYホールディングス	181.8	150.6	241,411	ジャパンマテリアル	9.6	9.9	40,590	応用地質	12.4	12.2	16,421	
ぐるなび	19	17.2	23,994	ペクトル	10.7	13	29,809	船井総研ホールディングス	16.9	22.5	50,557	
エスアーリージャカミヤ	14.3	12.8	8,294	ウチヤマホールディングス	6.3	5.4	2,959	進学会ホールディングス	5.5	5	3,135	
ジャパンベストレスキューシステム	17.3	13.5	9,976	ライクチャinzクス	1.1	1.1	2,092	オオバ	9.7	8.6	4,497	
ファンコミュニケーションズ	33.4	30.2	23,978	ギヤリヤリンク	3.1	3.1	1,736	いであ	—	2.2	2,455	
ライク	2.8	4.3	8,281	I B J	10.3	8.6	8,264	学究社	3.5	3	4,893	
ビジネス・ブレークスルー	—	5.2	2,392	アサンテ	4.9	3.9	6,977	ペニッセホールディングス	43.9	39.7	152,249	
WD-Bホールディングス	4.8	5	16,750	N・フィールド	6.2	6.1	9,339	イオンディライト	14.8	13.4	50,049	
ティア	6.5	5.7	6,195	バリューハー	—	2.5	5,330	ナック	8.1	7.3	7,438	
CDG	—	1	1,797	M&キヤタナルパートナーズ	1.7	2.2	17,402	ニチイ学館	22.8	20.6	27,439	
バリューコマース	12.9	9.7	10,796	ラドオン・エス・ピース・ホールディングス	3.1	4.4	4,554	ダイセキ	22.9	18.2	57,148	
インフォマート	55.7	54.8	42,963	E R I ホールディングス	3.7	3.1	2,867	ステップ	4.5	4	7,148	
J P Hホールディングス	37.8	34.1	9,991	アビスト	2.1	1.5	7,192	合計	株数・金額	189,859,445	137,421,8	283,752,429
エコナックホールディングス	44	21.7	2,604	シグマクシス	—	4.3	6,978	銘柄数×比率	1,968銘柄	2,049銘柄	<98.1%>	
E P S ホールディングス	16.3	16.3	36,609	ウィルグループ	5.4	4.7	8,756	(注 1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。				
レッグス	3	2.7	2,130	エクスロ・エージェント・ジャパン	—	14.9	6,585	(注 2) 合計欄の<>内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。				
プレステージ・インターナショナル	18.7	22.5	30,060	日本ビューホテル	1.9	2.4	3,518	(注 3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。				
アミユーズ	7.3	7.2	23,256	リクトホールディングス	286.5	835.9	2,067,180					
ドリームイキューベータ	4	3.6	8,910	エラン	1.7	2.7	3,855					
クイック	6.8	6.7	12,066	土木管理総合試験所	—	3.3	1,966					
T A C	7.7	6.7	2,056	日本郵政	341.9	614.8	786,944					
ケネディクス	166.2	143.5	95,140	ペシシステム24ホールディングス	20	18.2	27,573					
電通	146.1	132	603,900	鎌倉新書	—	1.5	3,391					
ティアンドギ・ニーズ	6.3	5.1	5,242	一蔵	—	1.4	1,488					
ぴあ	4	3.6	23,868	L I T A L I C O	—	1.9	3,991					
イオンファンタジー	3.9	3.5	17,605	グローバルグループ	—	1.2	1,783					
シーティーエース	3.6	11.1	8,180	エボラブルアジア	—	2.2	4,752					
ネクシィーズグループ	4.7	4.3	7,297	ストライク	—	1	5,800					
みらかホールディングス	33.5	32.3	139,051	ソラスト	6	6.5	18,271					
アルプス技研	5.3	9.5	19,684	セラク	—	1.9	1,352					
サニックス	22	17.4	3,810	インソース	—	1.3	4,277					
ダイオーズ	2.6	2.2	2,904	キャリアインデックス	—	1.1	2,162					
日本空調サービス	12.8	11.4	8,401	MS-Japan	—	0.8	4,832					
オリエンタルランド	141.7	128	1,292,160	リログループ	4.9	59.3	175,646					
ダスキン	33.6	29.1	77,958	東祥	2.8	6.7	24,220					
明光ネットワークジャパン	16.3	13.7	17,385	エイチ・アイ・エス	21.4	16.9	64,135					
ファルホールディングス	6.3	5.6	9,576	ラックランド	2.2	2.1	4,405					
秀英予備校	2.9	2.4	1,152	共立メンテナンス	10.6	19.3	83,183					
田谷	2.6	2	1,340	イチネンホールディングス	13.9	12.1	18,428					
ラウンドワン	41	33.6	62,025	建設技術研究所	8.4	7.5	8,827					
リゾートトラスト	50.8	45.9	113,510	スペース	7	7	10,311					

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期				末
	買 建 額		売 建 額		
国内 T O P I X		百万円 2,185		百万円 -	

■投資信託財産の構成

2018年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
株式	千円 283,752,429	% 96.9	
コール・ローン等、その他	8,967,814	3.1	
投資信託財産総額	292,720,244	100.0	

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

■損益の状況

当期 自2017年2月8日 至2018年2月7日

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

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

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2018年2月14日）
 (計算期間 2017年2月15日～2018年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 （ペンチマーク）	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	純資産額
		期中騰落率	期中騰落率				
11期（2014年2月14日）	円 11,945	% 2.6	ポイント 353.47	% 2.6	99.4	% —	百万円 442,682
12期（2015年2月16日）	12,161	1.8	359.95	1.8	98.5	—	422,496
13期（2016年2月15日）	12,614	3.7	373.37	3.7	98.6	—	400,593
14期（2017年2月14日）	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	—	379,734
15期（2018年2月14日）	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	355,598

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

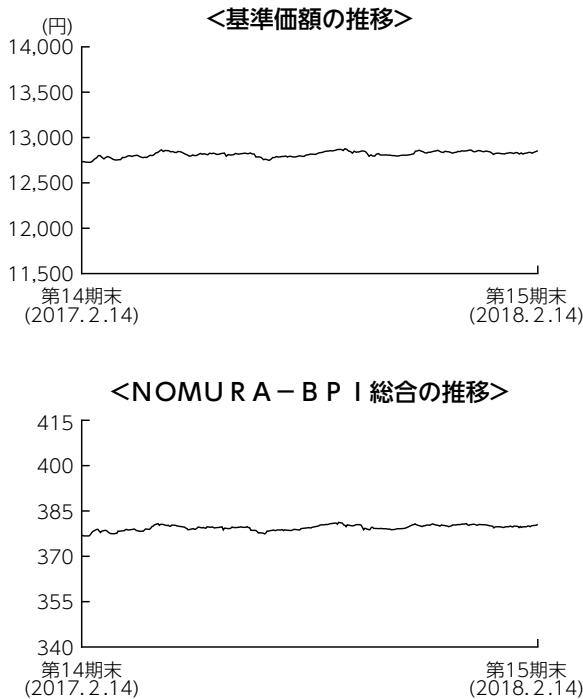
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年2月15日から2018年2月14日まで）



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

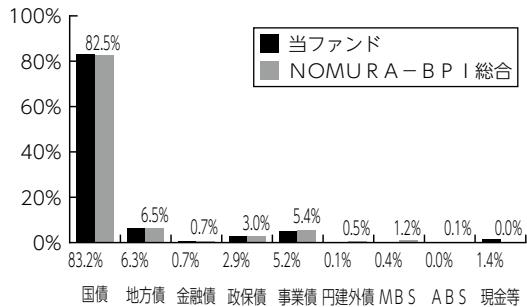
ポートフォリオについて

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

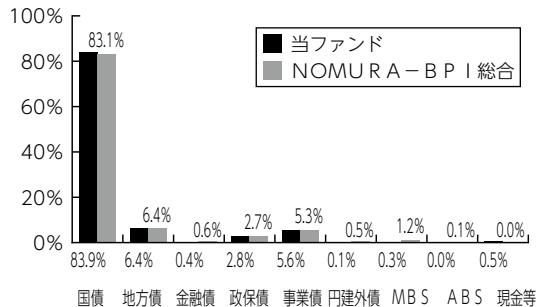
【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

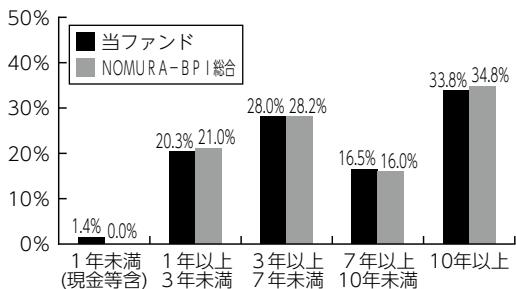


期末

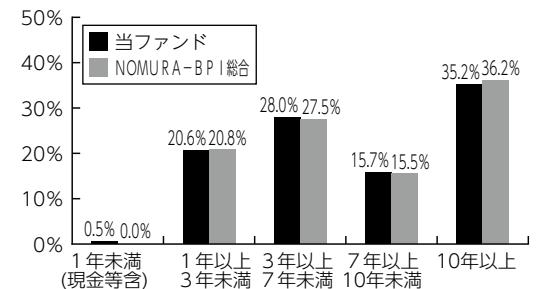


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.0%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■売買及び取引の状況 (2017年2月15日から2018年2月14日まで)

公社債

		買付額	売付額
国 内	国 債 証 券	千円 64,393,233	千円 82,177,834 (-)
	地 方 債 証 券	499,440	1,337,675 (-)
	特 殊 債 券	1,766,466	3,981,378 (184,898)
	社 債 券	3,827,258	3,369,132 (-)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) (-)内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2017年2月15日から2018年2月14日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D		D/C
		百万円	%		百万円	%	
公社債	70,486	928	1.3	90,866	1,113	1.2	

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期			
	買付額	売付額	当期末保有額	
債券	百万円 -	百万円 -	百万円 309	百万円 309

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 272,520,000	千円 298,367,587	% 83.9	% —	% 55.8	% 19.3	% 8.8
地方債証券	22,040,900	22,890,191	6.4	—	3.2	2.7	0.5
特殊債券	13,796,383	14,254,630	4.0	—	1.6	1.3	1.0
金融債券	1,500,000	1,501,968	0.4	—	—	0.2	0.3
普通社債券	16,181,000	16,870,570	4.7	—	1.7	2.3	0.7
合計	326,038,283	353,884,946	99.5	—	62.4	25.8	11.4

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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

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

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
3 2 1 回 利付国庫債券 (10年)	1.0000	2,500,000	2,613,400	2022/03/20
5 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	810,000	880,040	2022/03/21
1 3 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	2,000,000	2,017,420	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	2,000,000	2,078,440	2022/06/20
5 7 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,130,000	1,228,502	2022/06/20
1 3 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,500,000	3,531,465	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	1,500,000	1,561,545	2022/09/20
5 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	600,000	655,200	2022/09/20
1 3 4 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,000,000	1,009,480	2022/12/20
3 2 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.7000	500,000	519,330	2022/12/20
3 2 7 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	620,000	646,982	2022/12/20
6 0 回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	590,000	632,893	2022/12/20
3 2 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,500,000	1,552,890	2023/03/20
6 1 回 利付国庫債券 (20年)	1.0000	800,000	844,568	2023/03/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	1,800,000	1,884,942	2023/06/20
6 2 回 利付国庫債券 (20年)	0.8000	800,000	837,752	2023/06/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	1,200,000	1,258,956	2023/09/20
6 4 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	600,000	666,354	2023/09/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,500,000	1,558,485	2023/12/20
6 5 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,100,000	1,226,368	2023/12/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	2,000,000	2,080,000	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,170,000	1,309,311	2024/03/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	2,100,000	2,186,793	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	1,250,000	1,444,300	2024/06/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	2,000,000	2,072,060	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,250,000	1,426,312	2024/09/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	1,500,000	1,555,560	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	1,300,000	1,330,316	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	790,000	900,244	2024/12/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	2,000,000	2,061,800	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	870,000	1,001,970	2025/03/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,800,000	1,856,250	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	890,000	1,015,596	2025/06/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	2,500,000	2,578,850	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	1,030,000	1,187,734	2025/09/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,500,000	3,585,120	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	780,000	908,785	2025/12/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,000,000	3,024,240	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,400,000	1,637,104	2026/03/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,000,000	3,022,470	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	1,200,000	1,428,384	2026/06/20
3 4 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,500,000	3,524,010	2026/09/20
9 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	1,200,000	1,423,764	2026/09/20
3 4 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,500,000	3,521,595	2026/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
9 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,300,000	1,537,276	2026/12/20
3 4 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,000,000	3,016,290	2027/03/20
9 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	700,000	824,600	2027/03/20
9 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	800,000	949,648	2027/03/20
3 4 7 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,500,000	3,517,885	2027/06/20
9 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	1,200,000	1,452,348	2027/06/20
3 4 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,500,000	3,516,695	2027/09/20
9 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	1,400,000	1,688,134	2027/09/20
3 4 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	380,000	381,485	2027/12/20
9 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,400,000	1,680,224	2027/12/20
1 0 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	1,300,000	1,578,148	2028/03/20
1 0 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	1,060,000	1,312,852	2028/06/20
1 0 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,300,000	1,574,144	2028/09/20
1 0 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,500,000	1,821,735	2028/12/20
1 0 9 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,600,000	1,913,712	2029/03/20
1 1 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	1,170,000	1,442,247	2029/06/20
1 回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	100,000	130,639	2029/09/20
1 1 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,500,000	1,837,440	2029/09/20
1 1 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,500,000	1,842,450	2029/12/20
2 回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	126,621	2030/02/20
1 1 6 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	1,600,000	1,989,408	2030/03/20
1 1 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	210,000	258,617	2030/03/20
3 回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	251,440	2030/05/20
1 1 8 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	1,000,000	1,221,910	2030/06/20
1 1 9 回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	900,000	1,077,948	2030/06/20
1 2 1 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,500,000	1,818,780	2030/09/20
4 回 利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	268,016	2030/11/20
1 2 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,700,000	2,108,340	2030/12/20
1 2 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	1,410,000	1,770,776	2031/03/20
5 回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	200,000	251,648	2031/05/20
1 2 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	700,000	854,056	2031/06/20
1 2 9 回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	700,000	844,970	2031/06/20
1 3 0 回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,500,000	1,812,765	2031/09/20
6 回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	257,880	2031/11/20
1 3 2 回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,600,000	1,914,208	2031/12/20
1 3 3 回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	180,000	217,760	2031/12/20
1 3 4 回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	900,000	1,090,575	2032/03/20
1 3 5 回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	800,000	958,504	2032/03/20
7 回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	300,000	384,915	2032/05/20
1 3 7 回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,130,000	1,355,875	2032/06/20
1 3 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	100,000	117,142	2032/06/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,600,000	1,922,544	2032/09/20
8 回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	200,000	243,274	2032/11/22
1 4 1 回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,650,000	1,985,263	2032/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)				
1 4 2回 利付国庫債券(20年)	1.8000	250,000	304,362	2032/12/20
1 4 3回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,720,000	2,045,699	2033/03/20
1 4 4回 利付国庫債券(20年)	1.5000	260,000	305,474	2033/03/20
1 1回 利付国庫債券(30年)	1.7000	400,000	482,120	2033/06/20
1 4 5回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,400,000	1,687,420	2033/06/20
1 2回 利付国庫債券(30年)	2.1000	300,000	379,866	2033/09/20
1 4 6回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,400,000	1,688,162	2033/09/20
1 3回 利付国庫債券(30年)	2.0000	300,000	375,702	2033/12/20
1 4 7回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,700,000	2,025,006	2033/12/20
1 4回 利付国庫債券(30年)	2.4000	500,000	658,110	2034/03/20
1 4 8回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,300,000	1,528,852	2034/03/20
1 5回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	267,078	2034/06/20
1 4 9回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,900,000	2,235,977	2034/06/20
1 6回 利付国庫債券(30年)	2.5000	400,000	535,276	2034/09/20
1 5 0回 利付国庫債券(20年)	1.4000	1,500,000	1,741,515	2034/09/20
1 7回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	264,572	2034/12/20
1 5 1回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,800,000	2,032,002	2034/12/20
1 8回 利付国庫債券(30年)	2.3000	820,000	1,073,478	2035/03/20
1 5 2回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,300,000	1,466,335	2035/03/20
1 9回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	262,254	2035/06/20
1 5 3回 利付国庫債券(20年)	1.3000	1,700,000	1,944,936	2035/06/20
2 0回 利付国庫債券(30年)	2.5000	300,000	404,205	2035/09/20
1 5 4回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,500,000	1,690,275	2035/09/20
2 1回 利付国庫債券(30年)	2.3000	300,000	394,263	2035/12/20
1 5 5回 利付国庫債券(20年)	1.0000	1,600,000	1,746,768	2035/12/20
2 2回 利付国庫債券(30年)	2.5000	470,000	634,871	2036/03/20
1 5 6回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,500,000	1,480,020	2036/03/20
2 3回 利付国庫債券(30年)	2.5000	600,000	811,818	2036/06/20
1 5 7回 利付国庫債券(20年)	0.2000	1,300,000	1,234,480	2036/06/20
2 4回 利付国庫債券(30年)	2.5000	300,000	406,557	2036/09/20
1 5 8回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,500,000	1,500,000	2036/09/20
2 5回 利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	528,524	2036/12/20
1 5 9回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,500,000	1,523,205	2036/12/20
2 6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	700,000	938,287	2037/03/20
1 6 0回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,300,000	1,340,625	2037/03/20
1 6 1回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,380,000	1,394,490	2037/06/20
2 7回 利付国庫債券(30年)	2.5000	700,000	953,211	2037/09/20
1 6 2回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,200,000	1,210,608	2037/09/20
1 6 3回 利付国庫債券(20年)	0.6000	810,000	815,783	2037/12/20
2 8回 利付国庫債券(30年)	2.5000	900,000	1,229,697	2038/03/20
2 9回 利付国庫債券(30年)	2.4000	900,000	1,216,971	2038/09/20
3 0回 利付国庫債券(30年)	2.3000	900,000	1,202,148	2039/03/20
3 1回 利付国庫債券(30年)	2.2000	900,000	1,187,748	2039/09/20
3 2回 利付国庫債券(30年)	2.3000	1,100,000	1,479,126	2040/03/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)				
3 3回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,300,000	1,672,060	2040/09/20
3 4回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,599,072	2041/03/20
3 5回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,300,000	1,679,600	2041/09/20
3 6回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,300,000	1,683,032	2042/03/20
3 7回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,400,000	1,786,190	2042/09/20
3 8回 利付国庫債券(30年)	1.8000	900,000	1,129,338	2043/03/20
3 9回 利付国庫債券(30年)	1.9000	800,000	1,023,120	2043/06/20
4 0回 利付国庫債券(30年)	1.8000	610,000	766,440	2043/09/20
4 1回 利付国庫債券(30年)	1.7000	800,000	986,936	2043/12/20
4 2回 利付国庫債券(30年)	1.7000	800,000	987,360	2044/03/20
4 3回 利付国庫債券(30年)	1.7000	800,000	987,792	2044/06/20
4 4回 利付国庫債券(30年)	1.7000	800,000	988,208	2044/09/20
4 5回 利付国庫債券(30年)	1.5000	750,000	890,602	2044/12/20
4 6回 利付国庫債券(30年)	1.5000	900,000	1,068,804	2045/03/20
4 7回 利付国庫債券(30年)	1.6000	1,000,000	1,212,090	2045/06/20
4 8回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,100,000	1,279,542	2045/09/20
4 9回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,100,000	1,279,410	2045/12/20
5 0回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,000,000	1,011,600	2046/03/20
5 1回 利付国庫債券(30年)	0.3000	1,100,000	970,695	2046/06/20
5 2回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,100,000	1,025,596	2046/09/20
5 3回 利付国庫債券(30年)	0.6000	820,000	784,321	2046/12/20
5 4回 利付国庫債券(30年)	0.8000	900,000	906,408	2047/03/20
5 5回 利付国庫債券(30年)	0.8000	800,000	804,776	2047/06/20
5 6回 利付国庫債券(30年)	0.8000	900,000	904,320	2047/09/20
5 7回 利付国庫債券(30年)	0.8000	630,000	632,280	2047/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	600,000	830,844	2049/03/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	600,000	834,726	2050/03/20
4回 利付国庫債券(40年)	2.2000	800,000	1,117,872	2051/03/20
5回 利付国庫債券(40年)	2.0000	700,000	940,086	2052/03/20
6回 利付国庫債券(40年)	1.9000	700,000	921,046	2053/03/20
7回 利付国庫債券(40年)	1.7000	800,000	1,004,432	2054/03/20
8回 利付国庫債券(40年)	1.4000	900,000	1,045,476	2055/03/20
9回 利付国庫債券(40年)	0.4000	1,300,000	1,089,361	2056/03/20
10回 利付国庫債券(40年)	0.9000	900,000	894,825	2057/03/20
小計	-	272,520,000	298,367,587	-
(地方債証券)				
2 1年度4回 埼玉県公募公債	1.4600	200,000	204,150	2019/07/29
2 1年度3回 福岡県公募公債	1.5500	200,000	204,652	2019/08/27
2 1年度6回 北海道公募公債	1.6000	200,000	204,814	2019/08/28
1 6 6回 神奈川県公募公債	1.3600	300,000	306,366	2019/09/20
2 1年度6回 千葉県公募公債	1.4100	200,000	204,442	2019/09/25
2 1年度5回 静岡県公募公債	1.3500	197,000	201,347	2019/10/18
8 0回 共同発行市場公募地方債	1.5400	200,000	205,364	2019/11/25
2 1年度2回 北九州市公募公債	1.3600	200,000	204,934	2019/12/24

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)				
6 8 0 回 東京都公募公債	1.3900	200,000	205,682	2020/03/19
3 3 6 回 大阪府公募公債	1.4600	200,000	206,064	2020/03/30
2 2 年度1回 広島県公募公債	1.3700	200,000	206,122	2020/05/27
6 8 5 回 東京都公募公債	1.1300	500,000	512,940	2020/06/19
2回 川崎市公募公債 15年	1.6300	100,000	103,772	2020/06/22
2 2 年度6回 愛知県公募公債	1.1780	200,000	205,658	2020/07/30
2 2 年度8回 静岡県公募公債	1.0590	200,000	205,220	2020/08/25
6 8 8 回 東京都公募公債	0.9400	200,000	204,738	2020/09/18
2 2 年度3回 横浜市公募公債	1.1680	200,000	205,920	2020/09/18
2 2 年度5回 横浜市公募公債	1.2650	200,000	206,992	2020/12/11
3 4 5 回 大阪府公募公債	1.2600	300,000	310,587	2020/12/25
9 4 回 共同発行市場公募地方債	1.2400	100,000	103,575	2021/01/25
2 2 年度12回 北海道公募公債	1.2900	200,000	207,466	2021/01/28
2 3 年度1回 千葉市公募公債	1.3700	200,000	208,548	2021/04/21
2 3 年度2回 埼玉県公募公債	1.1900	200,000	207,620	2021/05/25
6 9 7 回 東京都公募公債	1.1100	500,000	518,100	2021/06/18
9 9 回 共同発行市場公募地方債	1.1700	700,000	726,894	2021/06/25
7 0 1 回 東京都公募公債	0.9900	700,000	724,220	2021/09/17
2 3 年度4回 横浜市公募公債	1.0450	450,000	467,077	2021/11/12
2 3 年度9回 静岡県公募公債	1.0450	200,000	207,662	2021/11/25
3 5 6 回 大阪府公募公債	1.0600	200,000	207,876	2021/12/27
1 0 6 回 共同発行市場公募地方債	0.9700	300,000	311,052	2022/01/25
2 3 年度20回 愛知県公募公債	1.0820	500,000	521,520	2022/03/29
1 0 9 回 共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	521,240	2022/04/25
7 0 8 回 東京都公募公債	0.8900	500,000	518,655	2022/06/20
1 1 1 回 共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	725,872	2022/06/24
3 6 4 回 大阪府公募公債	0.7900	300,000	310,152	2022/09/27
1 9 4 回 神奈川県公募公債	0.7910	300,000	310,821	2022/12/20
2 4 年度7回 千葉県公募公債	0.7400	300,000	310,092	2022/12/22
1 1 9 回 共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	518,800	2023/02/24
1 2 1 回 共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	513,325	2023/04/25
2 5 年度4回 愛知県公募公債	0.8560	300,000	312,585	2023/05/30
7 2 0 回 東京都公募公債	0.8700	300,000	313,110	2023/06/20
2 5 年度4回 札幌市公募公債	0.8000	200,000	207,884	2023/06/20
2 5 年度2回 横浜市公募公債	0.8880	400,000	417,860	2023/07/14
3 7 4 回 大阪府公募公債	0.9380	300,000	314,049	2023/07/28
2 5 年度5回 千葉県公募公債	0.8400	200,000	208,532	2023/08/25
1 2 6 回 共同発行市場公募地方債	0.8100	793,900	826,727	2023/09/25
1 2 7 回 共同発行市場公募地方債	0.6800	500,000	517,300	2023/10/25
1 2 8 回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	310,101	2023/11/24
7 2 6 回 東京都公募公債	0.7300	400,000	415,512	2023/12/20
2 5 年度11回 福岡県公募公債	0.6940	200,000	207,312	2024/02/26
2 0 8 回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	308,724	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	318,960	2024/06/26

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)				
2 6 年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	413,364	2024/07/29
1 3 7 回 共同発行市場公募地方債	0.5660	500,000	515,255	2024/08/23
4 8 8 回 名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	464,836	2024/09/20
1 3 9 回 共同発行市場公募地方債	0.5440	500,000	514,755	2024/10/25
2 6 年度11回 京都府公募公債	0.4760	350,000	358,942	2024/12/19
1 4 2 回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	508,265	2025/01/24
2 6 年度17回 兵庫県公募公債	0.4600	200,000	204,812	2025/02/26
5 回 東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	114,229	2025/03/19
1 4 4 回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	410,296	2025/03/25
1 4 6 回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	412,624	2025/05/23
1 4 8 回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	515,395	2025/07/25
1 回 静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	115,370	2025/09/19
9 回 東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	238,022	2026/06/19
1 0 回 東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	355,614	2026/09/18
4 回 京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	119,862	2026/09/18
1 6 6 回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	499,560	2027/01/25
小計	-	22,040,900	22,890,191	-
(特殊債券)				
4 8 回 高速道路機構債	1.7100	700,000	713,048	2019/03/20
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	700,000	712,068	2019/04/30
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	1.5000	651,000	663,661	2019/05/24
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.5000	100,000	102,092	2019/06/28
3 回 政保地方公共団体金融機関債券	1.5000	101,000	103,319	2019/08/16
3 7 回 住宅金融支援機構債券	1.4000	300,000	306,687	2019/09/20
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	300,000	306,480	2019/09/30
5 回 地方公共団体金融機関債券	1.3950	500,000	511,815	2019/10/28
8 回 政保地方公共団体金融機関債券	1.3000	300,000	307,704	2020/01/20
1 0 回 政保地方公共団体金融機関債券	1.3000	500,000	513,795	2020/03/13
1 5 回 政保地方公共団体金融機関債券	1.0000	200,000	205,170	2020/08/14
2 0 回 政保地方公共団体金融機関債券	1.2000	300,000	310,869	2021/01/20
9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	100,000	106,023	2021/03/26
2 4 回 地方公共団体金融機関債券	1.2080	300,000	311,637	2021/05/28
1 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.2000	300,000	323,646	2021/08/30
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	400,000	415,560	2021/11/30
3 6 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.9010	300,000	311,712	2022/05/20
9 6 回 高速道路機構債	0.7960	700,000	723,779	2022/09/20
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.7340	1,000,000	1,036,230	2022/12/28
4 4 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.8340	400,000	416,548	2023/01/20
5 5 回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	519,060	2023/03/20
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	513,935	2023/04/28
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	523,410	2023/06/30
5 0 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.9110	500,000	524,215	2023/07/14
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	346,120	2023/07/31
1 1 6 回 高速道路機構債	0.7220	100,000	103,404	2023/09/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券)				
5 6回 政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	565,018	2024/01/19
6 4回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	309,816	2024/09/13
2 4 1回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	513,825	2025/03/31
3 0 9回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	800,360	2027/04/30
1 3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.9600	21,292	22,053	2032/05/10
1 4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7000	107,395	110,606	2032/05/10
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8200	31,908	32,203	2036/12/10
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.2600	48,447	51,329	2037/05/10
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.1500	34,120	36,133	2037/05/10
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.1900	51,051	54,067	2037/05/10
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.2700	53,952	57,532	2037/11/10
4 3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	18,246	19,418	2041/06/10
4 4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	69,000	73,245	2041/07/10
5 1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	51,321	54,296	2042/02/10
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	89,180	93,934	2042/05/10
2 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	179,215	192,252	2044/10/10
3 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	317,256	336,548	2045/05/10
小計	—	13,796,383	14,254,630	—
(金融債券)				
2 9 3回 利附信金中金債	0.2500	400,000	400,976	2019/04/26
い第7 6 9号 利付商工債	0.2500	200,000	200,408	2019/06/27
3 0 2回 利附信金中金債	0.2000	300,000	300,900	2020/01/27
い第7 7 9号 利付商工債	0.2200	200,000	200,448	2020/04/27
3 2 5回 利附信金中金債	0.0400	400,000	399,236	2021/12/27
小計	—	1,500,000	1,501,968	—
(普通社債券)				
1 5回 東海旅客鉄道社債	2.1900	200,000	204,742	2019/03/20
4 9 2回 関西電力社債	0.6090	200,000	201,264	2019/03/20
4 9 3回 関西電力社債	0.5840	200,000	201,394	2019/05/24
7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	2.5000	100,000	103,084	2019/06/03
4回 りそな銀行劣後社債	2.7660	100,000	103,510	2019/06/20
2 0回 三井住友銀行劣後社債	2.2100	200,000	205,998	2019/07/24
9 6回 三菱地所社債	1.6200	200,000	204,254	2019/07/29
1 6 4回 オリックス社債	1.1460	100,000	101,465	2019/08/07
4 2 3回 九州電力社債	0.9590	200,000	202,908	2019/09/25
8回 プリヂストン社債	0.2490	200,000	200,636	2019/09/26
1 4回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.1400	200,000	206,512	2019/09/27
4 1回 住友化学社債	1.6400	100,000	102,510	2019/10/18
7回 キリンホールディングス社債	1.6390	100,000	102,635	2019/11/05
7回 東京三菱銀行劣後社債	2.1100	200,000	207,310	2019/12/20
4 6回 野村ホールディングス社債	0.3460	200,000	200,888	2019/12/25
5回 東海旅客鉄道社債	2.6000	100,000	105,026	2020/01/28
6回 りそな銀行劣後社債	2.0840	100,000	103,946	2020/03/04
3 0回 豊田自動織機社債	0.0010	200,000	199,732	2020/03/19

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)				
1 2回 パナソニック社債	0.3870	200,000	201,146	2020/03/19
5 6回 曰産自動車社債	0.5540	100,000	100,879	2020/03/19
3 8回 三井不動産社債	1.4970	200,000	205,690	2020/03/19
8 7回 住友不動産社債	0.8770	100,000	101,320	2020/03/19
27回 ラボバンク・ネーランド円貯社債	0.3800	200,000	200,966	2020/05/22
2 6 0回 北陸電力社債	2.3300	100,000	105,140	2020/05/25
1 4回 大和証券グループ本社社債	1.2520	100,000	102,416	2020/05/27
7回 三菱UFJ F 信託銀行劣後債	1.5900	200,000	206,672	2020/06/08
4 2回 野村ホールディングス社債	1.2140	200,000	205,028	2020/06/19
9回 日本たばこ産業社債	0.2170	200,000	200,636	2020/07/15
4 9 6回 中部電力社債	1.2270	500,000	514,520	2020/07/24
1 5回 トヨタファイナンス社債	1.8000	200,000	208,398	2020/08/21
1 5回 東日本旅客鉄道社債	2.6500	300,000	319,839	2020/08/25
2 2回 中日本高速道路債券	1.0360	300,000	307,935	2020/09/18
2 6回 野村ホールディングス社債	1.5470	100,000	103,622	2020/09/24
2 2回 三井住友銀行劣後社債	1.4300	200,000	206,718	2020/09/28
1 2回 住友信託銀行劣後債	1.3730	100,000	103,329	2020/11/11
2 5回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.3100	200,000	206,392	2020/11/12
2 3回 三井住友銀行劣後社債	1.6100	400,000	416,588	2020/12/17
6 0回 日本電信電話社債	1.3100	300,000	309,888	2020/12/18
2 8回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.5600	200,000	208,290	2021/01/20
3 7 9回 中国電力社債	0.6190	300,000	304,794	2021/01/25
3 3 7回 東京交通債	2.2300	200,000	213,352	2021/03/19
4 7 3回 東北電力社債	0.5970	300,000	304,542	2021/04/23
9回 三菱UFJ F 信託銀行劣後債	1.6800	100,000	104,630	2021/04/28
3 2回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.6200	300,000	313,821	2021/06/09
3 2 0回 北海道電力社債	0.5850	200,000	202,950	2021/12/24
6回 東海旅客鉄道社債	2.3900	100,000	109,216	2022/02/15
1 9回 東日本旅客鉄道社債	2.3600	100,000	109,159	2022/02/25
1 3回 パナソニック社債	0.5680	100,000	101,463	2022/03/18
9回 西日本旅客鉄道社債	2.2800	200,000	218,008	2022/03/25
4 5回 住友商事社債	1.1170	100,000	103,513	2022/04/20
23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	0.0900	100,000	99,611	2022/05/23
2 1回 東日本旅客鉄道社債	2.0200	100,000	108,835	2022/09/20
9 4回 丸紅社債	1.1700	100,000	103,942	2022/10/12
5 7回 東京三菱銀行社債	2.2200	200,000	219,774	2022/10/27
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.4760	100,000	101,281	2022/12/02
1 1回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	315,114	2022/12/20
1 8回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	106,530	2022/12/20
5 1 8回 中部電力社債	0.1900	200,000	199,902	2023/01/25
1 4回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	208,322	2023/03/20
1 0回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	103,191	2023/03/20
4 7回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	205,800	2023/03/20
3 0 1回 北陸電力社債	1.1580	100,000	104,813	2023/03/24

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

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

■投資信託財産の構成

2018年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 353,884,946	% 99.5
コ ー ル・ロ ー ン 等、そ の 他	1,950,867	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	355,835,814	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年2月14日)現在

項	目	当期末	
(A) 資 公 未 未 前	一 ル 社 収 取 払	産 等 債(評価額) 金 利 費 用 債 金 額(A-B) 本 金 数	355,835,814,093円 723,783,711 353,884,946,962 199,594,000 1,015,781,908 11,707,512 237,394,000 237,394,000 355,598,420,093 276,633,033,886 78,965,386,207 276,633,033,886 12,855円
(B) 負 未 未 前	負 未 支 付 解 約		
(C) 純 元 次 期	資 産 総 額(A-B)		
(D) 受 益 1 万 口	期 緑 越 損 益 当 た り 基 準 価 額(C/D)		

(注1) 期首元本額 298,304,698,655円
追加設定元本額 61,223,285,988円
一部解約元本額 82,894,950,757円

(注2) 期末における元本の内訳

D IAM国内債券パッシブ・ファンド	14,116,833,140円	D IAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,123,528円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	133,630,997円	D IAMコア資産設計ファンド (積極型)	3,353,398円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	112,094,157円	投資のソムリエ <DC年金>リスク抑制型	434,974,042円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	35,282,821円	ダイナミック・ナビゲーション	380,004円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	665,817,907円	リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,614,557,421円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	184,767,471円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	565,325円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	24,853,650円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	440,751円
たわらノーロード 国内債券	2,968,219,816円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,068,108円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	754,493円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,020,092円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	25,609,291円	D IAM高金利通貨ファンド	9,608,918円
たわらノーロード バランス (堅実型)	2,414,859円	D IAM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 (標準型)	5,744,028円	D IAM国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	22,731,156,124円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,631,224円	D IAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	502,624,028円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	425,258円	D IAMグローバル・バランスファンド25VA	346,262,404円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	2,589,498円	D IAMグローバル・バランスファンド50VA	253,519,385円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	2,580,489円	D IAM国際分散バランスファンド30VA	81,923,429円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	1,033,708円	D IAM国際分散バランスファンド50VA	228,604,695円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	377,393円	D IAM国内重視バランスファンド30VA	107,194,692円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,015,094円	D IAM国内重視バランスファンド50VA	71,342,812円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	362,556円	D IAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	102,762,022円
たわらノーロード 最適化バランス (安成型)	1,451,139円	D IAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	187,679,096円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	435,024円	D IAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	6,207,940,745円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	60,048円	D IAMバランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	3,299,932,044円
D IAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,448,553,792円	D IAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	6,033,889,655円
D IAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	5,551,782,165円	D IAMグローバル・アセット・バランスFA	656,691,706円
D IAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	8,107,081,815円	D IAMグローバル・アセット・バランスFA (適格機関投資家限定)	526,941,764円
D IAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	3,297,729,018円	D IAMグローバル・アセット・バランスFA (適格機関投資家限定)	3,870,676,474円
D IAM DC バランス30インデックスファンド	1,833,417,110円	D IAM世界アセットバランスファンド30VA (適格機関投資家向け)	3,673,885,281円
D IAM DC バランス50インデックスファンド	2,030,565,460円	D IAMグローバルB私募ファンド (適格機関投資家向け)	194,752,933円
D IAM DC バランス70インデックスファンド	317,189,866円	D IAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	255,064,334円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	88,286,247円	D IAM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	1,991,218,383円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,216,731,348円	D IAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	86,966,102,044円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,224,336円	D IAM世界アセットバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,171,879,785円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	479,856,497円	D IAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	7,472,417,416円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	434,763,343円	D IAM世界アセットバランス30VA (適格機関投資家限定)	28,388,504,435円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	101,361,917円	D IAMバランス30VA (適格機関投資家限定)	8,994,522円
投資のソムリエ	3,477,837,094円	D IAMバランス50VA (適格機関投資家限定)	49,160,062円
クレーズコントロール	444,343,713円	D IAMバランス70VA (適格機関投資家限定)	8,006,452円
投資のソムリエ<DC年金>	239,353,124円	D IAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	31,576,808,335円
D IAM 8資産バランスファンド<DC年金>	1,836,639,342円	D IAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	505,478,572円
D IAM DC バランス・F (成長型)	235,119,855円	D IAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	138,815,886円
クレーズコントロール<DC年金>	165,091円	D IAMバランス20VA (適格機関投資家限定)	395,041,757円
		D IAMバランス40VA (適格機関投資家限定)	118,842,206円
		D IAMバランス60VA (適格機関投資家限定)	393,617円
		期末元本合計	276,633,033,886円

■損益の状況

当期　自2017年2月15日 至2018年2月14日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2018年2月15日）
 (計算期間 2017年2月16日～2018年2月15日)

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	MSCIコクサイ・インデックス (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	純資産総額
		期騰落率	中率			
12期(2014年2月17日)	円 22,679	% 31.2	ポイント 722,183.69	% 31.4	% 95.0	% 3.0 百万円 311,562
13期(2015年2月16日)	28,826	27.1	920,295.73	27.4	94.1	3.4 319,197
14期(2016年2月15日)	23,909	△17.1	764,772.48	△16.9	96.1	1.2 242,694
15期(2017年2月15日)	30,270	26.6	971,437.64	27.0	95.6	1.7 278,963
16期(2018年2月15日)	33,302	10.0	1,070,930.74	10.2	95.7	2.2 284,448

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しております、また、MSCI Inc. は同指標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
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017 年 2 月 15 日	円 30,270	% —	ポイント 971,437.64	% —	% 95.6 1.7
2 月 末	30,024	△0.8	965,055.42	△0.7	95.1 2.3
3 月 末	30,317	0.2	974,738.81	0.3	95.2 2.1
4 月 末	30,529	0.9	980,526.27	0.9	95.8 1.5
5 月 末	30,996	2.4	996,447.74	2.6	93.9 3.4
6 月 末	31,483	4.0	1,011,833.79	4.2	95.4 2.0
7 月 末	31,724	4.8	1,020,073.85	5.0	95.5 1.8
8 月 末	31,604	4.4	1,016,768.62	4.7	94.1 3.4
9 月 末	33,074	9.3	1,063,690.07	9.5	95.6 2.0
10 月 末	33,840	11.8	1,088,210.90	12.0	94.5 3.1
11 月 末	34,071	12.6	1,096,331.27	12.9	95.3 2.2
12 月 末	35,129	16.1	1,130,329.13	16.4	94.7 2.8
2018 年 1 月 末	35,522	17.4	1,143,342.43	17.7	94.7 3.0
(期 末) 2018 年 2 月 15 日	33,302	10.0	1,070,930.74	10.2	95.7 2.2

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、賃建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年2月16日から2018年2月15日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は33,302円となり、前期末比で10.0%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	比率
1	銀行	9.6%
2	ソフトウェア・サービス	9.0
3	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.5
4	資本財	7.3
5	エネルギー	7.2
6	食品・飲料・タバコ	5.7
7	素材	5.0
8	各種金融	4.4
9	保険	4.1
10	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.9

(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種はGICS（世界産業分類基準）によるものです。

期末

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で10.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマーク比で△0.2%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

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

■1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 （株式） （先物・オプション） （投資信託受益証券） （投資証券）	1円 (0) (0) (0) (0)	0.003% (0.001) (0.001) (0.000) (0.000)
(b) 有価証券取引税 （株式） （投資信託受益証券） （投資証券）	1 (1) (0) (0)	0.003 (0.003) (0.000) (0.000)
(c) その他費用 （その他）	9 (9)	0.027 (0.027)
合計	11	0.033

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(32,344円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2017年2月16日から2018年2月15日まで）

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外	アメリカ	百株 15,082.96 (2,003.85)	千アメリカ・ドル 75,009 (△4,804)	百株 29,880.47	千アメリカ・ドル 177,121
	カナダ	百株 1,956.18 (△299.25)	千カナダ・ドル 7,902 (-)	百株 3,578.36	千カナダ・ドル 11,994
	オーストラリア	百株 2,308.92 (△98.59)	千オーストラリア・ドル 3,878 (△29)	百株 7,643.47	千オーストラリア・ドル 8,517
	香港	百株 8,233 (2,715.49)	千香港・ドル 14,512 (-)	百株 7,383.19	千香港・ドル 22,229
	シンガポール	百株 2,398 (-)	千シンガポール・ドル 845 (-)	百株 4,450	千シンガポール・ドル 1,939
	ニュージーランド	百株 372.49 (-)	千ニュージーランド・ドル 487 (-)	百株 505.38	千ニュージーランド・ドル 173
	イギリス	百株 14,020.83 (149,367.08)	千イギリス・ポンド 8,322 (△190)	百株 171,520	千イギリス・ポンド 12,513
	イスラエル	百株 -	千イスラエル・シュケル -	百株 228.12	千イスラエル・シュケル 881
	スイス	百株 1,074.1 (1,596.59)	千スイス・フラン 5,054 (△488)	百株 2,978.46	千スイス・フラン 12,864
	デンマーク	百株 235.24 (-)	千デンマーク・クローネ 7,739 (-)	百株 309.93	千デンマーク・クローネ 10,644
国	ノルウェー	百株 -	千ノルウェー・クローネ -	百株 194.51	千ノルウェー・クローネ 4,127
	スウェーデン	百株 625.32 (779.26)	千スウェーデン・クローナ 12,234 (-)	百株 2,198.05	千スウェーデン・クローナ 27,900
	イギリス	百株 160.9 (-)	千ユーロ 529 (-)	百株 338.3	千ユーロ 1,062
	アイルランド	百株 589.78 (△21,253.5)	千ユーロ 485 (-)	百株 99.22	千ユーロ 316
	オランダ	百株 565.17 (-)	千ユーロ 1,526 (△5)	百株 1,459.05	千ユーロ 2,525
	ベルギー	百株 57.81 (76.6)	千ユーロ 407 (-)	百株 122.62	千ユーロ 869
	ルクセンブルグ	百株 74.76 (△871.65)	千ユーロ 167 (-)	百株 175.32	千ユーロ 331
口	フランス	百株 1,125.14 (206.47)	千ユーロ 5,171 (△769)	百株 1,584.94	千ユーロ 7,005
	ドイツ	百株 1,510.06 (1,156.1)	千ユーロ 5,721 (△325)	百株 2,529.34	千ユーロ 7,553

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国 口 引	スイズ	百株 ー (-)	千ユーロ ー (-)	百株 141.05	千ユーロ 743
	ポルトガル	百株 ー (-)	千ユーロ ー (-)	百株 387.2	千ユーロ 106
	スペイン	百株 3,070.29 (34,774.01)	千ユーロ 2,340 (-)	百株 44,463.72	千ユーロ 3,627
	イタリア	百株 3,358.28 (△4,157.83)	千ユーロ 2,527 (-)	百株 2,965.89	千ユーロ 1,732
	フィンランド	百株 31.13 (-)	千ユーロ 138 (-)	百株 469.02	千ユーロ 787
	オーストリア	百株 ー (-)	千ユーロ ー (△23)	百株 25.7	千ユーロ 103

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,717 (-)	207 (-)	ー (-)	ー (-)
SL GREEN	1,861 (-)	190 (-)	4,201 (-)	429 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,051 (-)	197 (-)	1,6 (-)	277 (-)
EQUINIX INC	0.512 (-)	230 (-)	0.305 (-)	131 (-)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	6,724 (-)	675 (-)	3,675 (-)	367 (-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	ー (-)	ー (-)	0.759 (-)	175 (-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,525 (-)	202 (-)	3,122 (-)	390 (-)
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,418 (-)	217 (-)	2,405 (-)	374 (-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	ー (-)	ー (-)	6,999 (-)	126 (-)
REALTY INCOME CORP	4,459 (-)	256 (-)	5,521 (-)	285 (-)
REGENCY CENTERS CORP	3,929 (-)	276 (-)	ー (-)	ー (-)
UDR INC	ー (-)	ー (-)	4,339 (-)	157 (-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	ー (-)	ー (-)	1,691 (-)	265 (-)
VENTAS INC	ー (-)	ー (-)	1.99 (-)	133 (-)
VORNADO REALTY TRUST	ー (-)	ー (-)	ー (-)	ー (-)
WEYERHAEUSER CO	5,644 (-)	184 (-)	10,713 (-)	360 (-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	ー (-)	ー (-)	1,839 (-)	140 (-)

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,331 (-)	404 (-)	- (-)	- (-)
VEREIT INC	12,775 (-)	115 (-)	- (-)	- (-)
AMERICAN TOWER CORP	- (-)	- (-)	0.972 (-)	125 (-)
JBG SMITH PROPERTIES	(6,105)	- (-)	6.105 (-)	213 (-)
INVITATION HOMES INC	22,567 (-)	523 (-)	- (-)	- (-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	(0.728)	- (19)	0.728 (-)	19 (-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
STOCKLAND	- (-)	- (-)	66.82 (-)	314 (-)
GOODMAN GROUP	- (-)	- (-)	22,008 (-)	184 (-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
ASCENDAS REAL ESTATE INV'T	- (-)	- (△1)	- (-)	- (-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	203.5 (-)	347 (12)	414.5 (-)	685 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	- (-)	- (△2)	- (-)	- (-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST-RTS	(44.753)	- (△12)	44,753 (-)	11 (-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
LAND SECURITIES GROUP PLC	14,763 (△4,081)	149 (△39)	35,939 (-)	350 (-)
INTU PROPERTIES PLC	- (-)	- (-)	74,712 (-)	146 (-)
SEGRO PLC	10.185 (-)	46 (-)	- (-)	- (-)
SEGRO PLC-RTS	(10.185)	- (-)	10,185 (-)	11 (-)
ユーロ(フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	0.458 (-)	58 (-)	- (-)	- (-)
FONCIERE DES REGIONS	- (-)	- (△2)	- (-)	- (-)
GECINA SA-RTS	(3,212)	- (-)	3,212 (-)	8 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国株式先物取引	百万円 77,196	百万円 76,328	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	43,644,879千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	273,628,164千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.15

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2017年2月16日から2018年2月15日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘 柏	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
			外 貨 建 金 額			
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMAZON.COM INC	300.84	288.29	41,832	4,470,201		インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,279.14	1,226.02	7,145	763,540		ヘルスケア機器・用品
AES CORP	455.79	455.79	468	50,020		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
INTL BUSINESS MACHINES CORP	679.24	623.73	9,652	1,031,503		情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	—	595.29	726	77,607		半導体・半導体製造装置
ADOBE SYSTEMS INC	376.84	351.38	6,926	740,192		ソフトウェア
CHUBB LTD	348.45	327.73	4,827	515,827		保険
AGCO CORP	56.1	56.1	384	41,130		機械
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	156.71	150.19	2,422	258,827		化学
ALLEGHANY CORP	10.54	10.54	619	66,236		保険
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	652.07	—	—	—		化学
RALPH LAUREN CORP	47.03	34.97	373	39,865		繊維・アパレル・贅沢品
ALLSTATE CORP	273.16	257.54	2,447	261,529		保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	538.83	514.41	7,735	826,636		コングロマリット
AMGEN INC	556.7	515.12	9,247	988,180		バイオテクノロジー
HESS CORP	204.21	204.21	926	99,005		石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	583.49	535.81	5,156	550,980		消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	369.6	348.59	2,276	243,244		電力
AFLAC INC	306.73	282.18	2,473	264,297		保険
AMERICAN INTL GROUP	795.35	634.48	3,769	402,802		保険
AMERCO	5.51	5.51	195	20,931		陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	230.69	258.69	2,202	235,330		半導体・半導体製造装置
ANADARKO PETROLEUM CORP	410.03	387.91	2,318	247,800		石油・ガス・消耗燃料
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	172.66	160.15	1,973	210,839		バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	688.62	645.78	2,422	258,849		建設関連製品
TIME WARNER	579.64	545.67	5,157	551,148		メディア
JONES LANG LASALLE INC	38.15	28.18	449	48,078		不動産管理・開発
VALERO ENERGY CORP	354.05	321.05	2,973	317,789		石油・ガス・消耗燃料
APACHE CORP	283.09	250.25	955	102,153		石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	56.19	56.19	886	94,690		ソフトウェア
APPLE INC	4,022.14	3,645.93	61,021	6,520,803		コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	829	753.04	3,912	418,121		半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	79.04	79.04	883	94,361		化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	444.21	383.03	1,601	171,171		食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	78.31	78.31	595	63,673		電力
AMEREN CORP	173.12	173.12	946	101,155		総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	74.03	57.56	461	49,323		電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	61.97	61.97	899	96,119		自動車部品
AUTODESK INC	142.59	142.59	1,567	167,486		ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	342.27	312.05	3,517	375,838		情報技術サービス
AUTOZONE INC	22.29	20.15	1,452	155,213		専門小売り
AVERY DENNISON CORP	73.68	62.62	739	79,040		容器・包装
AVNET INC	102.88	102.88	431	46,063		電子装置・機器・部品
BAKER HUGHES INC	309.16	—	—	—		エネルギー設備・サービス
BALL CORP	121.62	243.24	927	99,083		容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	912.51	897.17	17,991	1,922,608		各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	791.07	737.49	4,128	441,168		資本市場
CR BARD INC	53.09	—	—	—		ヘルスケア機器・用品
BAXTER INTERNATIONAL INC	376.87	348.76	2,302	246,083		ヘルスケア機器・用品
BED BATH & BEYOND INC	107.44	—	—	—		専門小売り
BECTON DICKINSON & CO	158.08	185.86	4,087	436,842		ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	167.75	167.75	1,253	133,923		電気設備
BE AEROSPACE INC	82.29	—	—	—		航空宇宙・防衛
VERIZON COMM INC	3,050.99	2,874.66	14,232	1,520,878		各種電気通信サービス

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	349.22	264.63	589	62,947		半導体・半導体製造装置
3M CO	452.18	424.07	9,838	1,051,333		コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	47.59	40.42	1,024	109,493		家庭用耐久財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	111.5	105.82	1,111	118,755		通信機器
KANSAS CITY SOUTHERN	87.89	72.47	770	82,382		陸運・鉄道
MURPHY OIL CORPORATION	124.43	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
ENDO INTERNATIONAL PLC	165.87	—	—	—		医薬品
MYLAN NV	347.54	313.44	1,295	138,465		医薬品
ILLUMINA INC	112.55	104.53	2,332	249,215		ライフサイエンス・ツール／サービス
XCEL ENERGY INC	375.54	375.54	1,623	173,442		電力
NATIONAL OILWELL VARCO INC	269.38	269.38	946	101,153		エネルギー設備・サービス
NETAPP INC	206.41	183.87	1,114	119,147		コンピュータ・周辺機器
NEWFIELD EXPLORATION CO	137.4	137.4	367	39,246		石油・ガス・消耗燃料
NEWELL BRANDS INC	323.24	362.06	984	105,236		家庭用耐久財
DUN & BRADSTREET CORP	30.12	—	—	—		専門サービス
NEWMONT MINING CORP	380.93	380.93	1,485	158,754		金属・鉱業
NVR INC	—	2.36	722	77,170		家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	998.76	925.05	6,286	671,790		繊維・アパレル・贅沢品
NOBLE ENERGY INC	310.05	310.05	820	87,667		石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	94.87	94.87	477	51,054		複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	226.04	199.73	2,841	303,606		陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	230.85	230.85	1,329	142,041		電力
NISOURCE INC	221.98	221.98	504	53,941		総合公益事業
TAPESTRY INC	191.75	191.75	968	103,456		繊維・アパレル・贅沢品
NORTHERN TRUST CORP	160.9	160.9	1,652	176,562		資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	126.2	115.69	4,044	432,222		航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	3,580.22	3,326.95	19,811	2,117,108		銀行
NUCOR CORP	237.8	237.8	1,550	165,656		金属・鉱業
MONSANTO CO	332.43	308.56	3,708	396,266		化学
CHENIERE ENERGY INC	159.27	159.27	926	99,019		石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	372.94	330.07	3,214	343,471		消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	565.46	541.21	3,780	403,968		石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	38.14	528	56,455		陸運・鉄道
OGE ENERGY CORP	160.28	160.28	493	52,718		電力
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	70.17	63.75	1,578	168,639		専門小売り
ORACLE CORP	2,313.9	2,189.56	10,827	1,157,013		ソフトウェア
PACCAR INC	265.78	244.57	1,690	180,643		機械
EXELON CORP	696.07	699.1	2,558	273,423		電力
PARKER HANNIFIN CORP	99.81	88.08	1,619	173,081		機械
PATTERSON COS INC	71.69	—	—	—		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PAYCHEX INC	231.41	231.41	1,512	161,650		情報技術サービス
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	65.26	65.26	328	35,140		保険
MEDNAX INC	78.24	—	—	—		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	52.55	52.55	1,294	138,332		ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	499.57	456.66	1,382	147,713		電力
PEPSICO INC	1,076.08	1,003.05	10,944	1,169,505		飲料
PENTAIR PLC	117.75	117.75	833	89,098		機械
PFIZER INC	4,536.02	4,197.44	14,770	1,578,406		医薬品
CONOCOPHILLIPS	917.66	861.15	4,780	510,816		石油・ガス・消耗燃料
PVH CORP	66.82	53.87	811	86,728		繊維・アパレル・贅沢品
PG&E CORP	376.51	343.61	1,342	143,494		電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	129.77	121.58	2,182	233,207		石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,460.55	1,359.28	8,859	946,756		タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	364.46	345.38	5,466	584,131		銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	50.1	38.45	449	48,072		レジャー用品
GARMIN LTD	77.95	77.95	498	53,310		家庭用耐久財
AETNA INC	261.11	237.44	4,197	448,515		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
FLUOR CORP (NEW)	98.21	98.21	563	60,208	建設・土木	
PPG INDUSTRIES INC	192.89	176.74	2,055	219,687	化学	
IPG PHOTONICS CORP	—	24.41	616	65,852	電子装置・機器・部品	
PRAXAIR INC	218.68	205.19	3,181	340,015	化学	
COSTCO WHOLESALE CORP	325.74	308.69	5,783	618,004	食品・生活必需品小売り	
T ROWE PRICE GROUP INC	183.04	163.03	1,765	188,708	資本市場	
QUEST DIAGNOSTICS	103.78	103.78	1,053	112,573	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PROCTER & GAMBLE CO	1,914.88	1,799.72	14,520	1,551,622	家庭用品	
PROGRESSIVE CORP	443.58	413.36	2,327	248,686	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	371.15	371.15	1,767	188,866	総合公益事業	
PULTE GROUP INC	254.77	212.09	624	66,767	家庭用耐久財	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	398.7	303.88	420	44,974	貯蓄・抵当・不動産金融	
GLOBAL PAYMENTS INC	107.69	107.69	1,158	123,800	情報技術サービス	
QUALCOMM INC	1,099.93	1,042.28	6,940	741,666	半導体・半導体製造装置	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	101.87	101.87	927	99,082	資本市場	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	35.35	25.5	330	35,312	保険	
REGENERON PHARMACEUTICALS	56.59	56.59	1,871	199,975	バイオテクノロジー	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	46.42	46.42	714	76,380	保険	
AUTONATION INC	57.72	57.72	304	32,523	専門小売り	
RESMED INC	113.76	93.94	878	93,829	ヘルスケア機器・用品	
US BANCORP	1,278.15	1,186.41	6,562	701,218	銀行	
SEATTLE GENETICS INC /WA	73.17	73.17	395	42,269	バイオテクノロジー	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	86.74	86.74	781	83,458	保険	
RITE AID CORP	855.98	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
ROSS STORES INC	305.42	281.89	2,224	237,758	専門小売り	
ROLLINS INC	—	53.57	258	27,592	商業サービス・用品	
ROPER TECHNOLOGIES INC	78.2	69.83	1,893	202,288	コングロマリット	
ROCKWELL AUTOMATION INC	96.67	88.67	1,658	177,272	電気設備	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	135.67	122.93	1,604	171,468	ホテル・レストラン・レジャー	
RAYTHEON COMPANY	219.4	204.63	4,350	464,843	航空宇宙・防衛	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	43.99	38.48	962	102,819	情報技術サービス	
ACCENTURE PLC-CL A	464.33	437.4	6,989	746,867	情報技術サービス	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,153.09	1,064.78	4,574	488,809	食品	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	99.19	88.49	1,409	150,587	保険	
ROCKWELL COLLINS INC	95.35	120.86	1,624	173,630	航空宇宙・防衛	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	212.29	197.55	2,777	296,809	保険	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	230.52	227.18	2,180	233,053	情報技術サービス	
PRICELINE GROUP INC	36.7	34.6	6,291	672,330	インターネット販売・通信販売	
SCHLUMBERGER LTD	1,035.7	984.76	6,486	693,159	エネルギー設備・サービス	
SCHWAB (CHARLES) CORP	880.2	839.88	4,400	470,287	資本市場	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	152.55	141.75	1,668	178,284	ヘルスケア機器・用品	
BUNGE LTD	113.67	103.34	775	82,888	食品	
SEI INVESTMENTS CO	111.07	93.15	679	72,644	資本市場	
ANTHEM INC	195.43	184.48	4,335	463,307	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AMERISOURCEBERGEN CORP	143.48	122.57	1,181	126,263	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	214.42	214.42	1,356	144,970	保険	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	59.58	59.58	2,416	258,272	化学	
CENTENE CORP	138.99	127.13	1,298	138,744	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
SVB FINANCIAL GROUP	—	34.68	858	91,717	銀行	
IAC INTERACTIVE CORP	—	50.5	756	80,806	インターネットソフトウェア・サービス	
SMITH (A.O.) CORP	95.65	95.65	612	65,476	建設関連製品	
ACUITY BRANDS INC	30.87	30.87	468	50,032	電気設備	
SNAP-ON INC	39.32	39.32	625	66,820	機械	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	321.42	302.03	3,360	359,123	保険	
ADVANCE AUTO PARTS	52.73	52.73	574	61,429	専門小売り	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	389.97	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
EDISON INTERNATIONAL	241.39	219.63	1,301	139,034	電力	

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
FACEBOOK INC	1,735.36	1,675.84	30,084	3,214,848		インターネットソフトウェア・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	119.68	100.51	1,052	112,431		ライフサイエンス・ツール／サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	56.16	70.54	866	92,588		石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	126.4	122.06	1,803	192,702		ソフトウェア
WHITEWAVE FOODS CO	144.44	—	—	—		食品
PALO ALTO NETWORKS INC	70.48	62.15	984	105,179		通信機器
TESARO INC	—	26.46	163	17,434		バイオテクノロジー
WORKDAY INC	87.1	91.87	1,108	118,503		ソフトウェア
ABBVIE INC	1,213.23	1,122.99	12,698	1,356,990		バイオテクノロジー
ZOETIS INC	344.81	344.25	2,563	273,912		医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	122.24	122.24	719	76,912		ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	388.71	314.4	668	71,393		パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	302.63	494	52,841		メディア
MALLINCKRODT PLC	94.19	—	—	—		医薬品
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	128.91	463	49,563		商社・流通業
CDW CORP	98.77	108.24	761	81,405		電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	638.82	638.82	339	36,248		無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	101.99	101.99	520	55,659		旅客航空輸送業
ARCONIC INC	342.59	275.13	701	74,912		航空宇宙・防衛
ENVISION HEALTHCARE CORP	47.3	86.92	324	34,663		ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	131.75	456	48,754		メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	50.06	50.06	211	22,558		メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	183.3	133.68	558	59,668		メディア
XL GROUP LTD	202.59	171.66	746	79,794		保険
BROADCOM LTD	294.75	287.37	7,117	760,523		半導体・半導体製造装置
DELL TECHNOLOGIES INC	172.83	150.74	1,053	112,547		ソフトウェア
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	154.1	154.1	248	26,577		繊維・アパレル・贅沢品
BAKER HUGHES A GE CO	—	284.04	750	80,191		エネルギー設備・サービス
TECHNIPFMC LTD	148.16	325.56	981	104,924		エネルギー設備・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	62.91	350	37,451		保険
ANTERO RESOURCES CORP	131.63	131.63	240	25,698		石油・ガス・消耗燃料
VEEVA SYSTEMS INC	—	69.8	404	43,186		ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	436.92	436.92	1,474	157,576		インターネットソフトウェア・サービス
PLAINS GP HOLDINGS LP	78.37	78.37	178	19,069		石油・ガス・消耗燃料
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	129.2	502	53,678		通信機器
ALLEGION PLC	—	54.02	431	46,163		建設関連製品
PERRIGO CO PLC	103.22	85.53	741	79,204		医薬品
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	147.96	147.96	1,272	135,927		ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	173.07	173.07	712	76,103		ホテル・レストラン・レジャー
SABRE CORP	176.24	176.24	380	40,622		情報技術サービス
NAVIENT CORP	226.36	—	—	—		消費者金融
PARSLEY ENERGY INC	109.49	174.54	409	43,774		石油・ガス・消耗燃料
ARISTA NETWORKS INC	—	31.58	954	101,954		通信機器
IHS MARKIT LTD	267.41	275.11	1,268	135,525		専門サービス
FNF GROUP	205.71	177.6	679	72,649		保険
SYNCHRONY FINANCIAL	626.91	574.85	2,109	225,442		消費者金融
MOBILEYE NV	140.01	—	—	—		ソフトウェア
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	390.2	348.45	1,597	170,724		銀行
CDK GLOBAL INC	83.09	83.09	595	63,591		ソフトウェア
QORVO INC	105.99	87.84	692	73,985		半導体・半導体製造装置
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	113.89	113.89	412	44,032		各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	78.18	78.18	704	75,314		メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	147.1	147.1	453	48,477		化学
LIBERTY LILAC GROUP-C	63.05	—	—	—		メディア
NIELSEN HOLDINGS PLC	268.4	268.4	885	94,590		専門サービス
TRANSUNION	—	103.41	577	61,683		専門サービス
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	51.28	—	—	—		化学

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(アメリカ)						
SQUARE INC	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		情報技術サービス
DOWDUPONT INC	—	173.76	727	77,707		化学
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	—	1,652.19	11,785	1,259,352		飲料
WESTROCK CO	160.9	140	521	55,682		容器・包装
KRAFT HEINZ CO	177.44	177.44	1,140	121,920		食品
FORTIVE CORP	453.82	438.18	3,151	336,757		機械
WASTE CONNECTIONS INC	237.58	216.82	1,608	171,893		商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	101.57	188.79	1,309	139,967		インターネットソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	219.99	208.92	22,410	2,394,823		コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	1,215.9	1,132.42	1,828	195,431		情報技術サービス
FIRST DATA CORP	805.67	810.79	6,264	669,475		情報技術サービス
DXC TECHNOLOGY CO	220.35	220.35	349	37,297		情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC-C	—	196.49	1,967	210,263		情報技術サービス
ALPHABET INC-CL C	81.34	81.34	382	40,826		インターネットソフトウェア・サービス
L3 TECHNOLOGIES INC	231.39	222.97	23,851	2,548,728		インターネットソフトウェア・サービス
CHEMOURS CO	58.92	58.92	1,231	131,590		航空宇宙・防衛
ATHENE HOLDING LTD	—	127.23	623	66,633		化学
CHARTER COMMUNICATIONS INC	—	89.84	436	46,686		保険
VISTRA ENERGY CORP	161.19	135.83	4,875	520,994		メディア
	—	158.25	288	30,878		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額	232,562.52	219,768.86	1,670,715	178,532,685	
銘柄	比 率	600銘柄	602銘柄	—	<62.8%>	
(カナダ)						
AGNICO EAGLE MINES LTD	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	161.41	161.41	922	78,879		金属・鉱業
BARRICK GOLD CORP	307.28	307.28	1,878	160,565		食品・生活必需品小売り
ATCO LTD	836.48	836.48	1,433	122,554		金属・鉱業
BANK OF MONTREAL	71.93	71.93	302	25,867		総合公益事業
BANK OF NOVA SCOTIA	477.43	454.51	4,418	377,675		銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	894.36	844.84	6,566	561,342		銀行
BCE INC	237.56	237.56	1,466	125,332		銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	115.68	115.68	643	55,008		各種電気通信サービス
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	650.43	575	2,782	237,841		資本市場
BOMBARDIER INC 'B'	1,516.15	1,516.15	498	42,638		航空宇宙・防衛
SAPUTO INC	206.8	141.01	571	48,816		食品
BLACKBERRY LTD	396.52	396.52	599	51,248		ソフトウェア
CGI GROUP INC	152.28	152.28	1,103	94,359		情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	22.68	113.4	633	54,137		容器・包装
CAE INC	230	230	531	45,415		航空宇宙・防衛
CAMECO CORP	326.27	326.27	379	32,407		石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	259.67	259.67	1,483	126,809		無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	301.59	294.71	3,404	290,990		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	843.39	794.2	3,149	269,244		石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	48.62	48.62	796	68,055		複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	91.19	91.19	312	26,705		総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	573.06	526.87	5,076	433,930		陸運・鉄道
FIRST CAPITAL REALTY INC	114.17	114.17	219	18,728		不動産管理・開発
AGRIUM INC	93.82	—	—	—		化学
YAMANA GOLD INC	675.2	—	—	—		金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	139.3	139.3	541	46,283		繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	197.56	197.56	876	74,895		ソフトウェア
ELDORADO GOLD CORP	467.9	—	—	—		金属・鉱業
EMPIRE CO LTD	150.93	150.93	351	30,008		食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	997.41	997.41	534	45,698		金属・鉱業
FINNING INTERNATIONAL INC	98.92	98.92	328	28,072		商社・流通業
FORTIS INC	290.02	290.02	1,151	98,395		電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	552.96	552.96	1,166	99,686		金属・鉱業
TELUS CORP	189.45	159.45	706	60,352		各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
GREAT WEST LIFECO INC	248.37	192.48	654	55,907	保険	
IMPERIAL OIL LTD	215.42	215.42	747	63,878	石油・ガス・消耗燃料	
ENBRIDGE INC	688.27	1,126.14	4,826	412,580	石油・ガス・消耗燃料	
IGM FINANCIAL INC	84.26	84.26	330	28,241	資本市場	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	879.95	879.95	319	27,304	金属・鉱業	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,441.96	1,365.17	3,395	290,219	保険	
LINAMAR CORP	38.27	38.27	267	22,886	自動車部品	
LOBLAW CO LTD	179.36	153.54	990	84,666	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	65.24	65.24	381	32,618	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	292.08	253.39	1,734	148,239	自動車部品	
SUN LIFE FINANCIAL INC	464.05	408.42	2,110	180,388	保険	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	18.05	19.85	1,250	106,885	保険	
METRO INC	193.5	123.89	481	41,195	食品・生活必需品小売り	
HUSKY ENERGY INC	287.49	287.49	470	40,253	石油・ガス・消耗燃料	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	399.92	399.92	357	30,527	石油・ガス・消耗燃料	
METHANEX CORP	73.81	73.81	531	45,395	化学	
ONEX CORP	66.46	66.46	588	50,276	各種金融サービス	
GOLDCORP INC	676.52	510.66	856	73,246	金属・鉱業	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	610.76	—	—	—	化学	
POWER CORP OF CANADA	250.52	250.52	749	64,029	保険	
POWER FINANCIAL CORP	174.84	174.84	573	49,005	保険	
ROYAL BANK OF CANADA	1,108.68	1,039.45	10,447	893,053	銀行	
SNC-LAVALIN GROUP INC	124.59	131.34	693	59,244	建設・土木	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	106.07	106.07	2,416	206,552	陸運・鉄道	
SHAW COMM INC-B	340.29	275.48	704	60,188	メディア	
SUNCOR ENERGY INC	1,262.73	1,168.95	4,970	424,867	石油・ガス・消耗燃料	
LUNDIN MINING CORP	—	352.68	306	26,197	金属・鉱業	
ENCANA CORP	692.57	692.57	970	82,940	石油・ガス・消耗燃料	
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	410.16	1,556	133,089	金属・鉱業	
THOMSON REUTERS CORP	251.28	204.69	1,027	87,851	資本市場	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,385.62	1,311.89	9,487	810,999	銀行	
TRANSCANADA CORP	628.95	628.95	3,373	288,382	石油・ガス・消耗燃料	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	56.96	56.96	491	42,048	紙製品・林産品	
WESTON (GEORGE) LTD	31.05	31.05	321	27,499	食品・生活必需品小売り	
INTACT FINANCIAL CORP	107.18	107.85	1,044	89,286	保険	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	339.43	339.43	846	72,333	金属・鉱業	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	14.94	14.94	1,218	104,127	ソフトウェア	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	139.19	127.87	1,187	101,466	金属・鉱業	
WASTE CONNECTIONS INC	24.29	—	—	—	商業サービス・用品	
CI FINANCIAL CORP	206.95	206.95	575	49,213	資本市場	
VERESEN INC	249.82	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
TOURMALINE OIL CORP	157.79	157.79	290	24,831	石油・ガス・消耗燃料	
KEYERA CORP	137.28	137.28	448	38,325	石油・ガス・消耗燃料	
ALTAGAS LTD	125.38	125.38	325	27,844	石油・ガス・消耗燃料	
PEMBINA PIPELINE CORP	307.19	308.5	1,245	106,484	石油・ガス・消耗燃料	
DOLLARAMA INC	92.86	75.04	1,149	98,275	複合小売り	
CENOVUS ENERGY INC W/I	591.24	805.45	795	68,023	石油・ガス・消耗燃料	
VERMILION ENERGY INC	82.91	82.91	350	29,964	石油・ガス・消耗燃料	
ARC RESOURCES LTD	229.97	229.97	284	24,356	石油・ガス・消耗燃料	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	144.93	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	306.31	306.31	152	13,013	各種金融サービス	
INTER PIPELINE LTD	240.83	240.83	549	46,936	石油・ガス・消耗燃料	
NUTRIEN LTD	—	453.51	2,527	216,081	化学	
PRARIESKY ROYALTY LTD	149.61	149.61	435	37,189	石油・ガス・消耗燃料	
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	172.31	172.31	274	23,492	石油・ガス・消耗燃料	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	173.9	153.53	1,108	94,766	ホテル・レストラン・レジャー	
SHOPIFY INC	—	50.21	861	73,602	インターネットソフトウェア・サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ) HYDRO ONE LTD	百株 166.12	百株 133.54		千カナダ・ドル 270	千円 23,115	電力
小計 株数 : 金額 銘柄 数 <比率>	30,855.09	28,933.66	119,748	10,236,103	<3.6%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	111.15	111.15	738	62,502		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	2,216.6	2,038.83	5,635	477,030		銀行
AMCOR LTD	807.41	807.41	1,147	97,121		容器・包装
WESTPAC BANKING CORPORATION	2,482.37	2,399.94	7,240	612,918		銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	305.69	305.69	364	30,844		銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,141.25	1,141.25	582	49,269		金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	3,145.74	2,729.19	936	79,241		各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	390.14	390.14	424	35,898		銀行
AMP LTD	2,004.98	2,004.98	1,044	88,424		各種金融サービス
ASX LTD	163.54	102.9	556	47,123		資本市場
BHP BILLITON LTD	2,416.14	2,320.53	6,966	589,691		金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LTD	209.46	209.46	702	59,433		石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	—	221.82	95	8,092		複合小売り
COMPUTERSHARE LT	380.4	380.4	657	55,675		情報技術サービス
CSL LIMITED	334.99	322.12	4,808	407,075		バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	41.19	41.19	312	26,432		インターネットソフトウェア・サービス
TRANSURBAN GROUP	1,495.91	1,495.91	1,732	146,636		運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	486.01	486.01	400	33,941		飲料
COCHLEAR LTD	39.92	39.92	702	59,471		ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,433.3	1,217.21	1,011	85,623		石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,275.79	1,212.08	8,966	759,053		銀行
BORAL LIMITED	601.88	861.01	634	53,715		建設資材
RIO TINTO LIMITED	318.97	268.22	2,115	179,118		金属・鉱業
APA GROUP	732.53	732.53	575	48,738		ガス
ARISTOCRAT LEISU	444.06	373.93	881	74,638		ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,714.71	1,714.71	1,286	108,862		保険
TPG TELECOM LTD	287.19	287.19	171	14,537		各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	47.06	32.75	162	13,742		ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	357.9	284.89	649	55,008		建設資材
ORICA LTD	253.08	253.08	462	39,118		化学
CIMIC GROUP LTD	87.09	87.09	388	32,872		建設・土木
BLUESCOPE STEEL LTD	—	369.41	542	45,936		金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	851.3	851.3	546	46,264		運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	218.69	216.27	2,208	186,917		資本市場
SUNCORP GROUP LTD	931.81	931.81	1,241	105,065		保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,007.14	1,928.82	5,574	471,863		銀行
NEWCREST MINING LTD	611.1	515.33	1,149	97,278		金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	937.15	937.15	689	58,386		石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,364.26	1,364.26	495	41,920		化学
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	953.9	953.9	992	83,977		保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	457.07	457.07	562	47,589		各種金融サービス
SANTOS LTD	1,338.62	1,338.62	653	55,297		石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	261.92	261.92	634	53,677		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TABCOP HOLDINGS LTD	707.76	1,263.48	563	47,701		ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	863.31	810.21	3,284	278,040		食品・生活必需品小売り
ALUMINA LIMITED	1,846.13	1,846.13	411	34,849		金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM LTD	579.23	602.49	1,872	158,510		石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	923.44	912.94	2,441	206,647		食品・生活必需品小売り
DUET GROUP	2,077.76	—	—	—		総合公益事業
SEEK LTD	258.99	258.99	515	43,627		専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	45.81	45.81	213	18,031		ホテル・レストラン・レジャー
TATTS GROUP LTD	1,099.37	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	259	22,007		電力

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)						
AGL ENERGY LTD	百株 463.15	百株 463.15	千オーストラリア・ドル 1,008	85,389	千円	総合公益事業
BRAMBLES LTD	1,152.55	1,152.55	1,106	93,660	同上	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	422	35,744	同上	ホテル・レストラン・レジャー
VOCUS GROUP LTD	430.23	—	—	—	同上	各種電気通信サービス
AURIZON HOLDINGS LTD	1,715.22	1,391.84	630	53,372	同上	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	639.22	507.89	863	73,087	同上	飲料
HEALTHSCOPE LTD	1,490.47	1,490.47	278	23,593	同上	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MEDIBANK PVT LTD	2,348.49	1,771.76	533	45,143	同上	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	4,320.27	3,670.57	1,358	114,964	同上	金属・鉱業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	58,600.08 60銘柄	53,166.94 59銘柄	83,407 —	7,060,405 <2.5%>	
(香港)						
ASM PACIFIC TECH	百株 166	百株 166	千香港・ドル 1,747	23,877	千円	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	3,040	41,534	同上	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	762.6	762.6	2,467	33,699	同上	銀行
CLP HOLDINGS LTD	1,305	1,195	9,141	124,876	同上	電力
PCCW LTD	3,310	3,310	1,472	20,120	同上	各種電気通信サービス
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	920	—	—	—	同上	旅客航空輸送業
LI & FUNG LTD	5,324	5,324	2,102	28,726	同上	繊維・アパレル・賃沢品
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	490	490	3,204	43,774	同上	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	895.4	790.4	21,562	294,538	同上	資本市場
MTR CORP	1,185	1,185	4,811	65,719	同上	陸運・鉄道
HANG LUNG GROUP LTD	630	630	1,694	23,149	同上	不動産管理・開発
HANG SENG BANK LTD	560	560	10,724	146,489	同上	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	942.22	838.44	4,171	56,979	同上	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,125	965	6,354	86,802	同上	電力
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	957.5	957.5	2,743	37,472	同上	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	6,165.88	6,100.46	9,053	123,665	同上	ガス
HYSAN DEVELOPMENT CO	—	500	2,180	29,778	同上	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,890	1,640	10,766	147,071	同上	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES LTD	430	330	1,146	15,664	同上	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,870	2,620	10,218	139,577	同上	銀行
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	505	505	1,734	23,695	同上	繊維・アパレル・賃沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,412.66	4,412.66	5,118	69,921	同上	不動産管理・開発
SINO LAND CO	2,554	2,554	3,493	47,726	同上	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,130	1,030	12,978	177,279	同上	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	425	300	2,227	30,427	同上	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,135	1,135	5,436	74,264	同上	家庭用耐久財
WHEELOCK & CO LTD	560	560	3,166	43,258	同上	不動産管理・開発
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	—	2,580	1,287	17,586	同上	資本市場
MINTH GROUP LTD	—	440	1,894	25,874	同上	自動車部品
SJM HOLDINGS LTD	—	1,560	1,148	15,683	同上	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	1,244	3,327	45,456	同上	ホテル・レストラン・レジャー
MGMT CHINA HOLDINGS LTD	648	648	1,415	19,340	同上	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD	8,926.27	8,496.27	53,016	724,208	同上	保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,140	2,820	2,741	37,442	同上	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	1,980	1,692	7,427	101,464	同上	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,698	36,865	同上	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	—	957.5	4,859	66,378	同上	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,665	22,746	同上	電力
WH GROUP LTD	5,305	5,305	4,801	65,582	同上	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,993.32	1,993.32	19,504	266,433	同上	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,988.32	1,843.32	12,488	170,592	同上	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	69,857.17 36銘柄	73,422.47 40銘柄	261,035 <1.3%>	3,565,749	
(シンガポール)						
SINGAPORE TECH ENG	百株 1,250	百株 1,250	千シンガポール・ドル 408	33,219	千円	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)		当期末			業種等
	株数	株数	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)						
SEMCORP INDUSTRIES	百株 814	百株 814	千円 258	千円 21,036	千円 21,036	コングロマリット
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,237	1,237	326	26,540	26,540	メディア
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,921.4	6,921.4	245	19,968	19,968	食品
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,331	1,242	3,481	282,927	282,927	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	290	290	358	29,130	29,130	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	102.44	59.44	220	17,941	17,941	販売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	423	423	219	17,876	17,876	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	689	509	41,380	41,380	資本市場
CAPITALAND LTD	1,924.15	1,924.15	679	55,200	55,200	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE PLC	4,164	4,164	508	41,285	41,285	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,193	984	767	62,376	62,376	コングロマリット
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,779	1,779	359	29,205	29,205	陸運・鉄道
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,490.53	2,254.53	2,764	224,634	224,634	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,919.22	5,919.22	1,982	161,153	161,153	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	475	475	529	43,042	43,042	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	945	945	2,479	201,523	201,523	銀行
UOL GROUP LIMITED	—	405	332	27,022	27,022	不動産管理・開発
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,510	920	274	22,280	22,280	食品
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	1,457	1,888	252	20,560	20,560	機械
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	1,721	—	—	—	—	不動産管理・開発
小計	株数 銘柄数 <small><比率></small>	36,635.74 20銘柄	34,583.74 20銘柄	16,959 —	1,378,306 <small><0.5%></small>	
(ニュージーランド)						
AUCKLAND INT'L AIRPORT LTD	百株 979.92	百株 979.92	千円 613	千円 48,326	48,326	運送インフラ
FISHER & PAYKEL	—	372.49	476	37,561	37,561	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	752.81	752.81	530	41,810	41,810	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,101.61	1,596.23	541	42,629	42,629	各種電気通信サービス
小計	株数 銘柄数 <small><比率></small>	3,834.34 3銘柄	3,701.45 4銘柄	2,162 —	170,327 <small><0.1%></small>	
(イギリス)						
ABERDEEN ASSET MGMT	百株 713.41	百株 —	千円 —	千円 —	—	資本市場
ANTOFAGASTA PLC	259.05	259.05	237	35,517	35,517	金属・鉱業
ASHTEAD GROUP	352.33	352.33	706	105,737	105,737	商社・流通業
SEVERN TRENT PLC	148.97	148.97	257	38,575	38,575	水道
BHP BILLITON PLC	1,533.23	1,533.23	2,414	361,361	361,361	金属・鉱業
BARCLAYS PLC	12,470.81	11,642.6	2,278	341,039	341,039	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	826.82	646.82	354	53,035	53,035	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	6,212.2	5,766.86	1,300	194,647	194,647	各種電気通信サービス
SKY PLC	722.1	722.1	781	116,946	116,946	メディア
BUNZL PLC	269.29	222.41	451	67,612	67,612	商社・流通業
EASYJET PLC	136.28	136.28	225	33,687	33,687	旅客航空輸送業
CAPITA PLC	548.94	548.94	104	15,570	15,570	専門サービス
AVIVA PLC	3,068.04	2,778.61	1,365	204,374	204,374	保険
CRODA INTERNATIONAL	109.65	84.07	363	54,424	54,424	化学
DIAGEO PLC	1,864.18	1,797.03	4,444	665,320	665,320	飲料
SCHRODERS PLC	71.88	66.97	225	33,680	33,680	資本市場
DCC PLC	72.81	59.36	403	60,418	60,418	コングロマリット
NATIONAL GRID PLC	2,802.03	2,298.84	1,710	256,072	256,072	総合公益事業
GKN PLC	1,341.8	1,341.8	551	82,605	82,605	自動車部品
KINGFISHER PLC	1,656.8	1,656.8	594	89,028	89,028	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	2,419.05	2,251.76	1,288	192,923	192,923	航空宇宙・防衛
PROVIDENT FINANCIAL PLC	119.87	—	—	—	—	消費者金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,385.48	1,629.3	7,234	1,082,798	1,082,798	タバコ
COBHAM PLC	1,427.39	1,427.39	170	25,445	25,445	航空宇宙・防衛
NEXT PLC	97.31	97.31	468	70,073	70,073	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	703.88	657.39	1,724	258,196	258,196	タバコ
IMI PLC	212.18	212.18	262	39,254	39,254	機械

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
JOHNSON MATTHEY PLC	125.27	125.27	388	58,201		化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,050.1	935.73	1,584	237,177		金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,197.16	1,151.11	1,782	266,803		ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	14,863.52	14,150.41	10,614	1,588,736		銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,236.49	4,236.49	1,070	160,178		保険
CENTRICA PLC	3,927.66	3,927.66	500	74,897		総合公益事業
UNILEVER PLC	973.69	893.05	3,386	506,883		パーソナル用品
MEGGITT PLC	621.81	621.81	289	43,399		航空宇宙・防衛
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	1,556.82	1,556.82	337	50,566		食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	555.99	347.14	232	34,771		水道
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	808.64	808.64	487	73,009		保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	253.08	253.08	661	99,020		食品
PEARSON PLC	650.09	650.09	434	64,961		メディア
PERSIMMON PLC	231.5	231.5	557	83,508		家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	1,942.75	1,829.73	3,317	496,533		保険
RIO TINTO PLC	902.16	859.76	3,461	518,101		金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	19,744.79	19,065.94	3,807	569,901		無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	469.78	472.31	2,986	447,006		家庭用品
RELX PLC	806.89	723.05	1,053	157,631		専門サービス
OLD MUTUAL PLC	3,899.86	3,392.96	812	121,581		保険
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,462.6	1,169.66	959	143,666		航空宇宙・防衛
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,794.42	2,461.07	676	101,265		銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	408.84	408.84	457	68,538		資本市場
TRAVIS PERKINS PLC	203.57	203.57	284	42,536		商社・流通業
SSE PLC	730.43	730.43	869	130,212		電力
BP PLC	13,979.56	13,848.28	6,576	984,377		石油・ガス・消耗燃料
SHIRE PLC	680.23	654.57	2,052	307,203		バイオテクノロジー
SAGE GROUP PLC(THE)	852.71	852.71	588	88,016		ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	317.2	317.2	489	73,330		コングロマリット
STANDARD CHARTERED PLC	2,514.34	2,375.33	1,921	287,631		銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	48,855.54	50,551.36	3,366	503,930		銀行
TATE & LYLE PLC	399.15	—	—	—		食品
TAYLOR WIMPEL PLC	2,530.22	2,530.22	469	70,328		家庭用耐久財
TESCO PLC	6,247.03	5,629.88	1,138	170,389		食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	784.91	667.84	595	89,066		資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	661.55	661.55	832	124,617		ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,636.78	3,455.37	4,460	667,601		医薬品
WEIR GROUP	183.36	183.36	370	55,521		機械
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	249.07	218.88	869	130,130		資本市場
BABCOCK INT'L GROUP	213.02	213.02	135	20,355		商業サービス・用品
WPP PLC	975.55	906.28	1,254	187,742		メディア
FERGUSON PLC	182.38	182.38	937	140,315		商社・流通業
ASTRAZENECA PLC	941.92	887.62	4,287	641,708		医薬品
WHITBREAD PLC	121.59	121.59	463	69,431		ホテル・レストラン・レジャー
CARNIVAL PLC	131.53	131.53	638	95,543		ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,202.9	1,202.9	349	52,358		複合小売り
JOHN WOOD GROUP PLC	—	489.88	293	43,995		エネルギー設備・サービス
INTERTEK GROUP PLC	105	112.73	546	81,852		専門サービス
WILLIAM HILL PLC	724.74	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
BURBERRY GROUP PLC	357.74	298.93	461	69,039		織維・アパレル・贅沢品
INVESTEC PLC	506.55	506.55	305	45,704		資本市場
INTERCONTINENTAL HOTELS	151.87	123.62	573	85,855		ホテル・レストラン・レジャー
ITV PLC	2,472.1	2,472.1	408	61,201		メディア
SAINSBURY (J) PLC	1,094.1	1,094.1	267	40,089		食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	69.98	69.98	446	66,890		金属・鉱業
G4S PLC	1,222.5	1,222.5	308	46,111		商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	158.93	299	44,805		保険

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)							
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		家庭用耐久財	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	107.26	107.26	406	60,815		石油・ガス・消耗燃料	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,241.39	3,194.45	7,288	1,090,888		石油・ガス・消耗燃料	
INMARSAT PLC	2,778.39	2,619.72	6,076	909,521		各種電気通信サービス	
PETROFAC LTD	341.27	—	—	—		エネルギー設備・サービス	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	218.09	—	—	—		医薬品	
TUI AG-DI	114.57	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193.94	301.53	464	69,504		各種金融サービス	
EXPERIAN PLC	1,556.09	1,841.83	717	107,324		専門サービス	
MONDI PLC	715.16	622.14	950	142,290		紙製品・林産品	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	302	240.61	431	64,519		資本市場	
FRESNILLO PLC NPR	212.9	212.9	353	52,946		金属・鉱業	
GLENCORE PLC	156.39	156.39	207	31,121		金属・鉱業	
DIXONS CARPHONE PLC	8,990.43	8,654.23	3,309	495,347		専門小売り	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	846.39	—	—	—		保険	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	1,126.94	1,126.94	434	65,060		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
COCA-COLA HBC AG	306.16	306.16	175	26,212		飲料	
CONVATEC GROUP PLC	134.06	134.06	314	47,034		ヘルスケア機器・用品	
ROYAL MAIL PLC	—	1,184	233	35,018		航空貨物・物流サービス	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	550.6	550.6	297	44,503		ホテル・レストラン・レジャー	
WORLDPAY INC	500.37	500.37	167	25,022		情報技術サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	—	107.75	566	84,817		ソフトウェア	
AUTO TRADER GROUP PLC	763.48	323.42	662	99,142		インターネットソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	1,122.02	763.48	277	41,482		情報技術サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	222,765.64 104銘柄	214,633.55 99銘柄	129,978 —	19,455,168 <6.8%>		
(イスラエル)							
BANK HAPOALIM BM	百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円		銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	784.28	784.28	1,937	58,758		銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	1,242.7	1,030.61	2,172	65,870		各種電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD	1,882.3	1,882.3	986	29,905		航空宇宙・防衛	
FRUTAROM INDUSTRIES LTD	17.6	17.6	920	27,908		化学	
ISRAEL CHEMICALS LTD	26	26	809	24,540		化学	
NICE LTD	494.11	494.11	716	21,738		ソフトウェア	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	56.38	40.35	1,250	37,913		ソフトウェア	
	104.44	104.44	655	19,867		銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,607.81 8銘柄	4,379.69 8銘柄	9,449 —	286,503 <0.1%>		
(スイス)							
CREDIT SUISSE GROUP AG	百株	百株	千スイス・フラン	千円		資本市場	
SYNGENTA AG	1,451.06	1,673.95	2,864	329,614		化学	
NESTLE SA-REGISTERED	68.72	—	—	—		食品	
CIE FINANC RICHEMONT	2,323.79	2,197.06	16,987	1,954,431		繊維・アパレル・贅沢品	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	396.74	374.38	3,144	361,808		医薬品	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	524.76	496.63	11,054	1,271,875		機械	
SIKA INHABER	28.35	28.35	627	72,148		化学	
SGS SA-REG	1.51	1.51	1,141	131,336		専門サービス	
NOVARTIS AG-REG SHS	4.05	4.05	951	109,498		医薬品	
BALOISE HOLDING AG -R	1,667.25	1,575.58	12,500	1,438,199		保険	
BARRY CALLEBAUT AG	41.27	41.27	602	69,274		食品	
CLARIANT AG-REG	1.44	1.44	266	30,649		食品	
SWISSCOM AG-REG	—	128.88	313	36,090		化学	
ABB LTD	17.95	17.95	916	105,405		各種電気通信サービス	
ADECCO GROUP AG-REG	1,376.22	1,262.78	2,903	334,005		電気設備	
GEBERT AG	109.26	123.41	900	103,562		専門サービス	
LONZA GROUP AG-REG	28.01	28.01	1,166	134,154		建設関連製品	
LINDT & SPRUENGLI PART	43.73	53.89	1,279	147,251		ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.75	0.75	417	48,062		食品	
	0.06	0.09	601	69,168		食品	

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	外貨建金額 邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千円		
GIVAUDAN-REG	6.92	6.92	1,481	170,454		化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	110.53	108.43	3,316	381,606		保険
LAFARGEHOLCIM LTD	209.41	326.76	1,757	202,179		建設資材
ACTELION	74.35	—	—	—		バイオテクノロジー
SONOVA HOLDING AG	45.19	31.68	459	52,885		ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG	44.53	36.87	594	68,442		海運業
STRAUMANN HOLDING AG	—	6	391	45,076		ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	19.55	19.55	789	90,778		織維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	45.92	348	40,151		織維・アパレル・贅沢品
SCHINDLER NAMEN	16.63	16.63	359	41,365		機械
SWISS LIFE HOLDING AG	26.18	22.25	740	85,141		保険
VIFOR PHARMA AG	3.05	30.5	396	45,617		医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING	5.53	5.53	347	39,986		化学
SWISS PRIME SITE AG	59.9	59.9	520	59,921		不動産管理・開発
DUFRY GROUP	35.66	23.9	326	37,574		専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	14.74	12.72	865	99,586		資本市場
ARYTA AG	71.91	—	—	—		食品
JULIUS BAER GROUP LTD	152.27	152.27	921	106,057		資本市場
SWISS RE LTD	238.38	206.38	1,958	225,283		保険
UBS GROUP AG	2,770.78	2,606.39	4,572	526,113		資本市場
小計	株数 銘柄数 <small><比率></small>	12,036.35 37銘柄	11,728.58 36銘柄	78,789 —	9,064,760 <3.2%>	
(デンマーク)		百株	百株	千円		
CARLSBERG AS-B	86.01	73.3	5,216	93,158		飲料
A P MOLLER A/S	4.81	4.81	5,081	90,760		海運業
AP MOLLER MAERSK A	2.73	2.73	2,743	49,001		海運業
DANSKE BANK A/S	525.45	501.88	12,255	218,890		銀行
GENMAB A/S	46.33	38.99	4,189	74,824		バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS	159.04	159.04	4,860	86,804		化学
NOVO NORDISK A/S-B	1,421.39	1,317.28	39,959	713,680		医薬品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	158.08	158.08	6,797	121,402		電気設備
TDC A/S	689.39	689.39	3,395	60,639		各種電気通信サービス
COLOPLAST-B	82.86	82.86	4,220	75,385		ヘルスケア機器・用品
DSV A/S	156.01	130.4	6,170	110,205		陸運・鉄道
WILLIAM DEMANT	65.37	65.37	1,223	21,855		ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S	—	48.4	1,536	27,436		医薬品
TRYG A/S	111.07	111.07	1,583	28,287		保険
PANDORA A/S	82.51	82.51	4,972	88,800		織維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	77.08	77.08	3,915	69,933		化学
ISS A/S	111.25	111.25	2,512	44,864		商業サービス・用品
ORSTED A/S	65.75	116	4,222	75,412		電力
小計	株数 銘柄数 <small><比率></small>	3,845.13 17銘柄	3,770.44 18銘柄	114,856 —	2,051,342 <0.7%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千円		
MARINE HARVEST	318.39	248.16	3,615	49,571		食品
DNB ASA	704.26	704.26	10,997	150,769		銀行
NORSK HYDRO ASA	918.79	918.79	5,176	70,969		金属・鉱業
TELENOR ASA	531.78	531.78	9,252	126,858		各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	91.31	—	—	—		メディア
ORKLA ASA	614.21	614.21	5,171	70,903		食品
STATOIL ASA	814.14	814.14	14,023	192,263		石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	145.76	112.79	3,834	52,575		化学
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	166.83	2,357	32,318		保険
小計	株数 銘柄数 <small><比率></small>	4,305.47 9銘柄	4,110.96 8銘柄	54,429 —	746,228 <0.3%>	
(スウェーデン)		百株	百株	千円		
ATLAS COPCO AB-A SHS	483.77	483.77	16,511	221,743		機械

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)							
ATLAS COPCO AB-B SHS	百株 291.57	百株 257.93		千円 7,802	104,785	機械	
ERICSSON LM-B SHS	2,217.48	2,217.48		11,765	158,016	通信機器	
GETINGE AB-B SHS	131.53	131.53		1,327	17,823	ヘルスケア機器・用品	
LUNDBERGS B	26.06	36.91		2,247	30,188	各種金融サービス	
SKF AB-B SHS	323.06	248.66		4,214	56,604	機械	
SANDVIK AB	751.99	767.81		11,171	150,035	機械	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,219.39	959.18		9,227	123,922	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	271.5	211.79		3,481	46,760	建設・土木	
SWEDBANK AB	665.07	665.07		13,580	182,389	銀行	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	460.24	—		—	—	紙製品・林産品	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,189.09	1,083.88		12,388	166,380	銀行	
VOLVO AB-B SHS	1,136.72	1,136.72		17,369	233,266	機械	
SWEDISH MATCH AB	158.07	114.81		3,700	49,695	タバコ	
TELE2 AB-B SHS	269.76	269.76		2,569	34,511	無線通信サービス	
NORDEA AB	2,294.57	2,186.2		20,497	275,285	銀行	
INDUSTRIVARDEN C	—	114.03		2,229	29,939	各種金融サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	191.91		5,064	68,016	家庭用耐久財	
SECURITAS AB-B SHS	240.98	240.98		3,308	44,435	商業サービス・用品	
INVESTOR AB-B SHS	334.12	334.12		12,115	162,707	各種金融サービス	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	726.17	664.48		8,970	120,473	専門小売り	
ASSA ABLOY AB-B	756.7	686.13		11,804	158,539	建設関連製品	
TELIA CO AB	1,849.27	1,849.27		6,871	92,289	各種電気通信サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	167.9	167.9		3,081	41,388	石油・ガス・消耗燃料	
BOLIDEN AB	218.55	218.55		6,191	83,152	金属・鉱業	
ALFA LAVAL AB	245.53	174.11		3,403	45,713	機械	
KINNEVIK AB-B	183.1	183.1		5,229	70,229	各種金融サービス	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	53.32	53.32		2,975	39,957	無線通信サービス	
ICA GRUPPEN AB	59.2	59.2		1,733	23,287	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	336.92		2,881	38,696	家庭用耐久財	
HEXAGON AB	167.02	183.6		8,992	120,772	電子装置・機器・部品	
ESSITY AB-B	—	397.97		8,866	119,080	家庭用品	
小計	株数 : 金額 銘柄数比率 >	17,420.56	16,627.09 30銘柄	231,577 31銘柄	3,110,089 <1.1%>		
(ユーロ…イギリス)							
TECHNIPFMC PLC	百株 177.4	百株 —		千円 —	—	エネルギー設備・サービス	
小計	株数 : 金額 銘柄数比率 >	177.4	— 1銘柄	— —銘柄	— <-%>		
(ユーロ…アイルランド)							
CRH PLC	百株 622.22	百株 589.56		千円 1,617	215,179	建設資材	
PADDY POWER BETFAIR PLC	62.46	62.46		577	76,834	ホテル・レストラン・レジャー	
KERRY GROUP PLC-A	115.76	115.76		981	130,617	食品	
BANK OF IRELAND	21,986.37	—		—	—	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	732.87		561	74,648	銀行	
AIB GROUP PLC	—	523.22		285	37,942	銀行	
小計	株数 : 金額 銘柄数比率 >	22,786.81	2,023.87 4銘柄	4,022 5銘柄	535,222 <0.2%>		
(ユーロ…オランダ)							
AIRBUS SE	百株 427.05	百株 412.7		千円 3,473	462,209	航空宇宙・防衛	
BOSKALIS WESTMINSTER CT	75.63	75.63		226	30,079	建設・土木	
RELX NV	708.26	708.26		1,161	154,555	専門サービス	
KONINKLIJKE DSM NV	122.85	132.16		1,073	142,862	化学	
ING GROEP NV-CVA	2,865.93	2,728.8		4,002	532,513	銀行	
RANDSTAD HOLDINGS	77.94	77.94		450	60,004	専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	985.27	914.26		1,612	214,520	食品・生活必需品小売り	
HEINEKEN NV	173.73	173.73		1,460	194,363	飲料	
AKZO NOBEL	182.09	182.09		1,404	186,853	化学	
ASML HOLDING NV	275.66	274.21		4,187	557,147	半導体・半導体製造装置	

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

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

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 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)							
ADIDAS AG	百株	百株	千ユーロ	千円		織維・アパレル・贅沢品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	143.02	135.03	2,390	318,017		自動車	
COMMERZBANK AG	240.55	227.05	1,998	265,859		銀行	
FRESENIUS SE & CO KGAA	725.73	725.73	919	122,367		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
UNITED INTERNET	301.56	285.3	1,804	240,071		インターネットソフトウェア・サービス	
FUCHS PETROLUB SE PREF	98.82	98.82	545	72,556		化学	
MAN SE	55.46	55.46	246	32,853		機械	
HANNOVER RUECK SE	33.96	33.96	319	42,498		保険	
GEA GROUP AG	50.5	36.42	400	53,354		機械	
CONTINENTAL AG	146.35	118.38	446	59,367		自動車部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	83.1	77.76	1,774	236,112		航空貨物・物流サービス	
AXEL SPRINGER SE	742.74	699.44	2,579	343,232		メディア	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	30.67	30.67	216	28,811		自動車	
MERCK KGAA	120.66	105.91	742	98,759		医薬品	
RWE AG	87.52	95.51	794	105,684		総合公益事業	
SAP SE	391.83	391.83	634	84,383		ソフトウェア	
E.ON SE	732.92	690.54	5,779	769,062		総合公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	1,426.88	1,640.12	1,328	176,769		家庭用品	
METRO AG	86.14	75.25	726	96,723		専門小売り	
SIEMENS AG-REG	107.74	—	—	—		コングロマリット	
BAYER AG	568	537.06	5,868	780,928		医薬品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	614.71	584.37	5,715	760,534		家庭用品	
DAIMLER AG	132.53	121.78	1,278	170,061		自動車	
BASF SE	711.39	680.86	4,875	648,752		化学	
BEIERSDORF AG	679.7	651.28	5,620	747,869		パーソナル用品	
HOCHTIEF AG	67.8	67.8	620	82,618		建設・土木	
HEIDELBERGCEMENT AG	17.07	17.07	225	30,049		建設資材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	110.09	110.09	912	121,407		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE	338	319.55	6,004	799,023		保険	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	176.02	176.02	534	71,153		メディア	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	197.48	159.63	432	57,518		旅客航空輸送業	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	123.54	107.6	1,954	260,001		保険	
VOLKSWAGEN AG	27.94	21.83	370	49,321		自動車	
VOLKSWAGEN AG PFD	141.31	131.34	2,181	290,243		自動車	
THYSSENKRUPP AG	292.15	299.03	685	91,275		金属・鉱業	
TUI AG	191.96	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー	
1&1 DRILLISCH AG	—	31.49	201	26,837		無線通信サービス	
LINDE AG	141.83	—	—	—		化学	
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,048.36	1,492.44	1,930	256,808		資本市場	
BMW VORZUG	41.16	41.16	314	41,814		自動車	
K & S	149.82	149.82	317	42,282		化学	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,420.88	2,328.97	3,043	405,029		各種電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	817.74	817.74	1,789	238,072		半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	—	138.44	1,448	192,681		資本市場	
FRAPORT AG	31.49	31.49	273	36,378		運送インフラ	
WIRECARD AG	—	79.9	753	100,254		情報技術サービス	
LANXESS AG	68.56	68.56	458	60,975		化学	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	—	31.34	418	55,712		航空宇宙・防衛	
DEUTSCHE WOHNEN	267.14	267.14	894	119,077		不動産管理・開発	
SYMRISE AG	79.26	79.26	518	69,036		化学	
BRENTAG AG	123.31	96	487	64,839		商社・流通業	
EVONIK INDUSTRIES AG	115.75	115.75	345	45,989		化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	615.41	615.41	241	32,197		各種電気通信サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	52.18	52.18	379	50,545		織維・アパレル・贅沢品	
OSRAM LICHT AG	70.17	70.17	471	62,762		電気設備	
KION GROUP AG	—	46.86	320	42,586		機械	
VONOVA SE	352.71	353.08	1,297	172,607		不動産管理・開発	

銘柄	期首(前期末)	当期末				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)							
METRO AG	百株	百株	千円			食品・生活必需品小売り	
DEUTSCHE BOERSE AG	—	107.74	193	25,804		資本市場	
INNOGY SE	138.44	—	—	—		総合公益事業	
LINDE AG-TENDER	97.69	97.69	306	40,841		化学	
ZALANDO SE	—	133.75	2,523	335,825		インターネット販売・通信販売	
COVESTRO AG	66.74	66.74	310	41,276		化学	
SCHAFFLER AG	59.66	105	914	121,745		自動車部品	
UNIPER SE	126.44	126.44	165	22,056		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
160.58	138.97	335	44,582				
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,205.68 58銘柄	17,342.5 61銘柄	82,882 —	11,028,348 <3.9%>		
(ユーロ…イスラエル)							
LAFARGEHOLCIM LTD	百株	百株	千円				
	141.05	—	—	—		建設資材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	141.05 1銘柄	—銘柄	—	—<%>		
(ユーロ…ポルトガル)							
JERONIMO MARTINS	百株	百株	千円			食品・生活必需品小売り	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	195.17	195.17	337	44,900		電力	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,910.94	1,523.74	418	55,735		石油・ガス・消耗燃料	
379.21	379.21	550	73,315				
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,485.32 3銘柄	2,098.12 3銘柄	1,307 —	173,951 <0.1%>		
(ユーロ…スペイン)							
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	百株	百株	千円				
IBERDROLA SA	418.29	385.21	747	99,487		運送インフラ	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	4,242.73	4,168.18	2,516	334,878		電力	
REPSOL SA	—	144.26	179	23,917		電気設備	
TELEFONICA S.A.	801.53	826.64	1,142	152,064		石油・ガス・消耗燃料	
ENDESA S.A.	3,478.56	3,227.15	2,411	320,936		各種電気通信サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	210.37	210.37	356	47,390		電力	
BANKINTER S.A.	115.55	150.49	426	56,808		建設・土木	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	579.6	579.6	510	67,944		銀行	
GAS NATURAL SDG SA	4,815.07	4,643.35	3,235	430,527		銀行	
BANCO SANTANDER SA	290.1	290.1	536	71,353		ガス	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	10,780.26	11,456.9	6,294	837,535		銀行	
BANCO POPULAR ESPANOL	345.96	345.96	558	74,320		電力	
BANCO SABADELL	2,777.68	—	—	—		銀行	
INDITEX	4,280.14	3,677.53	662	88,177		銀行	
MAPFRE SA	837.55	756.58	1,987	264,461		専門小売り	
ENAGAS	844.74	844.74	228	30,460		保険	
GRIFOLS SA	180.95	180.95	373	49,743		石油・ガス・消耗燃料	
FERROVIAL SA	253.09	188	438	58,385		バイオテクノロジー	
CAIXABANK	356.1	369.97	629	83,712		建設・土木	
AMADEUS IT GROUP SA	2,292.31	2,623.72	1,047	139,330		銀行	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	330.99	301.69	1,766	235,076		情報技術サービス	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	684.48	447.47	303	40,332		旅客航空輸送業	
BANKIA SA	483.05	—	—	—		食品・生活必需品小売り	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERV-RTS	3,706.38	631.97	242	32,240		銀行	
AENA SME SA	—	150	6	818		建設・土木	
ACS ACTIVIDADES DE CONS Y SERVICIOS-RTS	52.56	52.56	870	115,849		運送インフラ	
114.92	—	—	—	—		建設・土木	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	43,272.96 25銘柄	36,653.54 24銘柄	27,474 —	3,655,755 <1.3%>		
(ユーロ…イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI	百株	百株	千円				
INTESA SANPAOLO	859.95	859.95	1,320	175,756		保険	
INTESA SANPAOLO-RNC	9,349.15	9,349.15	2,899	385,763		銀行	
UNICREDIT SPA	1,124.65	511.78	165	22,009		銀行	
ENI SPA	378.24	1,426.64	2,527	336,338		銀行	
MEDIOBANCA SPA	1,889.83	1,772.97	2,382	317,017		石油・ガス・消耗燃料	
424.04	424.04	412	54,831			銀行	

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

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

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

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)	当期			末比 率
		口数	口数	外貨建金額	
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	5,587	7,304	876	93,707	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	11,168	11,168	1,289	137,791	0.0
SL GREEN	7,722	5,382	504	53,940	0.0
ANALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528	77,528	804	85,994	0.0
PROLOGIS INC	38,966	38,966	2,359	252,082	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,191	9,642	1,532	163,742	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285	6,285	508	54,326	0.0
EQUINIX INC	5,241	5,448	2,374	253,728	0.1
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544	10,544	390	41,756	0.0
DUKE REALTY TRUST	24,47	24,47	624	66,757	0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	25,117	28,166	2,967	317,114	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,283	4,524	1,016	108,656	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	27,07	27,07	1,534	163,929	0.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741	4,144	459	49,074	0.0
GGP INC	43,463	43,463	945	101,063	0.0
HCP INC	34.13	34.13	743	79,398	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	9,156	8,169	1,327	141,905	0.0
WELLTOWER INC	26,516	26,516	1,435	153,434	0.1
KIMCO REALTY	32.98	32.98	470	50,255	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649	11,649	458	48,983	0.0
IRON MOUNTAIN INC	19,265	19,265	639	68,326	0.0
THE MACERICH COMPANY	9,014	9,014	554	59,296	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146	51,147	1,004	107,343	0.0
MID AMERICA	8,123	8,123	713	76,255	0.0
REALTY INCOME CORP	20,047	18,985	913	97,582	0.0
REGENCY CENTERS CORP	7,365	11,294	651	69,588	0.0
UDR INC	21,797	17,458	589	63,037	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	23,516	21,825	3,363	359,371	0.1
PUBLIC STORAGE	11,151	11,151	2,082	222,566	0.1
VENTAS INC	27,031	25,041	1,242	132,777	0.0
VORNADO REALTY TRUST	12,211	12,211	806	86,225	0.0
WEYERHAEUSER CO	57,008	51,939	1,815	194,035	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	9.98	8,141	660	70,587	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	11,787	15,118	1,591	170,064	0.1
AGNC INVESTMENT CORP	25,741	25,741	485	51,905	0.0
VEREIT INC	59,654	72,429	501	53,636	0.0
AMERICAN TOWER CORP	31,665	30,693	4,158	444,354	0.2
INVITATION HOMES INC	—	22,567	481	51,413	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975	21,975	329	35,247	0.0
COLONY NORTHSTAR INC	39,311	39,311	326	34,866	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	893,594 39銘柄<2.0%>	910,976 40銘柄<1.7%>	45,537 —	4,866,126 — 1.7
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
SMARTCENTRES REIT	2,582	2,582	75	6,433	0.0
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748	10,748	216	18,475	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675	9,675	228	19,567	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	23,005 3銘柄<0.0%>	23,005 3銘柄<0.0%>	520 —	44,476 — 0.0

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率		
(オーストラリア) MIRVAC GROUP	千口 295,783	千口 295,783	千オーストラリア・ドル 621	千円 52,579	% 0.0		
GPT GROUP	144,955	144,955	687	58,161	0.0		
LENDLEASE GROUP	37,363	37,363	592	50,193	0.0		
STOCKLAND	193,279	126,459	503	42,604	0.0		
WESTFIELD CORP	140,035	140,035	1,191	100,877	0.0		
DEXUS	63,819	63,819	589	49,863	0.0		
GOODMAN GROUP	143,627	121,619	976	82,669	0.0		
VICINITY CENTRES	270,443	270,443	692	58,606	0.0		
SCENTRE GROUP	383,688	383,688	1,442	122,121	0.0		
小計	□数 銘柄 数<比率>	1,672,992 9銘柄<0.3%>	1,584,164 9銘柄<0.2%>	7,296 —	617,677 —	—	0.2
(香港) LINK REIT	千口 163.5	千口 163.5	千香港・ドル 10,701	千円 146,176	% 0.1		
小計	□数 銘柄 数<比率>	163.5 1銘柄<0.0%>	163.5 1銘柄<0.1%>	10,701 —	146,176 —	—	0.1
(シンガポール) CAPITALAND MALL TRUST	千口 199	千口 199	千シンガポール・ドル 390	千円 31,698	% 0.0		
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806	200,806	516	41,941	0.0		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211	—	—	—	—		
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	192.1	366	29,818	0.0		
小計	□数 銘柄 数<比率>	802,906 4銘柄<0.0%>	591,906 3銘柄<0.0%>	1,273 —	103,458 —	—	0.0
(イギリス) BRITISH LAND CO PLC	千口 71,871	千口 71,871	千イギリス・ポンド 456	千円 68,354	% 0.0		
HAMMERSON PLC	58,616	58,616	269	40,341	0.0		
LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231	37,974	353	52,900	0.0		
INTU PROPERTIES PLC	74,712	—	—	—	—		
SEGRO PLC	50,928	61,113	338	50,639	0.0		
小計	□数 銘柄 数<比率>	319,358 5銘柄<0.1%>	229,574 4銘柄<0.1%>	1,417 —	212,235 —	—	0.1
(フランス) GECINA SA	千口 3,212	千口 3,67	千ユーロ 545	千円 72,565	% 0.0		
ICADE	2,234	2,234	182	24,315	0.0		
KLEPIERRE	17,042	17,042	569	75,715	0.0		
FONCIERE DES REGIONS	2,343	2,343	202	26,904	0.0		
UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221	7,221	1,352	179,962	0.1		
小計	□数 銘柄 数<比率>	32,052 5銘柄<0.1%>	32,51 5銘柄<0.1%>	2,851 —	379,464 —	—	0.1
合計	□数 銘柄 数<比率>	3,907,407 66銘柄<2.6%>	3,535,635 65銘柄<2.2%>	— —	6,369,615 —	—	2.2

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

外 国	銘 柄 別	当 期		末	
		買 建	額	売 建	額
	S & P 500 E MINI FUT		百万円 4,164		百万円 -
	S & P / TSE 60 IX FUT		231		-
	SPI 200 FUTURES		159		-
	FTSE 100 INDEX FUTURE		439		-
	DJ EURO STOXX 50		1,145		-

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

■投資信託財産の構成

2018年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 272,128,639	% 95.3
投資信託受益証券、投資証券	6,369,615	2.2
コール・ローン等、その他	7,097,867	2.5
投資信託財産総額	285,596,122	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、284,523,453千円、99.6%です。

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年2月15日)現在

項	目	当期末
(A) 資	コ 一 ル 一 口 一 ナン等	286,028,819,817円
株	式(評価額)	4,727,724,506
投	272,128,639,179	
資	信 託 受 益 証	721,135,816
投	資 資 託 証	5,648,480,066
未	收 入 当 金	489,540,222
未	當 金	325,468,315
差	入 委 託 証 拠	1,987,831,713
負	金 債 金	1,580,686,821
未	金 債 金	602,788,821
未	金 債 金	977,898,000
(B)	払 解 約	
純	資 產 総 額(A-B)	284,448,132,996
元	資 產 総 額(A-B)	85,414,197,806
次	期 繰 越 損 益 金	199,033,935,190
(D)	受 益 權 總 口	85,414,197,806口
1	万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	33,302円

(注1) 期首元本額
追加設定元本額
一部解約元本額

(注2) 期末における元本の内訳

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

D IAMコア資産設計ファンド（堅実型）	402,135円
D IAMコア資産設計ファンド（積極型）	1,245,127円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	17,872,394円
ダイナミック・ナビゲーション	624,194円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	271,612,111円
ワールドアセットバランス（基本コース）	621,453,988円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,129,164,124円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	646,857円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	539,416円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	83,122円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	1,105,218円
D IAM 外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	94,680,639円
D IAM 外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	2,951,910,645円
D IAM 先進国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	161,173,877円
外国株式パッシブ・ファンド2（適格機関投資家限定）	208,770,312円
D IAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	23,652,082円
D IAMグローバル・バランスファン25VA（適格機関投資家限定）	104,000,380円
D IAMグローバル・バランスファン50VA（適格機関投資家限定）	229,337,941円
D IAM 国際分散バランスファン30VA（適格機関投資家限定）	12,671,338円
D IAM 国際分散バランスファン50VA（適格機関投資家限定）	82,511,736円
D IAM 国内重視バランスファン30VA（適格機関投資家限定）	7,737,512円
D IAM 国内重視バランスファン50VA（適格機関投資家限定）	12,881,312円
D IAM 世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	24,714,283円
D IAM 世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	67,799,257円
D IAM バランスファン25VA（適格機関投資家限定）	559,209,316円
D IAM バランスファン37.5VA（適格機関投資家限定）	694,323,847円
D IAM バランスファン50VA（適格機関投資家限定）	2,176,759,188円
D IAM グローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	788,664,451円
D IAM グローバル・アセット・バランス25VA（適格機関投資家限定）	228,926,672円
D IAM アクア グローバル バランスファン30VA（適格機関投資家限定）	931,210,759円
D IAM 世界アセットバランスファン30VA（適格機関投資家専用）	438,615,672円
D IAM ワールドバランスファン37.5VA（適格機関投資家専用）	2,754,975円
D IAM 世界バランスファン55VA（適格機関投資家限定）	135,785,141円
D IAM 世界バランスファン35VA（適格機関投資家限定）	366,032,274円
D IAM 世界アセットバランスファン25VA（適格機関投資家限定）	7,841,422,538円
D IAM 世界アセットバランスファン40VA（適格機関投資家限定）	423,028,871円
D IAM 世界アセットバランスファン25VA（適格機関投資家限定）	1,347,116,256円
D IAM 世界アセットバランスファン37.5VA（適格機関投資家限定）	5,122,879,137円
D IAM バランス30VA（適格機関投資家限定）	2,032,372円
D IAM バランス50VA（適格機関投資家限定）	28,378,177円
D IAM バランス70VA（適格機関投資家限定）	10,651,080円
D IAM 世界アセットバランスファン4VA（適格機関投資家限定）	6,836,511,901円
D IAM バランス20VA（適格機関投資家限定）	42,301,326円
D IAM バランス40VA（適格機関投資家限定）	36,544,094円
D IAM バランス60VA（適格機関投資家限定）	257,372円

期末元本合計

■損益の状況

当期 自2017年2月16日至2018年2月15日

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

(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)解約差損金はあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2018年2月21日）
 (計算期間 2017年2月22日～2018年2月21日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	シティ世界国債 インデックス (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	債券先物比率	純資産額
		期中騰落率	期中騰落率			
11期（2014年2月21日）	円 16,392	% 13.0	ポイント 102,469.19	% 12.6	% 97.6	百万円 383,685
12期（2015年2月23日）	18,820	14.8	117,697.87	14.9	97.5	— 345,838
13期（2016年2月22日）	17,881	△5.0	111,769.89	△5.0	97.6	— 267,780
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9	108,792.68	△2.7	97.9	— 248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	— 217,863

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックス LLCに帰属します（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

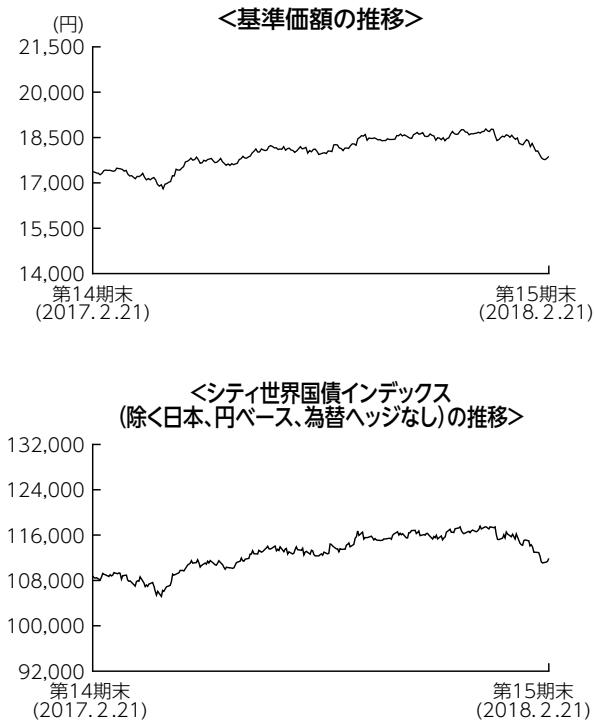
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	シティ世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率
		騰 落 率	(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)(ベンチマーク)		
(期 首) 2017 年 2 月 21 日	円 17,364	% —	ポイント 108,792.68	% —	% 97.9
2 月 末	17,314	△0.3	108,568.93	△0.2	97.3
3 月 末	17,317	△0.3	108,641.98	△0.1	96.8
4 月 末	17,422	0.3	109,024.53	0.2	96.9
5 月 末	17,684	1.8	110,685.94	1.7	97.7
6 月 末	18,019	3.8	112,709.17	3.6	98.4
7 月 末	18,008	3.7	112,671.90	3.6	98.2
8 月 末	18,265	5.2	114,354.58	5.1	98.1
9 月 末	18,469	6.4	115,558.22	6.2	97.8
10 月 末	18,471	6.4	115,508.10	6.2	97.4
11 月 末	18,487	6.5	115,672.53	6.3	97.9
12 月 末	18,719	7.8	117,078.37	7.6	98.1
2018 年 1 月 末	18,258	5.1	114,201.85	5.0	96.9
(期 末) 2018 年 2 月 21 日	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年2月22日から2018年2月21日まで）



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

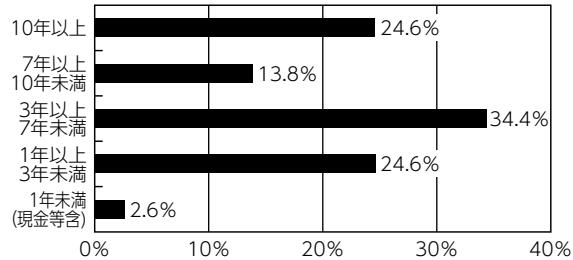
ベンチマークとリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

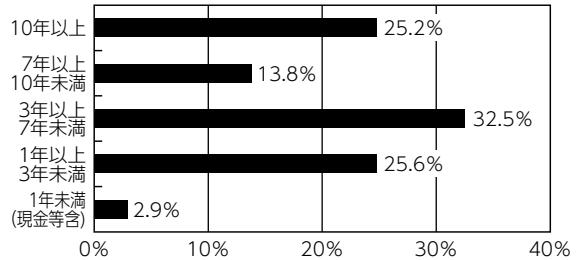
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米	米国	44.2%	△0.1%
	カナダ	2.2%	△0.0%
	計	46.4%	△0.2%
中南米	メキシコ	0.8%	△0.0%
	計	0.8%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.4%	△0.1%
	ベルギー	2.4%	△0.1%
	フィンランド	0.6%	△0.1%
	フランス	9.6%	△0.3%
	ドイツ	7.2%	△0.1%
	アイルランド	0.7%	△0.1%
	イタリア	9.2%	△0.2%
	オランダ	2.2%	△0.1%
	スペイン	5.4%	△0.2%
	ユーロ計	38.7%	△1.2%
	デンマーク	0.6%	△0.1%
	スウェーデン	0.4%	△0.1%
	スイス	0.0%	△0.2%
英國	英國	7.1%	△0.1%
	ポーランド	0.6%	△0.1%
	ノルウェー	0.2%	△0.1%
	計	47.5%	△1.7%
アジア・オセアニア	オーストラリア	2.1%	△0.0%
	シンガポール	0.4%	△0.0%
	マレーシア	0.4%	△0.1%
	計	2.8%	△0.1%
アフリカ	南アフリカ	0.5%	△0.0%
	計	0.5%	△0.0%
	現金など	2.1%	—
合計	100.0%	100.0%	—

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米	米国	41.3%	41.9%
	カナダ	2.1%	2.2%
	計	43.4%	44.1%
中南米	メキシコ	0.8%	0.8%
	計	0.8%	0.8%
欧州	オーストリア	1.6%	1.6%
	ベルギー	2.5%	2.7%
	フィンランド	0.6%	0.6%
	フランス	10.3%	10.5%
	ドイツ	7.1%	7.2%
	アイルランド	0.8%	0.9%
	イタリア	10.0%	10.2%
	オランダ	2.1%	2.1%
	スペイン	5.9%	6.1%
	ユーロ計	40.9%	41.9%
	デンマーク	0.6%	0.6%
	スウェーデン	0.5%	0.5%
	スイス	0.0%	0.2%
英國	英國	7.0%	7.3%
	ポーランド	0.7%	0.7%
	ノルウェー	0.3%	0.3%
	計	49.9%	51.4%
アジア・オセアニア	オーストラリア	2.2%	2.3%
	オセアニア	0.4%	0.4%
	シンガポール	0.4%	0.5%
	マレーシア	0.4%	0.5%
アフリカ	計	2.9%	3.1%
	南アフリカ	0.6%	0.6%
	計	0.6%	0.6%
現金など	現金など	2.3%	—
	合計	100.0%	100.0%

(注) 世界国債インデックスとはシティ世界国債インデックス（除く日本）です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.8%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で+0.1%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスになりました。なお、乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	2円 (2) (0)	0.012% (0.010) (0.001)
合 計	2	0.012

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(18,042円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2017年2月22日から2018年2月21日まで）

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 184,922	千アメリカ・ドル 293,487
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 14,554	千カナダ・ドル 20,648
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 7,723	千オーストラリア・ドル 10,364
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,611	千シンガポール・ドル 2,641
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 12,285	千イギリス・ポンド 32,531
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 3,570	千デンマーク・クローネ 14,678
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 7,841	千ノルウェー・クローネ 660
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 7,996	千スウェーデン・クローナ 10,435
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 39,926	千メキシコ・ペソ 79,526
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 1,908	千マレーシア・リンギット 6,039
国	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 14,403	千南アフリカ・ランド 19,987
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 9,062	千ポーランド・ズロチ 14,268
	アイルランド	国債証券	千ユーロ 1,949	千ユーロ 3,818
	オランダ	国債証券	3,472	12,666
	ベルギー	国債証券	3,044	10,672
	フランス	国債証券	17,867	46,456
	ドイツ	国債証券	16,502	42,841
	スペイン	国債証券	13,469	27,530
	イタリア	国債証券	17,625	44,913
	フィンランド	国債証券	687	2,167
	オーストリア	国債証券	2,994	4,836

(注) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

■利害関係人との取引状況等（2017年2月22日から2018年2月21日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区分	当期						末		
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 846,210	千アメリカ・ドル 837,189	千円 90,031,363	% 41.3	% -	% 16.9	% 15.7	% 8.8	
カナダ	千カナダ・ドル 50,650	千カナダ・ドル 53,987	千円 4,590,516	2.1	-	0.9	0.7	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 52,700	千オーストラリア・ドル 55,466	千円 4,706,926	2.2	-	1.4	0.6	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,250	千シンガポール・ドル 9,550	千円 778,949	0.4	-	0.2	0.2	-	
イギリス	千イギリス・ポンド 83,200	千イギリス・ポンド 101,610	千円 15,301,492	7.0	-	5.0	1.5	0.5	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 57,770	千デンマーク・クローネ 70,609	千円 1,257,549	0.6	-	0.4	0.1	0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 43,360	千ノルウェー・クローネ 45,354	千円 622,265	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 66,280	千スウェーデン・クローナ 74,882	千円 994,434	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 287,000	千メキシコ・ペソ 292,501	千円 1,681,884	0.8	-	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 33,430	千マレーシア・リンギット 33,363	千円 918,489	0.4	-	0.2	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 155,240	千南アフリカ・ランド 148,622	千円 1,362,871	0.6	-	0.6	0.0	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 43,900	千ポーランド・ズロチ 45,657	千円 1,459,674	0.7	-	0.2	0.4	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	11,690	13,006	1,725,608	0.8	-	0.5	0.2	0.1	
オランダ	29,660	34,239	4,542,619	2.1	-	1.3	0.6	0.2	
ベルギー	34,830	41,872	5,555,222	2.5	-	1.8	0.6	0.2	
フランス	144,580	169,206	22,448,608	10.3	-	6.6	2.7	1.0	
ドイツ	101,280	116,732	15,486,921	7.1	-	4.0	2.3	0.9	
スペイン	83,630	97,575	12,945,318	5.9	-	3.8	1.5	0.7	
イタリア	144,250	163,824	21,734,606	10.0	-	5.9	2.9	1.2	
フィンランド	8,700	9,556	1,267,806	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
オーストリア	21,660	25,571	3,392,630	1.6	-	1.0	0.4	0.2	
合計	-	-	千円 212,805,760	97.7	-	51.7	31.3	14.6	

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

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

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)公社債銘柄別

銘 柄	当 期					末
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)						
US T N/B 2.125 01/31/21	国債証券	2.1250	5,000	4,959	533,328	2021/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	5,000	4,791	515,267	2023/01/31
US T N/B 1.375 01/31/20	国債証券	1.3750	8,600	8,456	909,445	2020/01/31
US T N/B 1.25 01/31/20	国債証券	1.2500	10,800	10,594	1,139,376	2020/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	3,200	3,923	421,931	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,800	1,801	193,722	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	3,600	3,592	386,385	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	5,000	4,389	472,079	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,300	1,387	149,193	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	1,000	1,218	130,988	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,500	1,892	203,571	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	2,000	2,415	259,709	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,800	2,286	245,849	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	5,000	5,425	583,485	2044/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	17,500	17,132	1,842,391	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	750	899	96,678	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	2,800	3,488	375,119	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	5,500	5,009	538,699	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	5,500	4,845	521,090	2045/02/15
US T N/B 2.75 02/15/19	国債証券	2.7500	12,000	12,077	1,298,842	2019/02/15
US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	3.6250	17,000	17,444	1,876,023	2020/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	5,200	5,045	542,560	2047/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	9,400	9,399	1,010,795	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	9,500	9,001	967,994	2025/02/15
US T N/B 1.375 02/28/19	国債証券	1.3750	13,000	12,907	1,388,024	2019/02/28
US T N/B 3.625 02/15/21	国債証券	3.6250	5,500	5,688	611,775	2021/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	9,500	9,210	990,460	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	12,000	11,375	1,223,323	2027/02/15
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	11,700	11,325	1,217,904	2022/03/31
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2.2500	11,500	11,432	1,229,462	2021/03/31
US T N/B 1.625 03/31/19	国債証券	1.6250	15,000	14,919	1,604,453	2019/03/31
US T N/B 1.375 03/31/20	国債証券	1.3750	6,300	6,182	664,846	2020/03/31
US T N/B 1.375 04/30/20	国債証券	1.3750	12,000	11,761	1,264,863	2020/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	1,400	1,875	201,668	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	2,000	2,412	259,489	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	2,000	2,418	260,094	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	2,270	2,222	239,023	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	1,630	1,928	207,443	2039/05/15
US T N/B 3.125 05/15/19	国債証券	3.1250	13,000	13,152	1,414,446	2019/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	4,700	4,482	482,061	2043/05/15
US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	3.5000	14,000	14,363	1,544,599	2020/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	5,200	5,412	582,051	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	5,000	4,862	522,913	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	6,900	6,688	719,297	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	4,400	3,861	415,245	2046/05/15

銘柄	利回り	当期			期末	
		種類	利回り	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円
US T N/B 1.125 05/31/19	国債証券	1.1250	11,000	10,860	1,167,963	2019/05/31
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	11,600	11,214	1,206,035	2022/05/15
US T N/B 1.375 05/31/20	国債証券	1.3750	3,500	3,426	368,478	2020/05/31
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	1,100	1,341	144,216	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	7,000	6,681	718,581	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	9,000	8,857	952,577	2024/05/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.1250	8,000	8,161	877,655	2021/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	5,000	4,767	512,745	2025/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	6,000	5,740	617,307	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	800	1,029	110,685	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	8,500	7,716	829,820	2026/05/15
US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	2.0000	12,000	11,821	1,271,264	2021/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	10,000	9,549	1,026,920	2024/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	7,000	6,541	703,465	2023/06/30
US T N/B 1.875 06/30/20	国債証券	1.8750	11,000	10,885	1,170,601	2020/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	9,500	9,315	1,001,749	2022/06/30
US T N/B 0.875 07/31/19	国債証券	0.8750	15,000	14,725	1,583,531	2019/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,181	127,064	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	2,000	2,212	237,880	2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	1,800	2,218	238,577	2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	2,100	2,363	254,221	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	2,800	2,618	281,539	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	4,600	4,582	492,749	2044/08/15
US T N/B 8.125 08/15/19	国債証券	8.1250	4,000	4,349	467,747	2019/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	1,400	1,713	184,242	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	4,200	4,555	489,879	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	4,900	4,648	499,855	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	9,000	8,487	912,730	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	6,100	5,620	604,432	2047/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.1250	11,000	10,861	1,168,058	2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	8,000	7,916	851,372	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	8,900	8,676	933,101	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	4,500	3,735	401,734	2046/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	8,000	7,560	813,062	2027/08/15
US T N/B 3.625 08/15/19	国債証券	3.6250	5,000	5,103	548,851	2019/08/15
US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	2.6250	16,500	16,607	1,785,979	2020/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	7,000	6,266	673,851	2026/08/15
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	9,500	9,104	979,119	2022/08/15
US T N/B 1.0 08/31/19	国債証券	1.0000	13,500	13,259	1,425,977	2019/08/31
US T N/B 2.125 08/31/20	国債証券	2.1250	3,000	2,982	320,752	2020/08/31
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	12,000	11,620	1,249,636	2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	10,000	9,455	1,016,833	2024/08/31
US T N/B 1.0 09/30/19	国債証券	1.0000	15,000	14,719	1,582,902	2019/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	10,000	9,862	1,060,613	2021/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	10,000	9,589	1,031,201	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	11,000	10,233	1,100,500	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	12,500	12,026	1,293,302	2022/09/30
US T N/B 2.0 09/30/20	国債証券	2.0000	6,000	5,945	639,336	2020/09/30

銘柄	当期				末	
	種類	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.75 10/31/20	国債証券	1.7500	6,000	5,902	634,703	2020/10/31
US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	1.2500	15,000	14,762	1,587,516	2019/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	6,000	7,167	770,803	2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,500	1,821	195,852	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	1,400	1,782	191,663	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	5,100	4,961	533,585	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	2,000	2,373	255,271	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	3,400	3,175	341,467	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,800	1,801	193,752	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	4,900	5,424	583,302	2043/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	3,900	3,789	407,574	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	4,400	4,164	447,851	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	10,600	10,233	1,100,471	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,660	1,999	215,055	2039/11/15
US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	2.6250	6,000	6,037	649,272	2020/11/15
US T N/B 3.375 11/15/19	国債証券	3.3750	4,000	4,078	438,578	2019/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	10,400	10,205	1,097,479	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	10,000	9,575	1,029,770	2025/11/15
US T N/B 2.0 11/30/20	国債証券	2.0000	10,500	10,390	1,117,426	2020/11/30
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	7,500	7,165	770,569	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	10,000	10,015	1,077,077	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	7,000	6,511	700,198	2026/11/15
US T N/B 1.0 11/30/19	国債証券	1.0000	6,500	6,362	684,260	2019/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	2,100	1,981	213,112	2027/11/15
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	2,500	2,433	261,685	2023/12/31
US T N/B 2.375 12/31/20	国債証券	2.3750	8,300	8,294	891,948	2020/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	15,700	15,454	1,661,988	2021/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	8,000	7,809	839,818	2022/12/31
US T N/B 1.75 12/31/20	国債証券	1.7500	9,000	8,839	950,612	2020/12/31
小計	—	—	846,210	837,189	90,031,363	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 1.75 03/01/19	国債証券	1.7500	1,100	1,101	93,664	2019/03/01
CANADA 1.5 03/01/20	国債証券	1.5000	2,300	2,285	194,313	2020/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	600	589	50,125	2023/03/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,700	1,599	135,976	2026/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	1,000	1,471	125,146	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,600	2,132	181,353	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	1,550	2,204	187,411	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	1,600	2,216	188,502	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,600	1,628	138,438	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	1,800	2,278	193,725	2041/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	4,700	4,889	415,742	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	3,900	4,011	341,117	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	2,300	2,228	189,469	2023/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,500	1,500	127,585	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	800	712	60,558	2027/06/01
CANADA 3.5 06/01/20	国債証券	3.5000	3,800	3,937	334,794	2020/06/01
CANADA 3.75 06/01/19	国債証券	3.7500	3,700	3,795	322,712	2019/06/01

銘柄	当期				末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.75 08/01/19	国債証券	0.7500	7,200	7,098	603,571	2019/08/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	600	574	48,880	2021/09/01
CANADA 0.75 09/01/20	国債証券	0.7500	2,400	2,333	198,386	2020/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	800	762	64,871	2022/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	1,900	2,282	194,110	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	1,450	1,537	130,703	2048/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	750	815	69,354	2064/12/01
小計	—	—	50,650	53,987	4,590,516	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	1,250	1,134	96,297	2047/03/21
AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	国債証券	5.2500	2,600	2,692	228,508	2019/03/15
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	3,100	3,205	272,028	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	3,600	4,148	352,032	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	3,100	3,123	265,094	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	3,600	3,980	337,823	2026/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	4.5000	3,800	3,995	339,026	2020/04/15
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	3,000	3,437	291,664	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	3,100	3,191	270,810	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,500	1,749	148,469	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	1,500	1,597	135,532	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	2,400	2,261	191,912	2028/05/21
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.7500	3,700	4,106	348,516	2021/05/15
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	900	884	75,050	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	900	841	71,398	2035/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	4,000	4,564	387,314	2022/07/15
AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	国債証券	2.7500	1,500	1,519	128,958	2019/10/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	2,700	2,657	225,476	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	2,900	2,863	242,988	2027/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国債証券	1.7500	2,400	2,374	201,513	2020/11/21
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券	2.0000	1,150	1,137	96,507	2021/12/21
小計	—	—	52,700	55,466	4,706,926	—
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	900	982	80,168	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	410	403	32,908	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	550	544	44,431	2042/04/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	500	503	41,024	2025/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	400	414	33,808	2029/07/01
SINGAPORE 2.0 07/01/20	国債証券	2.0000	800	805	65,685	2020/07/01
SINGAPORE 3.25 09/01/20	国債証券	3.2500	1,340	1,389	113,366	2020/09/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	810	847	69,135	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	1,600	1,680	137,086	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	460	475	38,755	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	480	523	42,689	2033/09/01
SINGAPORE 1.25 10/01/21	国債証券	1.2500	1,000	979	79,888	2021/10/01
小計	—	—	9,250	9,550	778,949	—
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	2,800	3,521	530,227	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	2,650	3,490	525,606	2045/01/22

銘 柄	当 期				末	
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国 債 証 券	4.0000	1,700	2,818	424,427	2060/01/22
UK TREASURY 1.5 01/22/21	国 債 証 券	1.5000	2,700	2,750	414,163	2021/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国 債 証 券	5.0000	2,030	2,531	381,208	2025/03/07
UK TREASURY 4.5 03/07/19	国 債 証 券	4.5000	400	416	62,683	2019/03/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国 債 証 券	4.0000	2,300	2,577	388,141	2022/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国 債 証 券	4.2500	2,450	3,331	501,728	2036/03/07
UK TREASURY 4.75 03/07/20	国 債 証 券	4.7500	1,850	2,001	301,405	2020/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国 債 証 券	4.2500	1,850	2,417	364,119	2032/06/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国 債 証 券	8.0000	1,700	2,092	315,119	2021/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国 債 証 券	1.5000	2,000	1,798	270,851	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国 債 証 券	3.7500	2,100	3,097	466,484	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国 債 証 券	1.7500	1,000	986	148,572	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国 債 証 券	2.5000	1,650	2,050	308,857	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国 債 証 券	3.5000	2,000	3,180	478,996	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国 債 証 券	1.5000	2,400	2,406	362,388	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国 債 証 券	1.2500	2,000	1,941	292,349	2027/07/22
UK TREASURY 2.0 07/22/20	国 債 証 券	2.0000	1,700	1,749	263,442	2020/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国 債 証 券	0.5000	2,350	2,295	345,623	2022/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/19	国 債 証 券	1.7500	4,400	4,467	672,793	2019/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国 債 証 券	4.2500	1,700	2,388	359,633	2039/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/21	国 債 証 券	3.7500	1,850	2,033	306,283	2021/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国 債 証 券	2.2500	2,800	2,961	445,896	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国 債 証 券	2.7500	2,000	2,184	328,921	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国 債 証 券	2.0000	2,400	2,510	378,001	2025/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国 債 証 券	3.7500	2,900	3,115	469,136	2020/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/19	国 債 証 券	3.7500	2,200	2,304	346,965	2019/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国 債 証 券	4.5000	2,350	3,229	486,346	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国 債 証 券	1.7500	900	872	131,315	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国 債 証 券	1.7500	3,150	3,248	489,153	2022/09/07
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国 債 証 券	6.0000	1,350	1,934	291,262	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国 債 証 券	4.7500	1,800	2,669	401,984	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国 債 証 券	4.5000	2,200	3,292	495,754	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国 債 証 券	4.2500	2,080	3,123	470,435	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国 債 証 券	4.2500	2,040	3,394	511,186	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国 債 証 券	4.2500	1,700	2,111	318,045	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国 債 証 券	4.2500	1,980	2,813	423,667	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国 傾 証 券	4.7500	1,700	2,282	343,709	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国 傾 証 券	4.2500	2,070	3,218	484,601	2049/12/07
小計	—	—	83,200	101,610	15,301,492	—
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 4.5 11/15/39	国 債 証 券	4.5000	14,900	24,067	428,647	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国 債 証 券	1.7500	13,470	14,710	261,988	2025/11/15
DENMARK 4.0 11/15/19	国 債 証 券	4.0000	7,900	8,526	151,849	2019/11/15
DENMARK 3.0 11/15/21	国 債 証 券	3.0000	13,000	14,500	258,248	2021/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国 債 証 券	1.5000	5,500	5,888	104,865	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国 債 証 券	0.5000	3,000	2,916	51,949	2027/11/15
小計	—	—	57,770	70,609	1,257,549	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORWAY 1.5 02/19/26	国 債 証 券	1.5000	6,000	5,870	80,539	2026/02/19

銘柄	種類	利 率	額面金額	当期		末償還年月日
				評価額	外貨建金額邦貨換算金額	
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	500	493	6,776	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	7,400	8,012	109,936	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,810	52,278	2025/03/13
NORWAY 4.5 05/22/19	国債証券	4.5000	6,560	6,876	94,350	2019/05/22
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	7,600	7,815	107,223	2023/05/24
NORWAY 3.75 05/25/21	国債証券	3.7500	11,500	12,475	171,159	2021/05/25
小計	—	—	43,360	45,354	622,265	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千円		
SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	4.2500	8,800	9,268	123,079	2019/03/12
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	6,200	8,329	110,613	2039/03/30
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	10,300	11,771	156,319	2025/05/12
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	12,870	14,822	196,846	2022/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	9,700	10,382	137,884	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	7,000	7,171	95,232	2026/11/12
SWEDEN 5.0 12/01/20	国債証券	5.0000	11,410	13,136	174,458	2020/12/01
小計	—	—	66,280	74,882	994,434	—
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千円		
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	5,000	4,417	25,401	2026/03/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	31,000	32,705	188,059	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	10,000	9,955	57,242	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	10,000	9,852	56,649	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	26,000	24,902	143,186	2022/06/09
MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	6.5000	38,000	36,733	211,215	2021/06/10
MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	8,0000	30,000	30,232	173,835	2020/06/11
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	22,000	21,673	124,622	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8,0000	5,000	5,046	29,016	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,000	15,951	91,721	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10,0000	13,000	15,722	90,404	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	6,944	39,929	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10,0000	35,000	39,314	226,056	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8,0000	14,000	14,212	81,721	2023/12/07
MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	国債証券	5,0000	26,000	24,838	142,821	2019/12/11
小計	—	—	287,000	292,501	1,681,884	—
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千円		
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	779	21,447	2027/03/15
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,200	33,057	2023/03/15
MALAYSIA 3.492 03/31/20	国債証券	3.4920	2,200	2,205	60,717	2020/03/31
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,116	85,791	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	1,803	49,646	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,850	1,766	48,632	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,124	30,963	2033/04/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	2,570	2,419	66,596	2027/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	1,937	53,350	2028/06/15
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.1600	5,500	5,618	154,679	2021/07/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	1,430	1,447	39,840	2024/07/15
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	2,954	81,337	2022/08/15
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,600	1,717	47,280	2028/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,500	1,526	42,029	2043/09/30

銘柄	種類	当期			末	
		利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア) MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	%	千マレーシア・リンギット 4,3780	千マレーシア・リンギット 3,680	千円 3,745	千円 103,117
小計	-	-	33,430	33,363	918,489	2019/11/29
(南アフリカ)		%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	国債証券	8,0000	13,110	12,597	115,522	2030/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8,7500	10,000	9,622	88,233	2044/01/31
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9,0000	8,000	7,924	72,663	2040/01/31
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8,5000	10,910	10,394	95,317	2037/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8,7500	17,000	16,383	150,234	2048/02/28
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6,5000	11,760	8,836	81,028	2041/02/28
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7,7500	10,000	10,134	92,929	2023/02/28
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7,0000	11,600	10,118	92,788	2031/02/28
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8,8750	3,000	2,981	27,339	2035/02/28
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8,2500	10,000	9,614	88,164	2032/03/31
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6,2500	14,700	11,184	102,563	2036/03/31
SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	国債証券	6,7500	10,160	10,087	92,505	2021/03/31
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10,5000	25,000	28,743	263,580	2026/12/21
小計	-	-	155,240	148,622	1,362,871	-
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5,7500	1,440	1,761	56,309	2029/04/25
POLAND 1.5 04/25/20	国債証券	1,5000	3,000	2,989	95,583	2020/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2,2500	4,000	3,964	126,754	2022/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2,5000	4,200	3,954	126,425	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3,2500	4,700	4,713	150,702	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2,5000	2,300	2,133	68,207	2027/07/25
POLAND 1.75 07/25/21	国債証券	1,7500	2,200	2,170	69,391	2021/07/25
POLAND 3.25 07/25/19	国債証券	3,2500	2,500	2,562	81,921	2019/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5,7500	3,200	3,639	116,350	2022/09/23
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5,2500	6,890	7,499	239,745	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5,7500	3,680	4,126	131,932	2021/10/25
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4,0000	3,100	3,284	105,018	2023/10/25
POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	5,5000	2,690	2,856	91,331	2019/10/25
小計	-	-	43,900	45,657	1,459,674	-
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2,0000	890	918	121,816	2045/02/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3,4000	930	1,093	145,083	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5,4000	1,260	1,669	221,532	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3,9000	700	829	110,004	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0,8000	1,150	1,185	157,336	2022/03/15
IRISH 4.5 04/18/20	国債証券	4,5000	1,130	1,250	165,923	2020/04/18
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2,4000	1,100	1,236	164,030	2030/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1,0000	1,350	1,363	180,940	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1,7000	750	753	99,960	2037/05/15
IRISH 4.4 06/18/19	国債証券	4,4000	480	511	67,810	2019/06/18
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5,0000	1,000	1,143	151,681	2020/10/18
IRISH 5.9 10/18/19	国債証券	5,9000	950	1,051	139,487	2019/10/18
小計	-	-	11,690	13,006	1,725,608	-
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3,7500	1,800	2,702	358,581	2042/01/15

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

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

銘柄	当期				末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,500	1,636	217,164	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	3,500	3,388	449,578	2027/02/15
BUNDESSCHAT 03/15/19	国債証券	—	2,600	2,618	347,435	2019/03/15
BUNDESOBL 0.5 04/12/19	国債証券	0.5000	3,100	3,141	416,796	2019/04/12
BUNDESOBL 04/09/21	国債証券	—	2,200	2,223	294,991	2021/04/09
BUNDESOBL 04/08/22	国債証券	—	3,000	3,016	400,171	2022/04/08
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	2,000	2,153	285,736	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	2,500	2,685	356,225	2023/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,750	2,680	355,667	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,420	1,987	263,648	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,660	2,605	345,685	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,850	2,602	345,318	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,700	3,389	449,652	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	2,000	3,371	447,267	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	3,150	3,527	468,001	2021/07/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.0000	3,000	3,249	431,108	2020/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	2,400	2,595	344,332	2022/07/04
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	国債証券	3.5000	4,400	4,650	616,963	2019/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	2,400	3,726	494,433	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,700	3,423	454,151	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	3,200	3,335	442,553	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	1,700	1,672	221,826	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	—	2,800	2,671	354,376	2026/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	1,500	1,652	219,285	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	2,600	2,718	360,623	2024/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	3,100	3,374	447,753	2021/09/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.2500	4,200	4,490	595,750	2020/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	3,400	3,642	483,208	2022/09/04
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	国債証券	0.2500	1,500	1,527	202,684	2020/10/16
小計	—	—	101,280	116,732	15,486,921	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	2,700	3,296	437,290	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	3,000	4,305	571,247	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	2,200	2,722	361,234	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	2,380	3,099	411,223	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	2,800	3,472	460,726	2023/01/31
SPAIN 0.05 01/31/21	国債証券	0.0500	400	400	53,113	2021/01/31
SPAIN 1.4 01/31/20	国債証券	1.4000	400	412	54,704	2020/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	2,500	2,604	345,535	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	2,700	3,190	423,227	2024/04/30
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.5000	3,600	4,223	560,358	2021/04/30
SPAIN 4.0 04/30/20	国債証券	4.0000	4,000	4,363	578,913	2020/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,600	2,613	346,666	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	2,500	2,634	349,495	2026/04/30
SPAIN 2.75 04/30/19	国債証券	2.7500	1,400	1,452	192,647	2019/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	2,200	2,206	292,778	2022/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	2,500	3,423	454,132	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	2,000	2,866	380,232	2040/07/30

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

銘柄	種類	当期			末	
		利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,275	301,857	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,300	1,299	172,346	2027/08/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	2,050	2,668	354,063	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	2,000	2,073	275,080	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	2,400	2,970	394,045	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	2,750	3,647	483,963	2040/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	3,900	4,495	596,421	2021/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,100	1,077	142,984	2033/09/01
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債証券	4.0000	3,700	4,066	539,476	2020/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,900	2,178	288,989	2024/09/01
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	国債証券	4.2500	6,400	6,837	907,148	2019/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	3,900	4,726	627,078	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,500	1,395	185,194	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	1,500	1,546	205,144	2022/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	2,100	2,047	271,680	2023/10/15
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,900	2,724	361,523	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	1,800	2,574	341,516	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	3,300	4,593	609,432	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	3,500	4,552	604,019	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	2,500	3,039	403,260	2022/11/01
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	国債証券	0.6500	3,600	3,651	484,441	2020/11/01
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国債証券	0.3500	1,700	1,696	225,056	2021/11/01
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	2,700	2,751	364,982	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	2,000	1,893	251,189	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	4,000	4,265	565,885	2024/12/01
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2.1500	2,200	2,337	310,116	2021/12/15
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	国債証券	1.0500	2,000	2,042	271,028	2019/12/01
小計	—	—	144,250	163,824	21,734,606	—
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	680	747	99,193	2024/04/15
FINLAND 3.5 04/15/21	国債証券	3.5000	700	782	103,756	2021/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	450	430	57,150	2031/04/15
FINLAND 3.375 04/15/20	国債証券	3.3750	980	1,060	140,641	2020/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	600	592	78,626	2026/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	1,150	1,227	162,853	2023/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	800	999	132,659	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	630	747	99,192	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	660	834	110,693	2042/07/04
FINLAND 4.375 07/04/19	国債証券	4.3750	620	662	87,840	2019/07/04
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	300	306	40,685	2025/09/15
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	400	428	56,905	2022/09/15
FINLAND 09/15/23	国債証券	—	230	226	30,052	2023/09/15
FINLAND 0.375 09/15/20	国債証券	0.3750	500	509	67,554	2020/09/15
小計	—	—	8,700	9,556	1,267,806	—
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	820	1,353	179,624	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	230	225	29,902	2047/02/20
AUSTRIA 4.35 03/15/19	国債証券	4.3500	1,050	1,104	146,550	2019/03/15

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

■投資信託財産の構成

2018年2月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公 社 債	千円	%
コール・ローン等、その他	212,805,760	97.6
投 資 信 託 財 産 総 額	5,129,614	2.4
	217,935,374	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、217,710,466千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.54円、1カナダ・ドル=85.03円、1オーストラリア・ドル=84.86円、1シンガポール・ドル=81.56円、1イギリス・ポンド=150.59円、1イスラエル・ペソ=114.92円、1デンマーク・クローネ=17.81円、1ノルウェー・クローネ=13.72円、1スウェーデン・クローナ=13.28円、1メキシコ・ペソ=5.75円、1マレーシア・リンギット=27.53円、1南アフリカ・ランド=9.17円、1ポーランド・ズロチ=31.97円、1ユーロ=132.67円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年2月21日)現在

項	目	当期末
(A) 資	産	218,310,227,233円
コ ー ル 一 社	債(評価額)	3,270,760,374
未 収 未 収 前 払	入 利 用 費	212,805,760,129 374,880,520 1,828,216,079 30,610,131
(B) 負	債	447,097,960
未 未 未 払	金 金 約	374,852,960 72,245,000
(C) 純	資産総額(A-B)	217,863,129,273
元	日本	121,875,729,918
次 期 繰 越 損 益 益	金 益 益	95,987,399,355
(D) 受	権総口数	121,875,729,918口
1万口当たり	基準価額(C/D)	17,876円

(注1) 期首元本額 143,106,772,360円

追加設定元本額 24,631,114,274円

一部解約元本額 45,862,156,716円

(注2) 期末における元本の内訳

D IAM 外国債券パッシブ・ファンド 8,180,656,532円

MITO ラップ型ファンド(安定型) 16,550,949円

MITO ラップ型ファンド(中立型) 44,049,191円

MITO ラップ型ファンド(積極型) 50,607,050円

グローバル8資産ラップファンド(安定型) 84,070,384円

グローバル8資産ラップファンド(中立型) 72,228,889円

グローバル8資産ラップファンド(積極型) 35,964,363円

たわらノーロード 先進国債券 1,535,100,824円

たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け> 606,412円

たわらノーロード バランス(8資産均等型) 18,990,483円

たわらノーロード バランス(堅実型) 148,917円

たわらノーロード バランス(標準型) 1,062,375円

たわらノーロード バランス(積極型) 485,021円

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型) 27,649円

たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型) 479,499円

たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型) 494,676円

たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型) 133,194円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型) 56,026円

たわらノーロード 最適化バランス(成型) 331,864円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型) 181,560円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型) 255,754円

D IAM 外国債券インデックスファンド<DC年金> 5,036,271,157円

D IAM バランス・ファンド<DC年金>1 安定型 474,597,820円

D IAM バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型 1,515,570,262円

D IAM バランス・ファンド<DC年金>3 成長型 1,682,020,108円

D IAM DC バランス30インデックスファンド 366,252,324円

D IAM DC バランス50インデックスファンド 780,311,672円

D IAM DC バランス70インデックスファンド 633,352,049円

マネックス資産設計ファンド(隔月分配型) 23,441,361円

マネックス資産設計ファンド(育成型) 585,178,050円

マネックス資産設計ファンド エボリューション 6,898,943円

D IAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) 17,867,916円

D IAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) 39,193,230円

D IAM DC 8資産バランスファンド(新興国30) 71,081,407円

クルーズコントロール 471,522,151円

D IAM 8資産バランスファンドN<DC年金> 67,264,964円

D IAM DC バランス・F (成長型)

119,784,654円

クルーズコントロール<DC年金> 175,031円

D IAM コア資産設計ファンド (堅実型) 1,547,650円

D IAM コア資産設計ファンド (積極型) 4,761,061円

ダイナミック・ナビゲーション 116,328円

D IAM パッシブ資産分散ファンド 1,427,367,462円

D IAM 为替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) 6,984,591,409円

D IAM 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け) 4,074,076,473円

外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) 3,765,907,771円

先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) 576,382,992円

D IAM ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 107,448,126円

D IAM プローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 971,191,594円

D IAM グローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 712,187,045円

D IAM 国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 57,495,581円

D IAM 国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 107,057,634円

D IAM 国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 26,555,966円

D IAM 国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 12,520,379円

D IAM 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 72,192,093円

D IAM 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 85,457,559円

D IAM バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 3,803,080,276円

D IAM バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 2,505,827,352円

D IAM バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 4,224,822,451円

D IAM グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) 766,253,872円

D IAM プローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) 516,627,848円

D IAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 3,600,829,521円

D IAM 世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) 9,268,529,264円

D IAM グローバルB私募ファンド (適格機関投資家向け) 13,975,529円

D IAM 世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 85,144,612円

D IAM 世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定) 3,043,371,686円

D IAM 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 15,217,078,121円

D IAM 世界アセットバランス3VA (適格機関投資家限定) 19,907,287,350円

D IAM バランス30VA (適格機関投資家限定) 2,361,904円

D IAM バランス50VA (適格機関投資家限定) 34,508,457円

D IAM バランス70VA (適格機関投資家限定) 5,621,656円

D IAM 世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 17,709,441,950円

D IAM 世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 107,909,809円

D IAM バランス20VA (適格機関投資家限定) 83,137,353円

D IAM バランス40VA (適格機関投資家限定) 59,633,095円

D IAM バランス60VA (適格機関投資家限定) 165,250円

期末元本合計 121,875,729,918円

■損益の状況

当期 自2017年2月22日 至2018年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第11期（決算日 2018年6月22日）

(計算期間 2017年6月23日～2018年6月22日)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年1月16日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジあり) (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰落率	中騰落率			
7期(2014年6月23日)	円 12,420	% 4.5	ポイント 356.26	% 4.6	% 98.2	% 173,324
8期(2015年6月22日)	12,930	4.1	371.27	4.2	98.1	179,224
9期(2016年6月22日)	13,626	5.4	391.61	5.5	92.9	164,686
10期(2017年6月22日)	13,477	△1.1	387.96	△0.9	97.9	177,029
11期(2018年6月22日)	13,246	△1.7	381.67	△1.6	98.0	290,732

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）です（以下同じ）。

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

(注4) △(白三角)はマイナスを意味しています（以下同じ）。

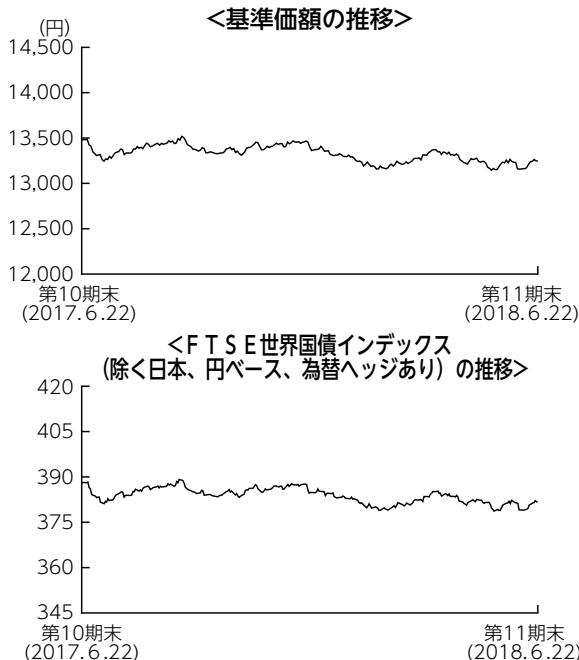
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	F T S E 世界国債 イ ン デ ッ ク ス	騰 落 率	債券組入比	債券先物比
			(除く日本、 円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)			
(期 首) 2017 年 6 月 22 日	円 13,477	% —	ポイント 387.96	% —	% 97.9	% —
6 月 末	13,348	△1.0	384.17	△1.0	99.0	—
7 月 末	13,334	△1.1	383.87	△1.1	97.0	—
8 月 末	13,455	△0.2	387.34	△0.2	97.7	—
9 月 末	13,337	△1.0	383.97	△1.0	100.3	—
10 月 末	13,389	△0.7	385.49	△0.6	96.9	—
11 月 末	13,404	△0.5	385.93	△0.5	96.9	—
12 月 末	13,384	△0.7	385.27	△0.7	98.0	—
2018 年 1 月 末	13,241	△1.8	381.24	△1.7	96.0	—
2 月 末	13,190	△2.1	379.88	△2.1	94.7	—
3 月 末	13,368	△0.8	385.14	△0.7	97.6	—
4 月 末	13,241	△1.8	381.47	△1.7	99.4	—
5 月 末	13,227	△1.9	381.19	△1.7	94.6	—
(期 末) 2018 年 6 月 22 日	13,246	△1.7	381.67	△1.6	98.0	—

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年6月23日から2018年6月22日まで）



基準価額の推移

基準価額は13,246円となり、前期末比で1.7%下落しました。

基準価額の主な変動要因

堅調な経済成長を続けている米国で利上げが継続し、米国債利回りが上昇（価格は下落）したことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは上昇し、欧州債の利回りは概ねレンジ内での推移となりました。米国では2017年夏に北朝鮮情勢の緊迫化等から一時利回りが低下する局面もありましたが、堅調な経済情勢を背景に2017年12月以降は段階的に利上げが行われ、米国債利回りは上昇しました。欧州圏では米国からの影響があったものの、ECB（欧州中央銀行）が金融緩和政策を継続する中で利回りの上昇は抑えられ、欧州債の利回りは概ねレンジ内での推移となりました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.6%下落しました。当ファンドはベンチマークを0.1%下回りました。概ねベンチマークに連動した結果となりました。なお、差異の要因としては債券時価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 (保管費用) (その他)	1円 (1) (0)	0.010% (0.010) (0.000)
合計	1	0.010

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。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(13,326円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況(2017年6月23日から2018年6月22日まで)

公社債

		買付額	売付額
外 国	アメリカ	千アメリカ・ドル 706,111	千アメリカ・ドル 205,007 (-)
	カナダ	千カナダ・ドル 46,469	千カナダ・ドル 15,386 (-)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 38,172	千オーストラリア・ドル 7,738 (-)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 6,981	千シンガポール・ドル 2,545 (-)
	イギリス	千イギリス・ポンド 71,570	千イギリス・ポンド 19,144 (-)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 46,194	千デンマーク・クローネ 16,671 (-)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 44,537	千ノルウェー・クローネ 26,217 (-)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 41,244	千スウェーデン・クローナ 27,132 (-)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 202,955	千メキシコ・ペソ 71,245 (-)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,330	千マレーシア・リンギット 4,307 (-)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 117,364	千南アフリカ・ランド 18,359 (-)

			買付額	売付額
外 ユ ニ コ 国	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 28,526	千ポーランド・ズロチ 7,421 (-)
	アイルランド	国債証券	千ユーロ 10,570	千ユーロ 2,220 (-)
	オランダ	国債証券	25,003	8,815 (-)
	ベルギー	国債証券	29,138	6,162 (-)
	フランス	国債証券	120,600	27,332 (-)
	ドイツ	国債証券	85,514	30,383 (-)
	スペイン	国債証券	73,052	21,610 (-)
	イタリア	国債証券	119,255	35,818 (-)
	フィンランド	国債証券	9,181	2,384 (-)
	オーストリア	国債証券	20,351	4,325 (-)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

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

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期						
	区分	買付額等A		B/A	売付額等C		D/C
		百万円	うち利害関係人との取引状況B		%	百万円	うち利害関係人との取引状況D
為替予約取引		3,003,972	77,802	2.6	3,001,487	77,700	2.6
金銭信託		990	990	100.0	990	990	100.0

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

■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						期末		
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年末満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 1,178,930	千アメリカ・ドル 1,158,205	千円 127,460,472	% 43.8	% —	% 18.5	% 16.9	% 8.5	
カナダ	千カナダ・ドル 68,340	千カナダ・ドル 72,285	千円 5,980,153	2.1	—	0.9	0.7	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 69,300	千オーストラリア・ドル 73,383	千円 5,967,566	2.1	—	1.3	0.6	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 11,750	千シンガポール・ドル 11,943	千円 968,289	0.3	—	0.2	0.1	—	
イギリス	千イギリス・ポンド 111,730	千イギリス・ポンド 138,363	千円 20,189,964	6.9	—	5.3	1.3	0.3	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 70,240	千デンマーク・クローネ 89,212	千円 1,529,104	0.5	—	0.4	0.1	—	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 47,850	千ノルウェー・クローネ 49,713	千円 673,616	0.2	—	0.1	0.1	—	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 66,450	千スウェーデン・クローナ 75,841	千円 938,916	0.3	—	0.2	0.1	—	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 373,340	千メキシコ・ペソ 376,317	千円 2,039,642	0.7	—	0.5	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 42,570	千マレーシア・リンギット 41,990	千円 1,153,060	0.4	—	0.2	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 218,030	千南アフリカ・ランド 198,954	千円 1,611,534	0.6	—	0.5	0.0	—	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 56,880	千ポーランド・ズロチ 58,478	千円 1,726,286	0.6	—	0.2	0.3	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	17,240	19,194	2,451,855	0.8	—	0.5	0.2	0.1	
オランダ	39,890	46,903	5,991,467	2.1	—	1.4	0.6	0.1	
ベルギー	48,010	57,513	7,346,713	2.5	—	1.9	0.5	0.1	
フランス	198,320	230,738	29,474,536	10.1	—	6.3	2.7	1.1	
ドイツ	133,630	155,608	19,877,379	6.8	—	4.0	2.2	0.7	
スペイン	111,310	129,951	16,600,002	5.7	—	3.8	1.5	0.4	
イタリア	194,410	206,484	26,376,356	9.1	—	5.4	2.9	0.8	
フィンランド	13,890	15,127	1,932,338	0.7	—	0.3	0.2	0.1	
オーストリア	31,320	36,283	4,634,811	1.6	—	1.0	0.5	0.1	
合計	—	—	千円 284,924,070	98.0	—	53.1	31.8	13.2	

(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 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	2,980	2,918	321,235	2025/01/31	
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	13,400	13,012	1,432,037	2024/01/31	
US T N/B 1.375 01/31/21	国債証券	1.3750	17,000	16,467	1,812,236	2021/01/31	
US T N/B 2.375 01/31/23	国債証券	2.3750	2,760	2,713	298,635	2023/01/31	
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6,0000	800	972	106,968	2026/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	2,760	2,808	309,123	2042/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	4,700	4,774	525,474	2043/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	5,600	5,034	554,023	2046/02/15	
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	2,150	2,323	255,756	2039/02/15	
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5,2500	830	1,007	110,851	2029/02/15	
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5,3750	2,300	2,895	318,636	2031/02/15	
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4,5000	2,100	2,551	280,792	2036/02/15	
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4,7500	2,600	3,341	367,677	2041/02/15	
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3,6250	7,610	8,406	925,080	2044/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2,0000	10,000	9,755	1,073,581	2022/02/15	
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4,3750	1,210	1,463	161,081	2038/02/15	
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4,6250	3,370	4,244	467,120	2040/02/15	
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	12,200	11,154	1,227,534	2026/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2,5000	6,900	6,222	684,769	2045/02/15	
US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	3,6250	19,500	19,841	2,183,593	2020/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3,0000	6,000	5,954	655,242	2047/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3,0000	6,450	6,396	703,938	2048/02/15	
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2,7500	11,930	11,892	1,308,787	2024/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2,0000	8,600	8,158	897,849	2025/02/15	
US T N/B 1.25 02/29/20	国債証券	1,2500	4,200	4,111	452,494	2020/02/29	
US T N/B 1.75 02/28/22	国債証券	1,7500	10,500	10,145	1,116,526	2022/02/28	
US T N/B 3.625 02/15/21	国債証券	3,6250	2,010	2,060	226,799	2021/02/15	
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2,7500	10,540	10,406	1,145,242	2028/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2,0000	14,000	13,538	1,489,903	2023/02/15	
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2,2500	10,300	9,791	1,077,542	2027/02/15	
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2,7500	6,290	6,253	688,206	2025/02/28	
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2,6250	1,190	1,183	130,201	2023/02/28	
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2,1250	10,500	10,114	1,113,094	2024/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2,2500	11,920	11,796	1,298,258	2021/03/31	
US T N/B 1.125 03/31/20	国債証券	1,1250	11,000	10,733	1,181,230	2020/03/31	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2,6250	2,400	2,366	260,467	2025/03/31	
US T N/B 1.375 03/31/20	国債証券	1,3750	7,620	7,468	821,935	2020/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2,5000	6,720	6,640	730,809	2023/03/31	
US T N/B 1.875 03/31/22	国債証券	1,8750	13,300	12,897	1,419,403	2022/03/31	
US T N/B 1.375 04/30/20	国債証券	1,3750	11,510	11,271	1,240,442	2020/04/30	
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1,6250	9,800	9,292	1,022,624	2023/04/30	
US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	1,3750	10,000	9,653	1,062,411	2021/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6,2500	1,200	1,600	176,165	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4,3750	2,560	3,125	344,015	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4,3750	2,100	2,571	282,995	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3,0000	2,310	2,300	253,221	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4,2500	1,790	2,143	235,847	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2,8750	5,230	5,083	559,463	2043/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3,3750	6,300	6,680	735,232	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3,0000	6,200	6,156	677,561	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3,0000	5,920	5,868	645,795	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2,5000	9,550	8,577	943,903	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3,1250	440	447	49,204	2048/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1,7500	15,770	15,202	1,673,045	2022/05/15	
US T N/B 1.375 05/31/20	国債証券	1,3750	21,400	20,926	2,302,999	2020/05/31	

銘柄	種類	利 率	額面金額	当期		末償還年月日
				評価額	外貨建金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	1,700	2,092	230,230	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	5,000	4,766	524,580	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	10,790	10,596	1,166,184	2024/05/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.1250	100	101	11,152	2021/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	8,400	8,017	882,312	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	2,700	2,694	296,552	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	9,600	9,210	1,013,639	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5,0000	890	1,154	127,036	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	9,000	8,204	902,854	2026/05/15
US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	2,0000	11,560	11,349	1,249,011	2021/05/31
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	20,000	19,267	2,120,333	2022/05/31
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,880	3,877	426,690	2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	4,550	4,556	501,468	2025/05/31
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2,0000	10,800	10,307	1,134,306	2024/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	15,000	14,439	1,589,094	2022/06/30
US T N/B 1.5 06/15/20	国債証券	1,5000	13,000	12,738	1,401,865	2020/06/15
US T N/B 1.125 06/30/21	国債証券	1.1250	10,000	9,557	1,051,835	2021/06/30
US T N/B 2.0 07/31/20	国債証券	2,0000	12,600	12,454	1,370,586	2020/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	7,788	857,177	2023/07/31
US T N/B 0.875 07/31/19	国債証券	0.8750	10,000	9,833	1,082,220	2019/07/31
US T N/B 1.125 07/31/21	国債証券	1.1250	13,900	13,265	1,459,895	2021/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6,2500	1,200	1,399	154,055	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3,7500	3,990	4,475	492,542	2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5,5000	930	1,141	125,630	2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3,8750	2,450	2,795	307,663	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2,7500	3,220	3,066	337,443	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3,1250	6,260	6,359	699,887	2044/08/15
US T N/B 8.125 08/15/19	国債証券	8,1250	3,900	4,151	456,908	2019/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4,5000	2,000	2,474	272,356	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3,6250	5,000	5,516	607,118	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2,8750	6,620	6,418	706,383	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2,0000	11,600	10,958	1,205,959	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2,7500	5,850	5,514	606,871	2047/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2,1250	9,590	9,432	1,038,018	2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2,5000	6,700	6,609	727,366	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2,3750	12,610	12,283	1,351,843	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2,2500	6,000	5,105	561,869	2046/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2,2500	9,500	9,005	991,068	2027/08/15
US T N/B 3,625 08/15/19	国債証券	3,6250	6,200	6,284	691,582	2019/08/15
US T N/B 2,625 08/15/20	国債証券	2,6250	13,350	13,362	1,470,592	2020/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1,5000	9,800	8,814	970,047	2026/08/15
US T N/B 2.0 08/31/21	国債証券	2,0000	12,900	12,633	1,390,300	2021/08/31
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	15,900	15,204	1,673,293	2022/08/15
US T N/B 2.125 08/31/20	国債証券	2,1250	17,180	17,014	1,872,489	2020/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1,3750	9,500	8,853	974,330	2023/08/31
US T N/B 1.125 08/31/21	国債証券	1.1250	11,000	10,480	1,153,327	2021/08/31
US T N/B 1.625 08/31/19	国債証券	1.6250	11,800	11,690	1,286,513	2019/08/31
US T N/B 0.75 08/15/19	国債証券	0.7500	7,000	6,870	756,052	2019/08/15
US T N/B 1.0 09/30/19	国債証券	1,0000	10,700	10,506	1,156,233	2019/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2,1250	9,800	9,629	1,059,778	2021/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2,1250	13,000	12,469	1,372,293	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1,3750	9,000	8,375	921,732	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1,7500	15,600	14,976	1,648,108	2022/09/30
US T N/B 2.0 09/30/20	国債証券	2,0000	12,660	12,496	1,375,260	2020/09/30
US T N/B 0.875 09/15/19	国債証券	0.8750	22,500	22,075	2,429,400	2019/09/15
US T N/B 1.25 10/31/21	国債証券	1,2500	10,500	10,016	1,102,347	2021/10/31
US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	1,2500	12,300	12,101	1,331,767	2019/10/31
US T N/B 1.375 10/31/20	国債証券	1,3750	10,000	9,721	1,069,884	2020/10/31

銘柄	種類	利 率	額面金額	当期		末償還年月日
				評価額	外貨建金額 邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	4,280	4,149	456,624	2022/10/31
US T N/B 1.5 10/31/19	国債証券	1.5000	4,840	4,777	525,754	2019/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	2,100	2,461	270,878	2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,700	2,056	226,298	2028/11/15
US T N/B 6.5 11/15/26	国債証券	6.5000	500	635	69,881	2026/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	950	1,201	132,223	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	6,500	6,457	710,625	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	3,100	3,726	410,051	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	4,500	4,282	471,310	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	2,350	2,391	263,202	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	7,100	7,993	879,688	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	6,950	6,553	721,220	2047/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	6,100	6,055	666,424	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	6,200	6,002	660,612	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	12,600	12,163	1,338,638	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	2,000	2,437	268,246	2039/11/15
US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	2.6250	11,860	11,865	1,305,845	2020/11/15
US T N/B 3.375 11/15/19	国債証券	3.3750	2,250	2,277	250,638	2019/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	7,900	7,725	850,137	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	10,800	10,355	1,139,595	2025/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	16,080	15,332	1,687,335	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	7,000	6,983	768,539	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	8,900	8,308	914,400	2026/11/15
US T N/B 1.0 11/30/19	国債証券	1.0000	17,000	16,645	1,831,880	2019/11/30
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2,0000	12,020	11,646	1,281,661	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	12,100	11,454	1,260,550	2027/11/15
US T N/B 1.625 11/30/20	国債証券	1.6250	10,000	9,770	1,075,221	2020/11/30
US T N/B 1.0 11/15/19	国債証券	1.0000	16,000	15,676	1,725,231	2019/11/15
US T N/B 1.125 12/31/19	国債証券	1.1250	14,500	14,204	1,563,172	2019/12/31
US T N/B 2.375 12/31/20	国債証券	2.3750	16,950	16,853	1,854,696	2020/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	7,000	6,865	755,543	2021/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	15,000	14,465	1,591,933	2024/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	13,500	13,139	1,445,977	2022/12/31
小計	-	-	1,178,930	1,158,205	127,460,472	-
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 1.25 02/01/20	国債証券	1.2500	2,360	2,339	193,540	2020/02/01
CANADA 0.75 03/01/21	国債証券	0.7500	4,660	4,520	373,983	2021/03/01
CANADA 1.5 03/01/20	国債証券	1.5000	4,250	4,228	349,802	2020/03/01
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	2,280	2,163	178,978	2022/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	2,500	2,472	204,518	2023/03/01
CANADA 1.75 05/01/20	国債証券	1.7500	1,100	1,098	90,871	2020/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	2,060	1,968	162,848	2026/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8,0000	900	1,327	109,834	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,700	2,291	189,610	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	2,070	3,007	248,800	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5,0000	2,020	2,884	238,609	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2,5000	2,250	2,305	190,723	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4,0000	2,480	3,264	270,043	2041/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3,2500	2,400	2,490	206,055	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	1,850	1,905	157,631	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	2,200	2,147	177,652	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2,0000	1,350	1,332	110,271	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2,2500	2,000	2,020	167,182	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1,0000	2,480	2,252	186,356	2027/06/01
CANADA 3.5 06/01/20	国債証券	3,5000	2,000	2,062	170,642	2020/06/01
CANADA 0.75 08/01/19	国債証券	0.7500	3,300	3,266	270,254	2019/08/01
CANADA 1.75 09/01/19	国債証券	1.7500	2,000	2,000	165,516	2019/09/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	1,870	1,802	149,107	2021/09/01

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	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 0.75 09/01/20	国債証券	0.7500	4,600	4,490	371,527	2020/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	410	409	33,871	2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	2,300	2,210	182,879	2022/09/01
CANADA 1.25 11/01/19	国債証券	1.2500	3,200	3,178	262,975	2019/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	2,590	3,270	270,578	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	2,390	2,673	221,174	2048/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	770	898	74,311	2064/12/01
小計	-	-	68,340	72,285	5,980,153	-
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	1,860	1,798	146,241	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	4,650	4,858	395,120	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	4,750	5,535	450,135	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	4,000	4,066	330,682	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	5,190	5,795	471,283	2026/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	4.5000	3,740	3,901	317,257	2020/04/15
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	4,150	4,746	385,949	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	4,350	4,579	372,370	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	2,220	2,659	216,264	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	1,900	2,103	171,082	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	4,120	3,979	323,580	2028/05/21
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.7500	4,700	5,174	420,814	2021/05/15
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	970	997	81,105	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	1,100	1,068	86,891	2035/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	3,890	4,417	359,236	2022/07/15
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	3,590	3,612	293,740	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	4,290	4,313	350,743	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,130	1,133	92,212	2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国債証券	1.7500	4,500	4,463	362,994	2020/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	1,500	1,496	121,720	2022/11/21
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券	2.0000	2,700	2,682	218,141	2021/12/21
小計	-	-	69,300	73,383	5,967,566	-
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	270	265	21,496	2023/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	1,260	1,360	110,299	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	750	724	58,763	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	760	739	59,918	2042/04/01
SINGAPORE 1.75 04/01/22	国債証券	1.7500	300	295	23,982	2022/04/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	500	499	40,474	2025/06/01
SINGAPORE 2.25 06/01/21	国債証券	2.2500	800	803	65,134	2021/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	400	390	31,682	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	200	205	16,651	2029/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	700	715	58,001	2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	300	273	22,156	2036/08/01
SINGAPORE 3.25 09/01/20	国債証券	3.2500	980	1,006	81,609	2020/09/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,240	1,287	104,346	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	1,200	1,248	101,224	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	610	622	50,456	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	680	726	58,920	2033/09/01
SINGAPORE 1.25 10/01/21	国債証券	1.2500	800	779	63,169	2021/10/01
小計	-	-	11,750	11,943	968,289	-
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	3,740	4,878	711,864	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	4,030	5,509	803,992	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	2,240	3,872	565,109	2060/01/22
UK TREASURY 1.5 01/22/21	国債証券	1.5000	3,800	3,874	565,314	2021/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	2,200	2,754	401,870	2025/03/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4,0000	2,350	2,623	382,850	2022/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4,2500	3,300	4,594	670,442	2036/03/07

銘柄	当期				末	
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 4.75 03/07/20	国債証券	4.7500	2,600	2,781	405,888	2020/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	2,350	3,135	457,581	2032/06/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	8.0000	1,520	1,843	268,966	2021/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	3,310	3,127	456,333	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	2,540	3,905	569,891	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	2,730	2,833	413,419	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	2,800	3,670	535,577	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	2,980	4,970	725,315	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	2,850	2,911	424,825	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	3,950	3,923	572,568	2027/07/22
UK TREASURY 2.0 07/22/20	国債証券	2.0000	3,600	3,695	539,195	2020/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	4,850	4,773	696,480	2022/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	2,980	2,940	429,010	2023/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	2,250	3,254	474,882	2039/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/21	国債証券	3.7500	2,200	2,406	351,200	2021/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	3,000	3,188	465,216	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,500	2,749	401,203	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	3,250	3,446	502,850	2025/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国債証券	3.7500	3,050	3,254	474,954	2020/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/19	国債証券	3.7500	3,900	4,045	590,383	2019/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	3,150	4,422	645,391	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,700	1,702	248,411	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	3,420	3,538	516,398	2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	920	937	136,801	2028/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6,0000	1,450	2,104	307,156	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	2,570	3,916	571,521	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	3,000	4,639	677,039	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	2,530	3,942	575,289	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,800	4,849	707,694	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	2,050	2,591	378,212	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	2,820	4,135	603,456	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	2,320	3,177	463,690	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	2,130	3,438	501,708	2049/12/07
小計	-	-	111,730	138,363	20,189,964	-
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	20,910	35,717	612,196	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	12,750	14,316	245,392	2025/11/15
DENMARK 3.0 11/15/21	国債証券	3,0000	13,540	15,128	259,298	2021/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	8,570	9,344	160,168	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	9,470	9,602	164,580	2027/11/15
DENMARK 0.25 11/15/20	国債証券	0.2500	5,000	5,103	87,467	2020/11/15
小計	-	-	70,240	89,212	1,529,104	-
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	5,610	5,553	75,249	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	7,030	7,044	95,451	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3,0000	9,430	10,212	138,385	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	5,990	6,054	82,040	2025/03/13
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2,0000	9,380	9,653	130,805	2023/05/24
NORWAY 3.75 05/25/21	国債証券	3.7500	10,410	11,194	151,684	2021/05/25
小計	-	-	47,850	49,713	673,616	-
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千円		
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	7,320	10,454	129,423	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	9,270	9,505	117,679	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	9,890	11,532	142,776	2025/05/12
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	17,760	20,468	253,403	2022/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	12,920	14,061	174,079	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	9,290	9,818	121,553	2026/11/12
小計	-	-	66,450	75,841	938,916	-

銘柄	当期				末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千円		
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	21,500	18,978	102,862	2026/03/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	16,000	16,820	91,166	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	21,054	20,917	113,370	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	34,386	33,750	182,926	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	42,000	40,093	217,307	2022/06/09
MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	6.5000	47,647	45,997	249,306	2021/06/10
MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	8.0000	46,000	46,234	250,591	2020/06/11
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	30,877	30,427	164,916	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	11,366	11,501	62,336	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	17,526	18,626	100,957	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	13,880	16,758	90,828	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	13,000	12,869	69,754	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	45,604	50,749	275,062	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	12,500	12,593	68,256	2023/12/07
小計	-	-	373,340	376,317	2,039,642	-
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千円		
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	3,910	3,834	105,285	2023/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,480	1,487	40,841	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	2,820	2,769	76,060	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,180	1,107	30,406	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,340	1,209	33,210	2033/04/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	4,580	4,289	117,785	2027/05/31
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	2,000	1,908	52,399	2031/06/30
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.1600	6,460	6,541	179,628	2021/07/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,190	2,195	60,293	2024/07/15
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	5,000	4,909	134,808	2022/08/15
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,480	1,568	43,059	2028/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	3,470	3,491	95,863	2043/09/30
MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	4.3780	5,160	5,224	143,464	2019/11/29
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,500	1,454	39,953	2026/11/30
小計	-	-	42,570	41,990	1,153,060	-
(南アフリカ)		%	千南アフリカ・ランド	千円		
SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	国債証券	8.0000	15,820	14,370	116,397	2030/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	15,000	13,614	110,278	2044/01/31
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9.0000	9,000	8,427	68,266	2040/01/31
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	16,500	14,913	120,796	2037/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	39,170	35,441	287,075	2048/02/28
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	13,680	9,678	78,395	2041/02/28
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7.7500	11,500	11,269	91,282	2023/02/28
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	17,190	14,159	114,691	2031/02/28
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8.8750	10,000	9,414	76,257	2035/02/28
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	13,000	11,791	95,507	2032/03/31
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	17,630	12,672	102,645	2036/03/31
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	39,540	43,202	349,940	2026/12/21
小計	-	-	218,030	198,954	1,611,534	-
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千円		
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	2,640	2,661	78,556	2023/01/25
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,800	2,240	66,126	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	1,000	969	28,632	2028/04/25
POLAND 2.0 04/25/21	国債証券	2.0000	4,000	4,020	118,682	2021/04/25
POLAND 1.5 04/25/20	国債証券	1.5000	4,100	4,098	120,995	2020/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	5,500	5,520	162,976	2022/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	5,520	5,311	156,799	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	5,200	5,318	156,996	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	4,890	4,658	137,507	2027/07/25
POLAND 1.75 07/25/21	国債証券	1.7500	4,500	4,481	132,282	2021/07/25
POLAND 07/25/20	国債証券	-	1,500	1,451	42,854	2020/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	3,380	3,857	113,865	2022/09/23

銘柄	種類	利 率	額面金額	期		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千円		
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.2500	2,880	3,117	92,019	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	2,690	3,016	89,045	2021/10/25
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	4,070	4,374	129,127	2023/10/25
POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	5.5000	3,210	3,381	99,819	2019/10/25
小計	-	-	56,880	58,478	1,726,286	-
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	1,350	1,429	182,556	2045/02/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	1,120	1,331	170,140	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	2,030	2,714	346,736	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	950	1,131	144,542	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	1,280	1,331	170,058	2022/03/15
IRISH 4.5 04/18/20	国債証券	4.5000	1,570	1,715	219,191	2020/04/18
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	740	735	94,005	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	1,490	1,713	218,930	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	800	803	102,678	2028/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	1,550	1,606	205,186	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	860	888	113,555	2037/05/15
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5.0000	1,420	1,604	204,960	2020/10/18
IRISH 5.9 10/18/19	国債証券	5.9000	1,190	1,290	164,800	2019/10/18
IRISH 10/18/22	国債証券	-	890	896	114,512	2022/10/18
小計	-	-	17,240	19,194	2,451,855	-
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.5000	590	803	102,604	2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	2,310	3,637	464,637	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	2,100	2,939	375,467	2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	2,000	2,370	302,820	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	2,070	3,058	390,656	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	2,310	3,539	452,120	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	2,110	2,610	333,507	2033/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	-	2,800	2,843	363,273	2022/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	-	1,190	1,196	152,837	2024/01/15
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	国債証券	0.2500	2,150	2,182	278,774	2020/01/15
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	国債証券	3.5000	1,940	2,107	269,214	2020/07/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	国債証券	3.2500	2,760	3,084	394,066	2021/07/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	2,700	2,972	379,712	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	2,690	2,740	350,011	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	2,280	2,528	322,998	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	2,200	2,473	315,965	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	2,400	2,422	309,497	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	900	922	117,903	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	2,390	2,469	315,397	2027/07/15
小計	-	-	39,890	46,903	5,991,467	-
(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	2,130	2,484	317,391	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	3,370	4,935	630,413	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	2,670	4,081	521,339	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,500	1,977	252,589	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,550	2,149	274,623	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	3,260	5,123	654,485	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	700	711	90,830	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	1,480	2,162	276,234	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	1,570	1,532	195,820	2047/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	410	446	57,070	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	640	671	85,816	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	2,050	2,142	273,671	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	2,820	3,248	414,948	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,500	1,501	191,811	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	1,850	2,073	264,906	2023/06/22

銘柄	種類	当期			末	
		利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	1,100	1,107	141,494	2028/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	1,200	1,515	193,602	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	970	1,048	133,897	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,300	2,386	304,846	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	2,050	2,086	266,473	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	600	605	77,372	2037/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.2500	2,400	2,772	354,104	2021/09/28
BELGIUM 3.75 09/28/20	国債証券	3.7500	2,500	2,746	350,796	2020/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	2,300	2,751	351,454	2022/09/28
BELGIUM 3.0 09/28/19	国債証券	3.0000	2,530	2,644	337,773	2019/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	1,500	1,532	195,764	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	1,060	1,073	137,178	2023/10/22
小計	-	-	48,010	57,513	7,346,713	-
(ユーロ…フランス)		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
FRANCE OAT 02/25/20	国債証券	-	4,200	4,240	541,701	2020/02/25
FRANCE OAT 02/25/21	国債証券	-	2,400	2,428	310,279	2021/02/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	-	2,800	2,822	360,551	2023/03/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	国債証券	3.7500	5,510	6,176	788,949	2021/04/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8,5000	1,480	2,106	269,104	2023/04/25
FRANCE OAT 3.50 04/25/26	国債証券	3,5000	6,660	8,328	1,063,860	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4,5000	5,460	8,772	1,120,560	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4,0000	2,250	3,614	461,732	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4,0000	2,330	3,832	489,551	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5,5000	4,500	6,765	864,193	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3,0000	6,220	7,026	897,563	2022/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	国債証券	3,5000	3,010	3,235	413,300	2020/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4,7500	4,920	7,676	980,587	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3,2500	3,850	5,288	675,584	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2,0000	3,150	3,398	434,157	2048/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1,7500	1,450	1,398	178,638	2066/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2,2500	5,400	6,116	781,366	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2,5000	4,850	5,770	737,065	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0,7500	6,030	6,090	778,028	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1,5000	5,350	5,730	731,992	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0,5000	5,500	5,620	717,956	2025/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1,2500	500	510	65,152	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0,5000	5,000	5,062	646,734	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1,0000	5,000	5,217	666,477	2027/05/25
FRANCE OAT 05/25/20	国債証券	-	5,400	5,458	697,232	2020/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1,7500	6,650	7,280	929,983	2023/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1,2500	3,600	3,603	460,323	2036/05/25
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	-	5,500	5,568	711,352	2022/05/25
FRANCE OAT 05/25/21	国債証券	-	7,200	7,294	931,776	2021/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1,7500	1,500	1,602	204,704	2039/06/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4,2500	6,290	7,763	991,660	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6,0000	2,220	3,164	404,289	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2,7500	6,850	8,237	1,052,315	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4,0000	4,050	6,027	769,931	2038/10/25
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3,2500	6,000	6,742	861,256	2021/10/25
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	国債証券	8,5000	1,480	1,660	212,140	2019/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5,7500	5,000	8,227	1,051,006	2032/10/25
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2,2500	4,900	5,440	694,915	2022/10/25
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	国債証券	3,7500	5,060	5,353	683,918	2019/10/25
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	国債証券	2,5000	4,300	4,606	588,478	2020/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1,7500	5,600	6,193	791,120	2024/11/25
FRANCE OAT 0.1 11/25/25	国債証券	1,0000	5,200	5,483	700,515	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0,2500	4,400	4,340	554,423	2026/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	国債証券	0,2500	4,300	4,381	559,679	2020/11/25

銘柄	当期				末	
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス) FRANCE OAT 0.5 11/25/19	国債証券	% 0.5000	千ユーロ 5,000	千ユーロ 5,076	千円 648,421	2019/11/25
小計	—	—	198,320	230,738	29,474,536	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6,2500	1,180	1,605	205,045	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5,6250	2,900	4,353	556,076	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6,2500	1,400	2,313	295,580	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5,5000	2,600	4,167	532,394	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4,0000	3,510	5,428	693,391	2037/01/04
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2,0000	2,700	2,941	375,752	2022/01/04
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債証券	3,2500	2,300	2,441	311,911	2020/01/04
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	国債証券	2,5000	2,200	2,376	303,631	2021/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0,5000	3,440	3,562	455,025	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0,5000	4,000	4,123	526,697	2026/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1,5000	3,100	3,371	430,722	2023/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0,5000	2,690	2,732	348,994	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1,7500	3,300	3,666	468,312	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0,2500	3,800	3,806	486,285	2027/02/15
BUNDESOBL 04/17/20	国債証券	—	2,950	2,988	381,694	2020/04/17
BUNDESOBL 04/09/21	国債証券	—	2,850	2,898	370,237	2021/04/09
BUNDESOBL 04/08/22	国債証券	—	2,500	2,545	325,178	2022/04/08
BUNDESOBL 04/14/23	国債証券	—	2,960	3,004	383,816	2023/04/14
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1,5000	2,600	2,856	364,854	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1,5000	3,070	3,347	427,577	2023/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6,5000	1,670	2,605	332,801	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4,7500	1,800	2,581	329,768	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4,2500	2,100	3,437	439,051	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3,2500	2,330	3,455	441,451	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2,5000	3,690	4,901	626,061	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4,7500	2,400	4,224	539,573	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3,2500	2,490	2,781	355,369	2021/07/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3,0000	3,200	3,440	439,535	2020/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1,7500	3,350	3,651	466,425	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4,7500	3,400	5,460	697,468	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2,5000	4,170	5,622	718,265	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1,2500	1,160	1,200	153,372	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1,0000	4,440	4,752	607,094	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0,5000	3,480	3,554	454,003	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	—	3,770	3,727	476,181	2026/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2,0000	2,900	3,243	414,306	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1,0000	3,100	3,315	423,472	2024/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2,2500	2,700	2,944	376,076	2021/09/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2,2500	3,000	3,194	408,071	2020/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1,5000	3,300	3,570	456,053	2022/09/04
BUNDESSCHAT 09/13/19	国債証券	—	2,330	2,350	300,280	2019/09/13
BUNDESOBL 10/08/21	国債証券	—	3,400	3,461	442,142	2021/10/08
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	国債証券	0,2500	3,000	3,063	391,367	2020/10/16
BUNDESOBL 10/07/22	国債証券	—	3,000	3,052	389,865	2022/10/07
BUNDESOBL 0.25 10/11/19	国債証券	0,2500	3,400	3,442	439,775	2019/10/11
BUNDESSCHAT 12/13/19	国債証券	—	4,000	4,042	516,365	2019/12/13
小計	—	—	133,630	155,608	19,877,379	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5,8500	4,160	5,032	642,912	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6,0000	3,500	5,079	648,915	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4,8000	3,000	3,709	473,882	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4,2000	3,000	4,008	512,004	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5,4000	3,000	3,707	473,583	2023/01/31
SPAIN 0.05 01/31/21	国債証券	0,0500	2,500	2,509	320,573	2021/01/31
SPAIN 1.4 01/31/20	国債証券	1,4000	3,600	3,696	472,146	2020/01/31

銘柄	種類	当期			末	
		利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	3,100	3,275	418,450	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	2,980	3,531	451,088	2024/04/30
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.5000	3,000	3,479	444,470	2021/04/30
SPAIN 4.0 04/30/20	国債証券	4.0000	2,870	3,093	395,176	2020/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,700	2,767	353,554	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	3,000	3,212	410,382	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	2,300	2,315	295,720	2028/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	3,300	3,340	426,701	2022/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	2,700	3,716	474,724	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	3,230	4,735	604,871	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	3,060	4,392	561,130	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,700	1,984	253,484	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	3,380	4,273	545,845	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	3,050	3,167	404,618	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	3,720	5,599	715,336	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,860	1,968	251,495	2033/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	4,700	4,822	616,071	2021/07/30
SPAIN 1.15 07/30/20	国債証券	1.1500	4,500	4,628	591,281	2020/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	3,800	4,295	548,680	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	3,600	4,928	629,507	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	2,000	3,067	391,827	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	2,500	2,713	346,609	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,080	1,115	142,458	2048/10/31
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.8500	2,630	2,939	375,494	2020/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	3,600	3,916	500,332	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	3,300	3,356	428,720	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	3,500	3,559	454,753	2026/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	1,970	2,381	304,259	2023/10/31
SPAIN 4.3 10/31/19	国債証券	4.3000	2,820	2,997	382,924	2019/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	2,600	2,630	336,009	2022/10/31
小計	-	-	111,310	129,951	16,600,002	-
(ユーロ…イタリア)		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	国債証券	4.5000	2,420	2,561	327,242	2020/02/01
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	3,350	4,366	557,762	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	4,570	5,079	648,803	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,950	1,834	234,349	2028/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	2,650	2,335	298,363	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,650	1,636	209,063	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	3,500	3,948	504,411	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	1,100	939	120,013	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	3,860	4,508	575,918	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	2,500	2,811	359,109	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	2,850	3,259	416,410	2026/03/01
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	国債証券	4.2500	2,100	2,219	283,520	2020/03/01
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.7500	2,950	3,153	402,815	2021/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	3,300	2,827	361,206	2032/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	3,980	4,179	533,947	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	2,700	2,602	332,412	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	2,000	1,926	246,080	2023/03/01
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	3,000	2,980	380,790	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	2,700	2,670	341,104	2022/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	4,300	5,636	719,998	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	2,600	2,917	372,709	2023/05/01
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	国債証券	0.7000	3,800	3,786	483,713	2020/05/01
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国債証券	3.7500	3,000	3,214	410,581	2021/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	2,800	2,757	352,235	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,360	1,285	164,194	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	3,300	3,103	396,460	2026/06/01

銘柄	種類	利 率	額面金額	当期		償還年月日	
				評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)		%		千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	3,700	3,506	447,923	2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,500	2,418	308,907	2027/06/01	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国債証券	0.4500	3,750	3,672	469,157	2021/06/01	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	国債証券	0.3500	3,600	3,563	455,228	2020/06/15	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	3,500	3,760	480,308	2021/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	3,670	4,526	578,271	2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	3,300	4,088	522,248	2039/08/01	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	4,010	4,564	583,131	2023/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	4,600	4,371	558,435	2027/08/01	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	3,000	2,916	372,531	2022/08/01	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	1,450	1,379	176,193	2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	2,600	3,146	401,889	2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	2,200	2,143	273,861	2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	3,100	3,617	462,069	2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	3,450	4,255	543,607	2040/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	5,140	5,688	726,641	2021/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2,4500	1,800	1,667	213,066	2033/09/01	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債証券	4,0000	5,240	5,582	713,066	2020/09/01	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	2,500	2,720	347,519	2024/09/01	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5,5000	2,960	3,413	436,089	2022/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2,2500	2,400	2,122	271,105	2036/09/01	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1,4500	3,820	3,788	483,936	2022/09/15	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0,6500	3,000	2,811	359,107	2023/10/15	
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	国債証券	0,2000	2,500	2,455	313,633	2020/10/15	
ITALY BTPS 0.05 10/15/19	国債証券	0,0500	3,100	3,079	393,423	2019/10/15	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9,0000	1,700	2,303	294,292	2023/11/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7,2500	2,150	2,910	371,781	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6,5000	3,400	4,456	569,257	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5,2500	4,680	5,718	730,420	2029/11/01	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5,5000	3,200	3,702	472,977	2022/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1,4500	2,800	2,673	341,455	2024/11/15	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	国債証券	0,6500	2,000	1,982	253,257	2020/11/01	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国債証券	0,3500	3,800	3,686	470,927	2021/11/01	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2,0000	2,900	2,826	361,032	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1,2500	3,500	3,178	406,060	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2,5000	3,800	3,867	494,042	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2,1500	2,000	2,052	262,224	2021/12/15	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	国債証券	1,0500	3,300	3,319	424,050	2019/12/01	
小計	—	—	194,410	206,484	26,376,356	—	
(ユーロ…フィンランド)		%		千ユーロ	千円		
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	700	782	100,009	2024/04/15	
FINLAND 3.5 04/15/21	国債証券	3.5000	1,210	1,347	172,151	2021/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	750	745	95,170	2031/04/15	
FINLAND 3.375 04/15/20	国債証券	3.3750	2,320	2,489	318,035	2020/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0,5000	730	740	94,614	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	450	458	58,594	2034/04/15	
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	830	898	114,749	2023/04/15	
FINLAND 04/15/22	国債証券	—	770	779	99,607	2022/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4,0000	930	1,178	150,589	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	700	849	108,544	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2,6250	780	1,023	130,752	2042/07/04	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	520	544	69,574	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0,5000	600	600	76,647	2027/09/15	
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	700	758	96,845	2022/09/15	
FINLAND 09/15/23	国債証券	—	750	754	96,321	2023/09/15	
FINLAND 0.375 09/15/20	国債証券	0.3750	1,150	1,175	150,128	2020/09/15	
小計	—	—	13,890	15,127	1,932,338	—	

銘柄	種類	利 率	額面金額	当期		末償還年月日
				評価額	外貨建金額	
(ユーロ…オーストリア)		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	580	978	125,025	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	760	762	97,462	2047/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	570	577	73,748	2028/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	1,400	1,895	242,181	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	2,310	3,473	443,651	2037/03/15
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.6500	1,270	1,466	187,286	2022/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	2,300	2,301	293,931	2027/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	1,190	1,425	182,101	2034/05/23
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	1,090	1,514	193,463	2044/06/20
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.9000	4,170	4,558	582,241	2020/07/15
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	1,160	1,756	224,431	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	—	900	904	115,592	2023/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	2,390	2,699	344,834	2021/09/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	480	524	67,031	2117/09/20
AUSTRIA 09/20/22	国債証券	—	800	810	103,549	2022/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	1,580	1,737	221,937	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,700	1,746	223,034	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	1,580	1,687	215,549	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	1,820	2,000	255,572	2023/10/20
AUSTRIA 0.25 10/18/19	国債証券	0.2500	1,280	1,294	165,345	2019/10/18
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	540	478	61,173	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	1,450	1,688	215,666	2022/11/22
小計		—	31,320	36,283	4,634,811	—
合計		—	—	—	284,924,070	—

■投資信託財産の構成

2018年6月22日現在

項目	評価額	当期末	
		千円	%
公社債	284,924,070		96.8
コール・ローン等、その他	9,419,490		3.2
投資信託財産総額	294,343,560		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、290,714,954千円、98.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.05円、1カナダ・ドル=82.73円、1オーストラリア・ドル=81.32円、1シンガポール・ドル=81.07円、1イギリス・ポンド=145.92円、1デンマーク・クローネ=17.14円、1ノルウェー・クローネ=13.55円、1スウェーデン・クローネ=12.38円、1メキシコ・ペソ=5.42円、1マレーシア・リンギット=27.46円、1南アフリカ・ランド=8.10円、1ポーランド・ズロチ=29.52円、1ユーロ=127.74円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年6月22日)現在

項	目	当期末
(A) 資	産	582,650,048,876円
コ ー ル 一 社	等 債(評価額)	6,978,727,967
未 収 未 収 前 払	入 利 費	284,924,070,134 288,589,913,525 1,848,061,994 309,275,256
(B) 負	債	291,917,081,146
未 未 そ の 他	払 解 未 払	291,150,535,216 766,543,000 2,930
(C) 純	資 産	290,732,967,730
元	総	219,492,082,847
次 期	約 未 費	71,240,884,883
(D) 受	益 權	219,492,082,847口
1 万 口	當 た り 基 準 価 額(C/D)	13,246円

(注1) 期首元本額 131,360,464,925円
 追加設定元本額 132,599,701,676円
 一部解約元本額 44,468,083,754円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	1,891,112,435円
たわらノーロード バランス(堅実型)	12,707,246円
たわらノーロード バランス(標準型)	35,031,310円
たわらノーロード バランス(積極型)	33,804,469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)	1,140,131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)	41,101,998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)	48,098,965円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	15,191,899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)	15,802,411円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	530,716円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	559,196円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,779,547円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,378,203円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,834,481円
投資のソムリエ	32,208,058,763円
投資のソムリエ<DC年金>	2,412,814,203円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,087,523,549円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	38,955,576,435円
ワールドアセットバランス(基本コース)	6,071,699,281円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	23,768,329,118円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,033,404円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,618,817円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	10,000,521円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,191,613円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,690,096,657円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)	(適格機関投資家限定) 8,825,007,351円
D IAM世界アセットバランスファンド2VA	(適格機関投資家限定) 19,518,746,374円
D IAM世界アセットバランスファンド40VA	(適格機関投資家限定) 1,083,036,678円
D IAM世界アセットバランスファンド25VA	(適格機関投資家限定) 6,938,447,856円

D IAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	33,009,685,478円
D IAMバランス30VA (適格機関投資家限定)	25,667,266円
D IAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	29,458,897,949円
D IAMバランス20VA (適格機関投資家限定)	153,072,065円
D IAM世界アセットバランスファンド7VA (1212) (適格機関投資家限定)	2,619,820,816円
D IAM世界アセットバランスファンド7VA (1303) (適格機関投資家限定)	2,627,419,330円
D IAM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)	3,475,672,740円
D IAM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)	437,593,576円
期末元本合計	219,492,082,847円

■損益の状況

当期 自2017年6月23日 至2018年6月22日

項	目	当期
(A) 配 当 等 収 益		5,400,769,358円
受 取 利 息		5,404,030,270
そ の 他 収 益		168,265
支 払 利 息		△3,429,177
(B) 有 價 証 券 売 買 損 益		△9,331,589,489
売 買 益		27,057,582,517
売 買 損		△36,389,172,006
(C) そ の 他 費 用		△24,758,740
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)		△3,955,578,871
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		45,669,215,676
(F) 解 約 差 損 益 金		△14,572,853,246
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		44,100,101,324
(H) 合 計(D+E+F+G)		71,240,884,883
次 期 繰 越 損 益 金(H)		71,240,884,883

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

■ベンチマークの名称に変更があるため約款に所要の変更を行いました。

変更前：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）

変更後：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）

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

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(平成30年3月1日)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第10期（決算日 2018年4月18日）
 (計算期間 2017年4月19日～2018年4月18日)

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券、投資証券組入比率	純資産額
		期中騰落率	期中騰落率				
6期(2014年4月18日)	円 9,335	% 8.4	ポイント 203,185.39	% 8.7	% 97.3	% 1.7	% 1.0 百万円 39,802
7期(2015年4月20日)	11,412	22.2	250,241.33	23.2	95.4	3.6	0.9 41,339
8期(2016年4月18日)	8,600	△24.6	189,749.05	△24.2	92.8	6.1	1.0 36,196
9期(2017年4月18日)	10,121	17.7	224,042.80	18.1	95.8	3.2	0.9 40,863
10期(2018年4月18日)	12,241	20.9	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7 66,443

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

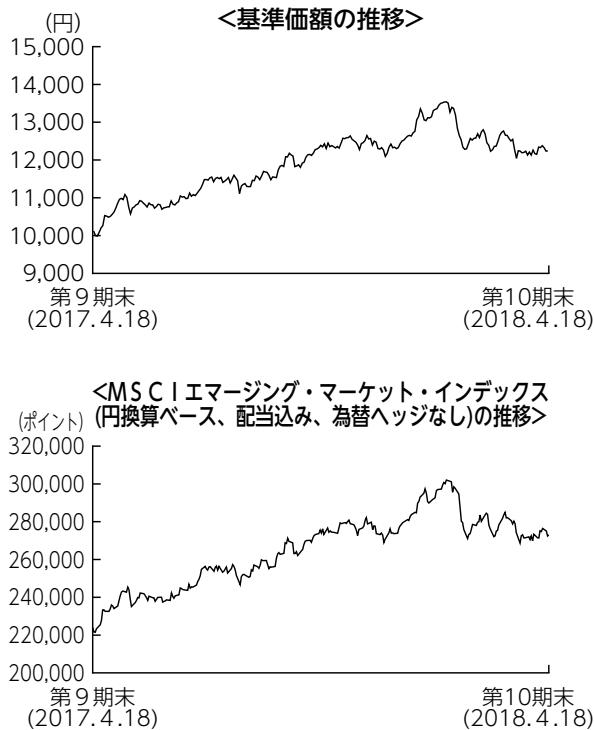
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	M S C I エマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投 資 信 託 受 益 証 券、 投 資 証 券 組 入 比 率
		騰落率					
(期 首) 2017年 4月 18日	円 10,121	% —	ポイント 224,042.80	% —	% 95.8	% 3.2	% 0.9
4 月 末	10,487	3.6	232,547.57	3.8	93.0	6.0	0.8
5 月 末	10,814	6.8	239,840.87	7.1	90.7	8.5	0.8
6 月 末	10,978	8.5	243,929.61	8.9	93.4	5.9	0.9
7 月 末	11,406	12.7	253,270.57	13.0	92.3	6.7	0.9
8 月 末	11,698	15.6	259,848.42	16.0	92.8	7.0	0.8
9 月 末	11,805	16.6	262,128.23	17.0	93.2	7.0	0.8
10 月 末	12,316	21.7	273,866.50	22.2	93.3	5.9	0.7
11 月 末	12,473	23.2	277,632.15	23.9	94.7	4.6	0.7
12 月 末	12,759	26.1	283,755.81	26.7	90.1	9.2	0.7
2018年 1 月 末	13,265	31.1	295,572.49	31.9	92.5	6.8	0.7
2 月 末	12,695	25.4	283,847.54	26.7	90.9	16.6	0.6
3 月 末	12,199	20.5	271,464.17	21.2	93.8	5.5	0.6
(期 末) 2018年 4月 18日	12,241	20.9	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過 (2017年4月19日から2018年4月18日まで)



基準価額の推移

当期末の基準価額は12,241円となり、前期末比で20.9%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

当期の新興国株式市場は前期末比で上昇しました。

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

為替市場では米政権幹部の米ドル安を認める発言などから米ドル安が進み、前期末比で円高となりました。新興国通貨では改革派の新大統領誕生が好感された南アフリカや、原油価格の回復により財政の改善期待が高まったマレーシアの通貨が買われ円安となったものの、米国が経済制裁を発動したロシアや、財政改革への期待が後退したブラジル、中央銀行の独立性が懸念されたトルコでは通貨が売られ円高となりました。

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	組入比率
1	銀行	17.0%
2	ソフトウェア・サービス	10.4
3	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.3
4	素材	7.2
5	エネルギー	7.1
6	電気通信サービス	5.4
7	半導体・半導体製造装置	4.9
8	資本財	3.9
9	食品・飲料・タバコ	3.8
10	保険	3.3

期末

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



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 業種はGICS（世界産業分類基準）によるものです。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で21.9%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株式)	6円 (5)	0.054% (0.042)
(先物・オプション)	(1)	(0.011)
(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 (株式)	5 (5)	0.044 (0.044)
(c) その他費用 (保管費用)	13 (12)	0.109 (0.098)
(その他の)	(1)	(0.011)
合計	25	0.206

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(11,925円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況(2017年4月19日から2018年4月18日まで)

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	アメリカ	百株 9,793.61 (219.6)	千アメリカ・ドル 24,046 (-)	百株 3,554.77	千アメリカ・ドル 8,125
	香港	百株 276,452.5 (1,936.36)	千香港・ドル 352,963 (△304)	百株 121,968.36	千香港・ドル 129,512
	台湾	百株 126,899.77 (2,672.64)	千台湾・ドル 712,231 (△960)	百株 46,429.96	千台湾・ドル 244,870
	トルコ	百株 7,548.18 (93.85)	千トルコ・リラ 8,424 (-)	百株 2,817.12	千トルコ・リラ 2,934
	メキシコ	百株 23,559.7 (-)	千メキシコ・ペソ 87,938 (△161)	百株 8,918.75	千メキシコ・ペソ 33,923
	フィリピン	百株 29,141.03 (-)	千フィリピン・ペソ 126,556 (-)	百株 19,157.25	千フィリピン・ペソ 45,485
	チリ	百株 288,050.36 (9,477.31)	千チリ・ペソ 1,600,362 (△94,107)	百株 151,278.23	千チリ・ペソ 615,637
	コロンビア	百株 3,043.77 (-)	千コロンビア・ペソ 3,159,311 (-)	百株 611.18	千コロンビア・ペソ 1,194,203
	カタール	百株 1,277.16 (20.7)	千カタール・リアル 4,255 (-)	百株 582.03	千カタール・リアル 1,435
	イラン	百株 21,766.6 (7,392.22)	千インド・ルピー 1,197,253 (-)	百株 8,145.08	千インド・ルピー 421,305
	パキスタン	百株 2,522 (-)	千パキスタン・ルピー 59,274 (-)	百株 230	千パキスタン・ルピー 5,995

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
トルコ EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	千口 68,337 (-)	千トルコ・リラ 173 (-)	千口 - (-)	千トルコ・リラ - (-)
メキシコ FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV CEMEX SAB DE CV FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 74.5 (-) 560.7 (45,964) 178.6 (-)	千メキシコ・ペソ 12,962 (-) 8,069 (-) 5,265 (△44)	千口 27.6 (-) 208.9 (-) 44.8 (-)	千メキシコ・ペソ 4,759 (-) 3,029 (-) 1,302 (-)
南アフリカ HYPROP INVESTMENTS LTD RESILIENT REIT LTD	千口 15,888 (-) 8,088 (-)	千南アフリカ・ランド 1,764 (-) 992 (-)	千口 6,276 (-) - (-)	千南アフリカ・ランド 660 (-) - (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円 51,639	百万円 48,621	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	30,948,697千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	50,605,692千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.61

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2017年4月19日から2018年4月18日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘 柄	期首(前期末)	当期末				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)							
CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	306	416	1,781	190,956	インターネット販売・通信販売		
SURGUTNEfteGAZ SP ADR PREF	217.73	235	385	41,314	金属・鉱業		
CREDICORP LTD	654	755	362	38,849	石油・ガス・消耗燃料		
SINA CORP	51.49	70.49	1,610	172,696	銀行		
MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	419.25	607.25	595	62,946	インターネットソフトウェア・サービス		
NETEASE INC-ADR	65	83	2,308	63,860	無線通信サービス		
SOUTHERN COPPER CORP	87.8	87.8	496	247,513	インターネットソフトウェア・サービス		
LUKOIL SPOON ADR	365.09	462.85	2,940	53,272	金属・鉱業		
GAZPROM PAO ADR	4,572.19	5,826.6	2,650	315,170	石油・ガス・消耗燃料		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	1,012.58	1,198.44	619	284,135	石油・ガス・消耗燃料		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	792.8	962.8	137	66,420	銀行		
SURGUTNEfteGAZ ADR	663.14	982.17	454	14,738	不動産管理・開発		
SISTEMA PJSC GDR	158.37	—	—	48,706	石油・ガス・消耗燃料		
NOVATEK PJSC GDR	79.64	103.65	1,279	—	無線通信サービス		
Baidu INC-SPOON ADR	222	289	6,810	137,113	石油・ガス・消耗燃料		
NOVOLIPETSK STEEL GDR	—	139.7	333	730,124	インターネットソフトウェア・サービス		
MMC NORILSK NICKEL ADR	493.94	726.38	1,202	35,792	金属・鉱業		
ROSTELECOM SPOON ADR	225.58	—	—	128,910	金属・鉱業		
ROSNEFT OIL CO GDR	1,110.52	1,389.2	729	—	各種電気通信サービス		
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	110	142	1,312	78,184	石油・ガス・消耗燃料		
SEVERSTAL GDR	224.19	269.57	399	140,654	各種消費者サービス		
TATNEFT ADR	208.22	284.7	1,816	42,826	金属・鉱業		
VTB BANK OJSC GDR	2,439.97	3,220	617	194,716	石油・ガス・消耗燃料		
DP WORLD LTD	136.96	183.2	403	66,206	銀行		
MAGNIT PJSC GDR	260.52	388.47	741	19,716	運送インフラ		
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	331	434	694	43,225	食品・生活必需品小売り		
RUSHYDRO PJSC ADR	1,272.39	1,939.6	221	79,540	インターネット販売・通信販売		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	36	339	1,227	74,439	電力		
SBERBANK ADR	2,295.14	2,890.2	4,098	131,590	各種消費者サービス		
PHOSAGRO PJSC GDR	134.64	199.72	288	439,338	銀行		
YY INC-ADR	24	43	30,916	30,916	化学		
58.COM INC ADR	68	97	409	43,943	インターネットソフトウェア・サービス		
AUTOHOME INC ADR	—	56	803	86,181	インターネットソフトウェア・サービス		
WEIBO CORP ADR	27	49	553	59,293	インターネットソフトウェア・サービス		
JD.COM INC ADR	554	692	589	63,233	インターネットソフトウェア・サービス		
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	920	1,208.8	2,786	298,732	インターネット販売・通信販売		
MOMO INC SPOON ADR	—	115	2,1601	2,315,654	インターネットソフトウェア・サービス		
YUM CHINA HOLDINGS INC	309	405	407	43,665	インターネットソフトウェア・サービス		
407	405	1,649	176,833	—	ホテル・レストラン・レジャー		
小計	株 銘柄	株 数 数<比 率>	金額 36銘柄	20,894.15 36銘柄	27,352.59 37銘柄	65,908 —	
				7,065,444 <10.6%>			
(香港)							
JIANGXI COPPER CO LTD	百株	百株	千香港・ドル	千円			
JIANGSU EXPRESS	1,000	1,380	1,484	20,283	金属・鉱業		
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	1,020	1,240	1,339	18,293	運送インフラ		
CHINA MOBILE LIMITED	1,620	1,620	1,244	16,995	旅客航空輸送業		
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	5,025	6,440	46,754	638,665	無線通信サービス		
BEIJING ENTERPRISES	1,010	1,310	5,842	79,809	建設資材		
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	355	525	2,094	28,614	コングロマリット		
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	3,580	4,240	2,090	28,553	独立系発電事業者・エネルギー販売業者		
YANZHOU COAL MINING CO LTD	2,760	3,720	1,499	20,478	ヘルスケア・テクノロジー		
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	1,580	1,880	1,755	23,985	石油・ガス・消耗燃料		
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	635	770	5,782	78,991	パーソナル用品		
CNOOC LTD	670.2	—	—	—	自動車		
	14,420	18,770	23,424	319,984	石油・ガス・消耗燃料		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(香港)						
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	百株 2,440	百株 3,220		千香港・ドル 4,585	千円 62,634	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	3,540	4,980		10,034	137,074	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	3,131.2	4,051.2		10,614	144,989	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,268.88	2,928.88		8,244	112,623	不動産管理・開発
CITIC LTD	3,930	6,300		7,131	97,417	コングロマリット
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	1,260	1,880		2,101	28,711	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	5,880	7,300		2,883	39,388	コンピュータ・周辺機器
PETRO CHINA CO LTD	17,100	22,000		12,144	165,887	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	4,887.42	6,487.42		6,552	89,504	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	1,317.9	1,741.9		4,154	56,749	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	20,712	26,652		19,615	267,952	石油・ガス・消耗燃料
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	770	1,020		2,295	31,349	情報技術サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	620	800		5,492	75,020	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	2,260	3,660		2,327	31,797	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,300	1,620		1,036	14,162	運送インフラ
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	1,040	1,320		2,275	31,085	運送インフラ
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	3,260	3,740		1,772	24,215	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT LTD	780	1,120		1,870	25,549	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,400	1,858		5,137	70,176	ガス
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	—	660		2,148	29,345	電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	4,350	5,220		11,692	159,723	自動車
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	760	860		2,390	32,658	ガス
BYD CO LTD	530	680		4,175	57,033	自動車
CHINA TELECOM CORP LTD	11,300	14,640		5,167	70,593	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	1,460	2,020		1,660	22,681	エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	9,500	11,700		1,099	15,023	メディア
SINOTRANS LTD	1,470	—		—	—	航空貨物・物流サービス
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	2,010	2,490		2,669	36,462	商業サービス・用品
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	—	1,700		1,460	19,947	紙製品・林産品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	3,731.92	4,851.92		6,491	88,678	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	1,640	2,250		1,149	15,705	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	1,652	1,952		2,736	37,383	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	2,600	2,900		2,192	29,948	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	6,210	7,790		16,826	229,848	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	5,830	5,850		2,158	29,487	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,600	1,600		784	10,709	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,057	3,172		3,010	41,119	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD	847.2	2,154.4		2,003	27,369	機械
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	2,970	3,530		1,761	24,061	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL	430	430		877	11,982	コングロマリット
TINGJI HOLDING CORP	1,640	1,940		3,239	44,255	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	300	400		1,698	23,194	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	2,320	2,980		3,623	49,499	水道
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	1,213.33	1,733.33		6,101	83,344	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	1,160	1,460		1,124	15,356	運送インフラ
SINO BIOPHARMACEUTICAL	3,300	4,740		7,309	99,842	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,340	2,920		7,884	107,695	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	4,664	5,979		237,485	3,244,057	インターネットソフトウェア・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,315	5,470		44,334	605,607	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	3,180	5,660		2,422	33,091	水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	9,702.4	9,702.4		805	11,000	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,720	—		—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	1,620	1,980		1,991	27,209	旅客航空輸送業
ZTE CORP	584.88	712.88		1,824	24,929	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	2,500	2,500		672	9,186	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	2,600	3,600		6,760	92,352	石油・ガス・消耗燃料
BANK OF COMMUNICATIONS	8,032.05	9,172.05		5,640	77,053	銀行

銘 柏	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(香港)						
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	百株 1,460	百株 2,062.5		千香港・ドル 2,000	千円 27,328	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	605	775		10,400	142,070	電子装置・機器・部品
CHINA CONSTRUCTION BANK	68,895.3	88,185.3		69,578	950,438	銀行
SHENZHOI INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	470	800		6,904	94,308	織維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,960	2,940		2,531	34,578	自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	—	1,600		2,640	36,062	不動産管理・開発
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	1,140	1,680		1,938	26,482	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	2,380	3,740		3,321	45,366	建設資材
BANK OF CHINA LTD	65,002	83,102		34,238	467,691	銀行
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,020	1,200		2,484	33,931	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	844	1,004		1,863	25,454	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	3,179.7	4,089.7		13,087	178,768	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	60,162.35	77,302.35		50,942	695,871	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	1,996	2,756		1,226	16,752	各種電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	3,670	4,830		3,960	54,101	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	1,620	—		—	—	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	540	640		1,404	19,189	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	400	607		2,285	31,217	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	880	1,250		3,450	47,127	家庭用耐久財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	4,181.42	5,691.42		8,833	120,659	不動産管理・開発
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	—	3,690		1,985	27,118	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	8,358	9,388		5,097	69,634	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,690	—		—	—	織維・アパレル・贅沢品
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	580	757		11,127	152,007	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	750	1,150		5,175	70,690	織維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL	2,155.28	2,795.28		4,802	65,599	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	3,160	5,680		2,504	34,216	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	2,495	3,085		1,761	24,062	不動産管理・開発
SOHO CHINA LTD	1,780	1,780		724	9,896	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	850	810		2,008	27,440	ソフトウェア
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	10,960	13,620		1,321	18,046	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD	3,010	4,470		2,556	34,926	建設・土木
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	—	790		976	13,338	通信機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	1,610	1,875		1,578	21,565	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,700	4,970		3,170	43,313	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	2,152	2,768		9,286	126,855	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,490	3,490		8,672	118,468	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD - H	3,164.5	4,034.5		2,646	36,152	機械
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	1,040	1,530		2,861	39,082	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,005	2,400		2,140	29,243	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO	984	1,280		4,441	60,672	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	2,138.05	2,078.05		3,000	40,989	自動車
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	2,120	2,850		1,710	23,358	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	2,660	3,170		2,117	28,925	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	568	900		1,872	25,571	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	3,420	4,720		1,449	19,793	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIHUA PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	—	3,250		656	8,967	医薬品
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,630	2,570		8,172	111,637	不動産管理・開発
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	1,215	1,615		3,730	50,960	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	581	814		2,840	38,806	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	4,548.8	5,428.8		3,984	54,431	銀行
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,570	2,570		981	13,410	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	21,460	27,260		11,585	158,257	銀行
FAR EAST HORIZON LTD	1,660	2,020		1,583	21,633	各種金融サービス
CITIC SECURITIES CO LTD	1,650	2,425		4,452	60,818	資本市場
HAITONG SECURITIES CO LTD	2,352	3,636		3,810	52,051	資本市場
PEOPLES INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	5,060	6,910		2,529	34,546	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)							
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	百株	百株	千香港・ドル	千円		医薬品	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	335	490	2,197	30,019		不動産管理・開発	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	—	3,820	2,444	33,395		建設・土木	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	1,575	—	—	—		資本市場	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	2,185	3,455	1,720	23,503		半導体・半導体製造装置	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	9,860	9,860	0	0		自動車部品	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	—	1,000	1,240	16,938		食品	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,230	3,230	0	0		資本市場	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	7,450	9,040	2,567	35,070		機械	
CHINA VANKE CO LTD-H	940	1,640	3,780	51,637		不動産管理・開発	
CGN POWER CO LTD	1,125,61	1,254,61	3,995	54,584		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	7,740	12,130	2,498	34,133		不動産管理・開発	
GF SECURITIES CO LTD	5,750	7,025	2,746	37,520		資本市場	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	1,030	1,332	1,878	25,655		自動車部品	
HUATAI SECURITIES CO LTD	544	512	1,461	19,967		資本市場	
3SBIO INC	1,222	1,794	2,698	36,857		バイオテクノロジー	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	900	1,130	1,993	27,228		医薬品	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	2,120	2,310	31,565		資本市場	
MEITU INC	4,300	10,000	3,180	43,438		コンピュータ・周辺機器	
HENGTEK NETWORKS GROUP LTD	—	1,050	932	12,736		繊維・アパレル・贅沢品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	623,271.39	779,691.89	999,014	13,646,535		
		136銘柄	139銘柄	—	<20.5%>		
(台湾)							
ACER INC	百株	百株	千台湾・ドル	千円		コンピュータ・周辺機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	3,365.32	3,145.32	6,888	25,142		コンピュータ・周辺機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	575.54	745.54	20,390	74,425		半導体・半導体製造装置	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	376.16	466.16	5,990	21,864		半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	5,338.06	7,378.06	32,832	119,838		建設資材	
TAIWAN BUSINESS BANK	1,979.28	2,629.28	7,664	27,974		銀行	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	3,263.8	3,361.71	2,965	10,822		化学	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	580	—	—	—		半導体・半導体製造装置	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	780	990	6,286	22,945		コンピュータ・周辺機器	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	570	730	6,935	25,312		コンピュータ・周辺機器	
QUANTA COMPUTER INC	313.12	725.43	5,433	19,832		コンピュータ・周辺機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	2,228.58	2,668.58	14,356	52,402		コンピュータ・周辺機器	
EVA AIRWAYS CORP	950.7	900.7	4,012	14,646		不動産管理・開発	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	1,535.55	2,861.61	4,335	15,823		旅客航空輸送業	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	537.6	687.6	24,856	90,727		コンピュータ・周辺機器	
CHINA AIRLINES	4,111.96	5,397.55	9,175	33,491		銀行	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	2,321.56	2,321.56	2,426	8,855		旅客航空輸送業	
CHINA STEEL CORP	1,591.69	2,011.69	9,545	34,840		自動車部品	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	10,180.58	13,500.58	31,456	114,815		金属・鉱業	
ADVANTECH CO LTD	2,601.62	2,641.46	8,228	30,032		保険	
COMPAL ELECTRONICS INC	262.64	368.89	7,433	27,130		コンピュータ・周辺機器	
DELTA ELECTRONICS INC	2,983.04	4,503.04	8,825	32,214		コンピュータ・周辺機器	
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,686.63	2,066.63	24,799	90,518		電子装置・機器・部品	
CHUNGHWACHELCO CO LTD	570	1,100	9,845	35,934		半導体・半導体製造装置	
AU OPTRONICS CORP	3,133.27	3,903.27	44,302	161,702		各種電気通信サービス	
TAIWAN MOBILE CO LTD	6,461.94	8,801.94	11,090	40,480		電子装置・機器・部品	
EVERGREEN MARINE CORP	1,338	1,718	18,812	68,664		無線通信サービス	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,603.92	1,786.58	2,626	9,585		海運業	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,208.24	3,418.24	9,058	33,062		コンプロマリット	
ECLAT TEXTILE CO LTD	298.25	298.25	4,160	15,186		繊維・アパレル・贅沢品	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	150.22	183.22	6,577	24,008		繊維・アパレル・贅沢品	
FORMOSA PLASTICS CORP	602.85	612.85	7,721	28,184		半導体・半導体製造装置	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	3,396.33	4,366.33	46,283	168,933		化学	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	330	650	2,122	7,746		繊維・アパレル・贅沢品	
		2,655.94	3,105.94	33,544	122,436	化学	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(台湾)							
TRANSCEND INFORMATION INC	百株	百株	千台湾・ドル	千円	千円	コンピュータ・周辺機器	
GIANT MANUFACTURING	128.97	—	—	—	—	レジャー用品	
MEDIATEK INC	231.51	301.51	4,462	16,287	16,287	半導体・半導体製造装置	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,225.07	1,575.07	53,552	195,466	195,466	各種金融サービス	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	5,829.36	7,039.36	35,161	128,339	128,339	銀行	
HOTAI MOTOR CO LTD	6,136.32	7,093.13	12,590	45,954	45,954	専門小売り	
FAREASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	180	310	9,160	33,435	33,435	無線通信サービス	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,340	1,770	13,806	50,391	50,391	資本市場	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,311.41	10,461.41	14,332	52,312	52,312	保険	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	6,739.2	8,589.2	44,320	161,768	161,768	銀行	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	10,914.03	13,614.03	14,090	51,430	51,430	銀行	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	5,962.4	9,070.28	18,185	66,378	66,378	電子装置・機器・部品	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	12,735.32	16,345.32	141,387	516,062	516,062	銀行	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,504.95	11,374.95	28,835	105,249	105,249	電子装置・機器・部品	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	82.2	102.2	36,587	133,544	133,544	銀行	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	7,177.48	9,989.77	14,185	51,776	51,776	保険	
INVENTEC CO LTD	6,947.24	8,567.24	10,195	37,211	37,211	コンピュータ・周辺機器	
HTC CORPORATION	2,070.05	2,680.05	6,030	22,009	22,009	コンピュータ・周辺機器	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	568.32	568.32	3,512	12,819	12,819	コンピュータ・周辺機器	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,558.45	2,188.45	8,983	32,790	32,790	コンピュータ・周辺機器	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	8,343.32	10,955.33	11,393	41,586	41,586	銀行	
MACRONIX INTERNATIONAL	14,440.48	18,500.48	39,036	142,481	142,481	銀行	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	—	1,930	9,042	33,003	33,003	半導体・半導体製造装置	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	7,522.82	8,913.27	18,049	65,880	65,880	銀行	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	169.5	—	—	—	—	レジャー用品	
NAN YA PLASTICS CORP	555.6	685.6	6,499	23,723	23,723	半導体・半導体製造装置	
WISTRON CORP	3,908.28	4,998.28	41,185	150,328	150,328	化学	
POU CHEN CORP	2,091.1	2,593.01	6,288	22,951	22,951	コンピュータ・周辺機器	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	1,619.9	2,369.9	9,041	33,000	33,000	繊維・アパレル・贅沢品	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	4,022.97	5,112.97	36,046	131,569	131,569	食品	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	473.92	573.92	17,303	63,158	63,158	食品・生活必需品小売り	
PHISON ELECTRONICS CORP	934.8	1,374.8	16,153	58,961	58,961	石油・ガス・消耗燃料	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	126.58	166.58	4,714	17,206	17,206	半導体・半導体製造装置	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	755.47	906.56	3,227	11,779	11,779	不動産管理・開発	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	787.15	687.15	3,903	14,245	14,245	繊維・アパレル・贅沢品	
SILICONWARE PRECISION INDS	765.88	945.88	7,330	26,756	26,756	コンピュータ・周辺機器	
STANDARD FOODS CORP	1,637.43	2,277.43	11,614	42,394	42,394	半導体・半導体製造装置	
SYNTEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	356.53	706.39	4,761	17,377	17,377	食品	
TAIWAN CEMENT CORP	1,148.99	1,448.99	6,404	23,376	23,376	電子装置・機器・部品	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	2,738.74	3,898.74	14,815	54,075	54,075	建設資材	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,560	2,280	5,506	20,097	20,097	電気設備	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	20,210.83	25,800.83	614,059	2,241,318	2,241,318	半導体・半導体製造装置	
WINBOND ELECTRONICS CORP	9,875.25	12,005.25	18,428	67,262	67,262	半導体・半導体製造装置	
YAGEO CORP	—	3,240	6,026	21,996	21,996	半導体・半導体製造装置	
YULON MOTOR CO	—	220	13,288	48,501	48,501	電子装置・機器・部品	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	651.49	—	—	—	—	自動車	
INNOLUX CORPORATION	—	2,270	5,266	19,222	19,222	運送インフラ	
WPG HOLDINGS CO LTD	6,693.45	9,643.45	11,138	40,654	40,654	電子装置・機器・部品	
HIVWIN TECHNOLOGIES CORP	1,225.26	1,995.26	7,861	28,693	28,693	電子装置・機器・部品	
TAIMED BIOLOGICS INC	172.16	205.6	10,567	38,572	38,572	機械	
PEGATRON CORP	130	180	4,491	16,392	16,392	バイオテクノロジー	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,465.54	1,955.54	13,493	49,250	49,250	コンピュータ・周辺機器	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	—	130	7,696	28,090	28,090	機械	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	690.76	1,300.76	10,591	38,657	38,657	半導体・半導体製造装置	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,880	1,880	1,669	6,093	6,093	各種金融サービス	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	343.85	483.85	3,135	11,444	11,444	各種電気通信サービス	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	6,435.23	8,528.28	14,583	53,229	53,229	電子装置・機器・部品	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
		外貨建金額				
(台湾)						
OBI PHARMA INC	百株	百株	千台湾・ドル	千円		
CASETEK HOLDINGS LTD	90	—	—	—		
GLOBALWAFERS CO LTD	120	—	—	—		
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	210	10,605	38,708		
GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	120	150	4,005	14,618		
	—	180	3,042	11,103		
小計	260,587.95	343,730.4	1,955,891	7,139,005		
	銘柄数	株式数	・金額			
	88銘柄	90銘柄		<10.7%>		
(トルコ)						
AKBANK TAS	百株	百株	千トルコ・リラ	千円		
ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	1,666.71	2,165.63	1,979	51,840		
ARCELIK	165.7	215.2	571	14,969		
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	275.96	304.29	502	13,149		
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	—	176.77	467	12,231		
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,126.25	1,527.76	1,624	42,532		
KOC HOLDING AS	55.84	89.14	536	14,054		
PETKIM PETROKIMYA HOLDING	526.99	845.07	1,250	32,755		
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	476.02	801.59	609	15,955		
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	568.71	796.24	376	9,863		
TURK HAVA YOLLARI	103.7	177.97	475	12,454		
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	399.58	578.27	1,052	27,563		
TURKIYE GARANTİ BANKASI AS	748.6	1,108.41	1,573	41,221		
TURKIYE IS BANKASI	1,752.7	2,430.61	2,318	60,729		
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	1,099.94	1,625.02	1,041	27,280		
ULKER BISKUVI SANAYI AS	105.59	129.01	1,443	37,808		
YAPI VE KREDİ BANKASI AS	76.96	131.21	271	7,120		
HACI OMER SABANCİ HOLDING AS	477.21	735.99	311	8,153		
COCA-COLA ICECEK AS	796.25	983.54	990	25,939		
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	64.51	64.51	229	6,004		
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	180.94	218.17	1,551	40,625		
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	636.08	907.31	557	14,590		
TURKIYE HALK BANKASI AS	287.06	137.35	344	9,028		
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	514.8	619.7	543	14,233		
	399.75	562	345	9,037		
小計	株式数	・金額		549,143		
	23銘柄	12,505.85	17,330.76	20,967		
				<0.8%>		
(メキシコ)						
ALFA SAB DE CV	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	2,057	3,062	7,137	42,468		
EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	423	538	6,736	40,080		
GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	156	191	2,638	15,696		
GRUPO TELEVISA SAB	1,525	—	—	—		
GRUPO BIMBO SAB DE CV	1,995	2,614	17,166	102,138		
GRUMA SAB DE CV	1,216	1,644	7,059	42,003		
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	160.6	245.7	5,552	33,034		
GRUPO CARSO SAB DE CV	178.45	220.3	4,163	24,775		
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	469	543	3,534	21,029		
MEXICHEM SAB DE CV	2,164	2,616	31,214	185,723		
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	876.25	1,082.25	6,370	37,902		
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	119.05	147	5,815	34,603		
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	1,303	1,567	5,464	32,511		
GRUPO MEXICO SAB DE CV	211.7	206.85	6,773	40,303		
AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,144.52	4,110.52	26,077	155,158		
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	27,113.78	35,278.78	62,760	373,427		
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,694	2,447	7,722	45,950		
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	297	434	5,807	34,553		
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	4,272	5,462	27,391	162,981		
OHL MEXICO SAB DE CV	300	397	7,846	46,687		
GENTERA SAB DE CV	702	—	—	—		
	849	1,030	1,591	9,468		
				消費者金融		

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
(メキシコ)						
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	455	532	4,722	28,099		
GRUPO LALA SAB DE CV	—	1,953.9	5,388	32,063	ガス	
	504	504	1,228	7,311	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	52,185.35 24銘柄	66,826.3 23銘柄	260,163	1,547,975 <2.3%>	食品
(フィリピン)						
AYALA LAND INC	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円		
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	5,530	7,964	31,656	65,213	不動産管理・開発	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	1,577.2	2,309.4	16,050	33,063	コングロマリット	
AYALA CORP	594.86	1,040.86	10,720	22,084	銀行	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	232.33	248.03	22,545	46,444	各種金融サービス	
DMCI HOLDINGS INC	1,698	3,406	4,836	9,963	コングロマリット	
GLOBE TELECOM INC	3,518.5	3,518.5	4,257	8,770	コングロマリット	
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	20.7	27.85	4,302	8,863	無線通信サービス	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	406.8	406.8	3,966	8,170	運送インフラ	
JOLLIBEE FOODS CORP	2,639.4	2,900.5	17,983	37,045	コングロマリット	
METROPOLITAN BANK & TRUST	360.3	441.3	12,735	26,235	ホテル・レストラン・レジャー	
BDO UNIBANK INC	474.51	820.37	6,759	13,925	銀行	
MEGAWORLD CORP	1,472.83	2,130.13	28,330	58,361	銀行	
PLDT INC	9,620	9,620	4,232	8,719	不動産管理・開発	
ROBINSONS LAND CORP	69.75	95.2	13,375	27,553	無線通信サービス	
SECURITY BANK CORP	1,724	2,187.22	4,199	8,650	不動産管理・開発	
SM PRIME HOLDINGS INC	94.5	234.2	5,246	10,806	銀行	
UNIVERSAL ROBINA CORP	6,336.75	9,369.75	31,388	64,660	各種金融サービス	
SM INVESTMENTS CORP	728.6	902.1	12,304	25,347	食品	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	199.88	241.58	22,177	45,684	コングロマリット	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	8,090	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
ABOITIZ POWER CORP	11,808	18,109	8,348	17,197	各種金融サービス	
MANILA ELECTRIC COMPANY	1,229	2,163	8,143	16,776	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	—	240	7,776	16,018	電力	
	56.8	90.7	9,723	20,029	各種金融サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	58,482.71 23銘柄	68,466.49 23銘柄	291,061	599,587 <0.9%>	
(チリ)						
BANCO SANTANDER CHILE	百株	百株	千チリ・ペソ	千円		
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	53,738.43	70,291.7	366,500	65,860	銀行	
BANCO DE CHILE	30.83	45.34	203,549	36,577	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	20,493.63	27,488.49	275,929	49,584	銀行	
EMPRESAS COPEC SA	879.42	1,248.39	298,877	53,708	紙製品・林産品	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	411.53	392.14	382,842	68,796	石油・ガス・消耗燃料	
ENTEL CHILE SA	93.89	151.7	134,741	24,213	飲料	
ENEL GENERACION CHILE SA	125.43	165	117,763	21,162	無線通信サービス	
ENEL AMERICAS SA	2,195.57	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
COLBUN SA	22,143.6	30,871.2	431,085	77,466	電力	
AGUAS ANDINAS SA	6,165.27	9,365.35	138,588	24,904	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
EMBOTELLADORA ANDINA SA	2,241.16	3,253.57	128,786	23,142	水道	
LATAM AIRLINES GROUP SA	213.8	272.7	83,061	14,926	飲料	
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	273.96	326.04	306,223	55,028	旅客航空輸送業	
SACI FALABELLA	94.32	93.43	297,453	53,452	化学	
ITAU CORPBANCA	506.96	774.28	459,705	82,609	複合小売り	
CENCOSUD SA	93,801.82	194,162.26	116,846	20,997	銀行	
AES GENER SA	1,069.32	1,483.98	273,720	49,187	食品・生活必需品小売り	
ENEL CHILE SA	2,571.35	2,571.35	44,528	8,001	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
	16,648.38	26,991.19	207,184	37,231	電力	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	223,698.67 19銘柄	369,948.11 18銘柄	4,267,387	766,849 <1.2%>	
(コロンビア)						
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円		
CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA	300.75	453.24	651,759	25,614	電力	
	77.87	—	—	—	各種金融サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(コロンビア)				千コロンビア・ペソ	千円	
ECOPETROL SA	百株 4,130.49	百株 4,479.53	1,285,625	50,525	石油・ガス・消耗燃料	
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	148.29	101.38	370,037	14,542	各種金融サービス	
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	2,478.61	3,736.94	459,643	18,063	銀行	
CEMENTOS ARGOS SA	281.29	622.75	609,049	23,935	建設資材	
GRUPO ARGOS SA	271.99	271.99	536,908	21,100	建設資材	
BANCOLOMBIA SA	—	259.2	894,240	35,143	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	337.32	471.49	1,606,837	63,148	銀行	
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	191.6	254.28	968,806	38,074	各種金融サービス	
小計	株数 銘柄 数<比率>	8,218.21 9銘柄	10,650.8 9銘柄	7,382,907 —	290,148 <0.4%>	
(カタール)				千カタール・リアル	千円	
QATAR INSURANCE CO SAQ	百株 114.62	百株 174.87	650	19,190	保険	
QATAR NATIONAL BANK	192.29	242.17	3,487	102,866	銀行	
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	166.51	217.11	736	21,712	銀行	
OOOREDOO QSC	67.37	84.1	696	20,554	各種電気通信サービス	
DOHA BANK QSC	64.24	180.35	474	13,992	銀行	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	24.06	32.22	634	18,724	総合公益事業	
INDUSTRIES QATAR QSC	134.42	155.52	1,718	50,700	コンプロマリット	
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	50.54	69.65	736	21,717	銀行	
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	160.79	285.29	415	12,270	石油・ガス・消耗燃料	
MASRAF AL RAYAN	307.92	389.23	1,412	41,680	銀行	
BARWA REAL ESTATE CO	79.16	79.16	278	8,208	不動産管理・開発	
EZDAN HOLDING GROUP QSC	663.39	844.31	902	26,625	不動産管理・開発	
DOHA BANK QSC-RTS	12.84	—	—	—	銀行	
小計	株数 銘柄 数<比率>	2,038.15 13銘柄	2,753.98 12銘柄	12,143 —	358,244 <0.5%>	
(インド)				千インド・ルピー	千円	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	百株 1,081.63	百株 2,984.36	281,798	462,149	石油・ガス・消耗燃料	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	391.09	748.55	30,739	50,412	石油・ガス・消耗燃料	
ASIAN PAINTS LTD	215.77	286.21	33,658	55,199	化学	
EICHER MOTORS LTD	12.64	14.43	44,772	73,427	機械	
GRASIM INDUSTRIES LTD	199.88	356.29	39,004	63,967	建設資材	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	304.28	800.51	64,789	106,254	自動車	
SHREE CEMENT LTD	7.09	8.3	14,091	23,109	建設資材	
ICICI BANK LTD	833.69	2,503.82	73,048	119,800	銀行	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	307.63	657.34	21,695	35,580	石油・ガス・消耗燃料	
STATE BANK OF INDIA LTD	1,325.33	1,838.08	45,611	74,803	銀行	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	56.63	36.57	4,993	8,189	陸運・鉄道	
LIC HOUSING FINANCE LTD	246.16	343.15	19,293	31,641	貯蓄・抵当・不動産金融	
TATA STEEL LTD	210.15	374.27	22,308	36,585	金属・鉱業	
TATA MOTORS LTD	1,288.86	1,746.54	58,762	96,370	自動車	
JSW STEEL LTD	651.22	860	26,586	43,602	金属・鉱業	
TATA POWER CO LTD	919.86	1,147.7	10,036	16,460	電力	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	—	33.39	17,837	29,253	食品	
NESTLE INDIA LTD	19.63	23.43	21,118	34,634	食品	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	490.99	736.48	6,492	10,646	電気設備	
GAIL INDIA LTD	401.28	689.58	22,456	36,828	ガス	
VEDANTA LTD	776.89	1,603.88	46,320	75,964	金属・鉱業	
AXIS BANK LTD	1,369.82	1,895.45	100,913	165,498	銀行	
TITAN COMPANY LTD	253.02	311.53	31,078	50,968	繊維・アパレル・贅沢品	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	942.54	1,215.18	21,970	36,031	石油・ガス・消耗燃料	
LUPIN LTD	183.2	225	18,113	29,706	医薬品	
ACC LTD	33	39.22	6,224	10,207	建設資材	
BAJAJ FINANCE LTD	138.4	175.42	33,944	55,669	消費者金融	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,242.88	1,591.84	300,810	493,328	貯蓄・抵当・不動産金融	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	474.19	581.63	33,469	54,890	メディア	
INFOSYS LTD	1,507.33	1,833.01	206,250	338,250	情報技術サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
		外貨建金額				
(インド)						
WIPRO LTD	百株 461.82	百株 1,215.45	千円 34,609	千円 56,760	情報技術サービス	
INDIAN OIL CORP LTD	—	1,166.92	19,510	31,997	石油・ガス・消耗燃料	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	536.74	683.93	98,865	162,139	家庭用品	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	64.54	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HCL TECHNOLOGIES LTD	464.34	592.5	59,901	98,238	情報技術サービス	
DABUR INDIA LTD	443.19	613.72	21,096	34,598	パーソナル用品	
HERO MOTOCORP LTD	41.16	47.9	18,053	29,607	自動車	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	94.67	115.96	24,415	40,042	医薬品	
BHARTI AIRTEL LTD	818.79	1,486.01	56,773	93,107	無線通信サービス	
UNITED SPIRITS LTD	54.44	63.66	22,203	36,413	飲料	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	787.58	1,027.77	52,637	86,325	医薬品	
DIVI'S LABORATORIES LTD	69.22	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	87.09	112.21	102,788	168,572	自動車	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	116.18	170.84	9,796	16,066	医薬品	
AUROBINDO PHARMA LTD	192.51	304.26	18,877	30,959	医薬品	
HAVELLS INDIA LTD	203.4	248	13,646	22,379	電気設備	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	295.34	644.6	22,129	36,291	自動車部品	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	127.85	150.42	23,520	38,573	消費者金融	
PETRONET LNG LTD	—	702.38	17,064	27,985	石油・ガス・消耗燃料	
CIPILA LTD/INDIA	288.76	355	20,588	33,764	医薬品	
LARSEN & TOUBRO LTD	241.88	504.12	68,537	112,401	建設・土木	
ULTRATECH CEMENT LTD	66.6	96.16	37,668	61,775	建設資材	
ASHOK LEYLAND LTD	979.6	1,138.2	17,004	27,887	機械	
BOSCH LTD	5.23	7.74	14,998	24,597	自動車部品	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	387.33	481.21	152,379	249,903	情報技術サービス	
NTPC LTD	1,277.52	1,803.33	31,909	52,332	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	82.69	82	21,299	34,931	医薬品	
YES BANK LTD	277.41	1,816.38	55,926	91,719	銀行	
AMBUJA CEMENTS LTD	501.74	722.16	17,682	28,998	建設資材	
BHARAT FORGE LTD	87.86	237.4	17,523	28,738	自動車部品	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	816.14	1,156.54	27,687	45,407	金属・鉱業	
ITC LTD	2,799.77	3,583.67	95,899	157,274	タバコ	
UNITED PHOSPHORUS LTD	292.11	361.1	27,355	44,862	化学	
SIEMENS INDIA LTD	101.47	62.19	6,711	11,007	コングロマリット	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	88.83	238.24	25,644	42,056	パーソナル用品	
TECH MAHINDRA LTD	436.55	467.41	31,237	51,228	情報技術サービス	
CAIRN INDIA LTD	372.31	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
IDEA CELLULAR LTD	1,035.91	1,965.27	14,041	23,028	無線通信サービス	
MARICO LTD	386	453.8	14,514	23,804	パーソナル用品	
POWER FINANCE CORP LTD	515.3	659.1	5,757	9,441	各種金融サービス	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	616.29	716.16	27,457	45,030	運送インフラ	
RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	—	856.77	11,005	18,048	各種金融サービス	
BAJAJ FINSERV LTD	39.79	37.2	20,185	33,103	保険	
BAJAJ AUTO LTD	61.91	84.02	24,065	39,466	自動車	
COAL INDIA LTD	521.77	759.01	21,829	35,799	石油・ガス・消耗燃料	
TATA MOTORS LTD	315.68	315.68	6,084	9,978	自動車	
VAKRANGEE LTD	—	359.54	4,309	7,066	情報技術サービス	
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	237.15	329.95	16,735	27,445	消費者金融	
BHARTI INFRATEL LTD	473.37	283.64	9,473	15,536	各種電気通信サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	243.48	344.12	46,705	76,597	貯蓄・抵当・不動産金融	
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	—	23.33	360	590	金属・鉱業	
CADILA HEALTHCARE LTD	181.46	181.46	7,035	11,537	医薬品	
IDFC BANK LTD	1,144.21	1,144.21	5,623	9,223	銀行	
小計	株数 銘柄 数	・金額 数 比 率	35,620.06	56,633.8	3,179,319	5,214,083
				80銘柄	—	<7.8%>
(パキスタン)						
LUCKY CEMENT LTD	百株 —	百株 99	千パキスタン・ルピー 6,806	—	千円 6,330	建設資材

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
(パキスタン)		百株	百株	千円		
MCB BANK LTD		—	390	8,361	7,776	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD		—	745	12,298	11,437	石油・ガス・消耗燃料
UNITED BANK LTD		—	514	10,363	9,638	銀行
HABIB BANK LTD		—	544	11,199	10,415	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	2,292	49,029	45,597	
		—銘柄	5銘柄	—	<0.1%>	
(インドネシア)		百株	百株	千円		
AKR CORPORINDO TBK PT		1,504	1,504	846,000	6,598	商社・流通業
UNITED TRACTORS TBK PT		1,654.01	1,692.01	6,175,836	48,171	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT		3,129	4,792	3,402,320	26,538	食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT		1,263	1,673	8,607,585	67,139	家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK		16,573	21,705	16,550,062	129,090	自動車
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK		41,309	53,615	19,783,935	154,314	各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT		6,209	8,456	3,086,440	24,074	食品
GUDANG GARAM TBK PT		405	486	3,637,710	28,374	タバコ
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK		7,820	9,248	3,745,440	29,214	タバコ
INDOCENTEM TUNGGAL PRAKARSA TBK PT		1,217	1,856	3,456,800	26,963	建設資材
SUMMARECON AGUNG TBK PT		8,705	—	—	—	不動産管理・開発
BANK DANAMON INDONESIA TBK PT		2,904.16	2,904.16	1,974,828	15,403	銀行
BANK MANDIRI		7,630	19,918	15,735,220	122,734	銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK		1,994	2,765	2,882,512	22,483	複合小売り
BANK RAKYAT INDONESIA		9,071	58,799	21,108,841	164,648	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT		7,876	10,641	2,351,661	18,342	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT		5,436	7,443	6,661,485	51,959	銀行
KALBE FARMA TBK PT		17,484	24,762	3,937,158	30,709	医薬品
SEMENT INDONESIA PERSERO TBK PT		2,416	3,303	3,303,000	25,763	建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT		10,087	10,390	23,663,225	184,573	銀行
XL AXIATA TBK PT		2,907	2,907	758,727	5,918	無線通信サービス
LIPPO KARAWACI TBK PT		15,603	—	—	—	不動産管理・開発
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT		4,685	—	—	—	メディア
JASA MARGA PERSERO TBK PT		2,001.25	2,001.25	902,563	7,039	運送インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT		5,928	8,517	1,524,543	11,891	不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT		12,230	14,345	3,055,485	23,832	石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK		31,945	19,128	1,195,500	9,324	不動産管理・開発
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT		1,826	2,390	2,013,575	15,705	食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT		1,808	1,808	1,030,560	8,038	各種電気通信サービス
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT		—	4,803	1,743,489	13,599	銀行
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT		3,920	3,920	921,200	7,185	建設・土木
PT SURYA CITRA MEDIA TBK		3,673	5,113	1,360,058	10,608	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	241,212.42	310,884.42	165,415,761	1,290,242	
		31銘柄	29銘柄	—	<1.9%>	
(アラブ首長国連邦)		百株	百株	千円		
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC		1,012.2	1,260	711	20,808	銀行
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC		1,434.15	1,869.09	3,214	93,969	各種電気通信サービス
DUBAI INVESTMENTS PJSC		—	1,322.22	275	8,038	コングロマリット
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC		1,446.52	2,083.32	1,495	43,722	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC		1,392.12	1,528.79	1,918	56,081	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC		2,938.19	3,868.87	2,263	66,155	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC		2,742.03	3,000	639	18,677	不動産管理・開発
EMAAR MALLS PJSC		1,781.66	1,781.66	383	11,196	不動産管理・開発
DXB ENTERTAINMENTS PJSC		2,727.83	2,727.83	123	3,596	ホテル・レストラン・レジャー
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC		—	1,902.35	574	16,792	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,474.7	21,344.13	11,599	339,041	
		8銘柄	10銘柄	—	<0.5%>	
(ブラジル)		百株	百株	千円		
BRF SA		497.92	442.92	931	29,308	食品
VALE SA		1,042.27	3,340.21	15,341	482,492	金属・鉱業

銘 柏	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(ブラジル)				千 ブラジル・レアル	千円	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	百株 80,18	百株 —	—	—	—	電力
VALE SA-PREF A	1,589.96	—	—	—	—	金属・鉱業
RAIA DROGASIL SA	228	234	1,650	51,912	51,912	食品・生活必需品小売り
TIM PARTICIPACOES SA	697	950	1,425	44,816	44,816	無線通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	194.5	194.5	420	13,212	13,212	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	245	294	543	17,087	17,087	電力
BANCO DO BRASIL SA	702	907	3,371	106,027	106,027	銀行
INVESTIMENTOS ITAU SA	3,364.78	4,166.86	5,500	172,983	172,983	銀行
LOJAS AMERICANAS SA	545.74	744.74	1,376	43,283	43,283	複合小売り
LOJAS AMERICANAS SA	146.7	—	—	—	—	複合小売り
GERDAU SA	680.3	1,022.3	1,717	54,014	54,014	金属・鉱業
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUCAO GRUPO PAO DE ACUCAR	131.06	170.06	1,215	38,240	38,240	食品・生活必需品小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,420.1	3,075.1	7,168	225,435	225,435	石油・ガス・消耗燃料
PETROLEO BRASILEIRO SA	3,224.12	4,104.12	8,630	271,443	271,443	石油・ガス・消耗燃料
KROTON EDUCACIONAL SA	1,129.68	1,482.68	2,080	65,422	65,422	各種消費者サービス
CCR SA	986.2	1,328.2	1,613	50,752	50,752	運送インフラ
WEG SA	414.4	564.4	1,255	39,494	39,494	機械
BANCO BRADESCO SA PREF	2,308.15	3,513.25	11,832	372,136	372,136	銀行
BANCO BRADESCO SA	639.41	1,079.18	3,384	106,436	106,436	銀行
NATURA COSMETICOS SA	148	194	622	19,591	19,591	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	505.06	616.06	535	16,836	16,836	金属・鉱業
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	—	470	1,780	56,007	56,007	紙製品・林産品
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	314	—	—	—	—	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA	174.74	—	—	—	—	電力
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2,641.98	3,386.98	17,111	538,141	538,141	銀行
PORTO SEGURO SA	94	126	555	17,471	17,471	保険
FIBRIA CELULOSE SA	214.9	246.9	1,666	52,413	52,413	紙製品・林産品
BRASKEM SA	120.3	170.3	812	25,563	25,563	化学
ENGIE BRASIL SA	139.7	173.7	659	20,731	20,731	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LOCALIZA RENT A CAR	131.05	511.8	1,485	46,727	46,727	陸運・鉄道
TELEFONICA BRASIL S.A.	361.28	472.28	2,330	73,285	73,285	各種電気通信サービス
LOJAS RENNER SA	527	772.7	2,576	81,020	81,020	複合小売り
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	260.64	318.64	447	14,069	14,069	電力
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	290.52	381.52	2,384	74,992	74,992	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	95	165	648	20,388	20,388	石油・ガス・消耗燃料
EQUATORIAL ENERGIA SA	167	224	1,577	49,616	49,616	電力
EMBRAER SA	497.6	670.6	1,542	48,507	48,507	航空宇宙・防衛
M DIAS BRANCO SA	84	104	469	14,767	14,767	食品
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETTRICA SA	—	250	520	16,377	16,377	電力
ODONTOPREV SA	223	322	471	14,815	14,815	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BR MALLS PARTICIPACOES SA	411	855.65	960	30,193	30,193	不動産管理・開発
JBS SA	532	899	810	25,502	25,502	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	643.49	962.49	779	24,518	24,518	電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	253.98	346.98	1,167	36,720	36,720	水道
MULTILAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	73.8	103.8	668	21,023	21,023	不動産管理・開発
DURATEX SA	277.34	—	—	—	—	紙製品・林産品
SUL AMERICA SA	178.69	178.69	363	11,436	11,436	保険
HYPERA SA	257	350	1,272	40,034	40,034	医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	1,656.16	2,181.16	5,599	176,089	176,089	資本市場
QUALICORP SA	178	220	492	15,491	15,491	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL SA	349	408	1,544	48,580	48,580	銀行
CIELO SA	995.07	1,293.07	2,460	77,389	77,389	情報技術サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	533	740	2,054	64,629	64,629	保険
ITAUSA - INVESTIMENTOS ITAU SA-RCT	—	76.42	100	3,162	3,162	銀行
ITAUSA - INVESTIMENTOS ITAU SA-RCT	49.08	—	—	—	—	銀行
ATACADAO DISTRIBUCAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	—	445	628	19,761	19,761	食品・生活必需品小売り
AMBEV SA	3,907.95	4,941.95	11,420	359,185	359,185	飲料

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(ブラジル) KLABIN SA RUMO SA AES TIETE ENERGIA SA	百株 467 687 147.58	百株 643 1,082 —	千ブラジル・レアル 1,356 1,508 —	千円 42,669 47,436 —	容器・包装 陸運・鉄道 独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 39,854.38 58銘柄	株数・金額 52,917.21 54銘柄	評価額 140,847 <6.7%>	邦貨換算金額 4,429,654 —		
(チェコ) KOMERCNI BANKA AS O2 CZECH REPUBLIC AS CEZ MONETA MONEY BANK AS	百株 57.07 56.77 135.6 357.35	百株 71 56.77 179.78 572.58	千チェコ・コルナ 6,571 1,623 9,771 4,924	千円 34,498 8,524 51,297 25,851	銀行 各種電気通信サービス 電力 銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 606.79 4銘柄	株数・金額 880.13 4銘柄	評価額 22,889 —	邦貨換算金額 120,171 <0.2%>		
(韓国) CHEIL WORLDWIDE INC HANMI SCIENCE CO LTD HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC DB INSURANCE CO LTD COWAY CO LTD KT&G CORP S-1 CORPORATION KOREA GAS CORP CJ CORP KAKAO CORP SK TELECOM CO LTD DAELIM INDUSTRIAL CO MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD NCSOFT CORPORATION LG UPLUS CORP DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT POSCO DAEWOO CORP LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD LG CHEM LTD LG CHEM LTD LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD HYUNDAI DEVELOPMENT CO S-OIL CORP HANWHA CHEMICAL CORPORATION SAMSUNG SECURITIES CO LTD LOTTE CHEMICAL CORPORATION HOTEL SHILLA CO LTD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HYUNDAI MOBIS SK HYNIX INC HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD HYUNDAI MOTOR CO HYUNDAI MOTOR CO HYUNDAI STEEL CO INDUSTRIAL BANK OF KOREA KCC CORP KIA MOTORS CORP KOREA ZINC CO LTD KOREA ELECTRIC POWER CORP HANWHA CORP KOREAN AIR CO LTD	百株 70.97 11.42 32.05 27.26 41.92 40.55 96.52 15.79 29.97 10.41 25.69 16.58 19.67 307.31 14.49 110.86 40.5 85.16 36 7.13 35.13 9.01 2.6 7.13 35.13 36.2 36.15 33.39 77.71 55.3 11.72 29.55 34.75 55.73 476.96 60.56 19.07 125.72 58.66 184.31 4.83 214.67 6.3 217.55 37.85 36.52	百株 70.97 11.64 41 32.87 50.6 52.8 123.85 21.26 29.97 15.47 48.77 20.3 29.87 406.12 18.7 — 40.5 135.4 36 10.15 49.4 6.41 1.77 1.77 10.15 59.1 43.83 77.71 66 16.65 29.55 36.2 71.83 59.1 43.83 77.71 237,270 683,482 305,842 441,640 1,784,975 5,068,436 321,399 180,928 2,579,062 401,250 393,740 240,865 883,430 361,812 948,466 146,290 178,643	千韓国・ウォン 135,197 103,596 420,250 864,481 306,130 466,224 1,227,353 215,789 145,354 244,426 575,486 453,705 233,882 365,914 716,210 — 61,357 76,907 81,540 1,325,590 1,820,390 129,161 132,042 2,046,295 251,766 512,811 223,804 237,270 683,482 305,842 441,640 1,784,975 5,068,436 321,399 180,928 2,579,062 401,250 393,740 240,865 883,430 361,812 948,466 146,290 178,643	千円 13,627 10,442 42,361 87,139 30,857 46,995 123,717 21,751 14,651 24,638 58,008 45,733 23,575 36,884 72,193 — 6,184 7,752 8,219 133,619 183,495 13,019 13,309 206,266 25,378 51,691 22,559 23,916 50,698 68,895 30,828 44,517 179,925 510,898 32,397 18,237 259,969 40,446 39,689 24,279 89,049 36,470 95,605 14,746 18,007	メディア 医薬品 自動車 保険 保険 家庭用耐久財 タバコ 商業サービス・用品 ガス コングロマリット インターネットソフトウェア・サービス 無線通信サービス 建設・土木 資本市場 ソフトウェア 各種電気通信サービス 電気設備 建設・土木 商社・流通業 パーソナル用品 パーソナル用品 銀行 建設・土木 石油・ガス・消耗燃料 資本市場 化学 化学 パーソナル用品 機械 自動車部品 半導体・半導体製造装置 建設・土木 自動車 自動車 金属・鉱業 銀行 建設関連製品 自動車 電力 コングロマリット 旅客航空輸送業	

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

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(韓国)						
DGB FINANCIAL GROUP INC	百株 135.39	百株 185.75	千韓国・ウォン 216,398	21,812	千円	銀行
GS RETAIL CO LTD	24.82	24.82	83,643	8,431		食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	54.99	75.17	384,118	38,719		自動車部品
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	—	9.78	418,095	42,143		機械
BGF RETAIL CO LTD	—	8.54	149,023	15,021		食品・生活必需品小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	—	23.81	304,768	30,720		食品
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	—	37.35	136,514	13,760		保険
NETMARBLE CORP	—	27.66	370,644	37,360		ソフトウェア
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD-RTS	—	123.01	22,756	2,293		機械
BGF CO LTD	15.94	—	—	—		食品・生活必需品小売り
SAMSUNG SDS CO LTD	26.09	36.75	869,137	87,609		情報技術サービス
WOORI BANK	254.32	508.29	759,893	76,597		銀行
SAMSUNG C&T CORP	62.59	80.72	1,122,008	113,098		コングロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	13.33	17.59	969,209	97,696		ライフサイエンス・ツール／サービス
DOOSAN BOBCAT INC	—	46.79	145,984	14,715		機械
SILLAJEN INC	—	53.78	562,001	56,649		バイオテクノロジー
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	—	34.9	327,711	33,033		ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
小計	株数 銘柄 数 率 6,921.93 107銘柄	株数 銘柄 数 率 9,498.66 114銘柄	金額 比 率 93,036,180 —	評価額 比 率 9,378,046 —	邦貨換算金額 比 率 <14.1%>	
(マレーシア)						
AMMB HOLDINGS BHD	百株 2,271	百株 1,902	千マレーシア・リンギット 751	20,705	千円	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	226	434	433	11,937		食品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	2,515	4,847	3,538	97,515		銀行
DIGI.COM BHD	2,899	3,591	1,666	45,921		無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	432.2	878.2	802	22,121		運送インフラ
RHB BANK BHD	1,245.8	680.8	367	10,131		銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	547	700	682	18,809		コングロマリット
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	692.35	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
GAMUDA BHD	1,357	1,946	992	27,352		建設・土木
GENTING BHD	2,049	2,482	2,233	61,563		ホテル・レストラン・レジャー
YTL CORP BHD	3,700.1	5,191.1	742	20,458		総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	166.56	202.56	390	10,751		銀行
HONG LEONG BANK BHD	480.08	630.08	1,188	32,750		銀行
IJM CORP BHD	1,827.6	3,455.6	929	25,618		建設・土木
IOI CORP BHD	1,896.13	2,402.13	1,145	31,578		食品
KUALA LUMPUR KEONG BHD	297	555	1,417	39,065		食品
MALAYAN BANKING BHD	2,745.75	4,437.75	4,712	129,887		銀行
LAFARGE MALAYSIA BHD	267	—	—	—		建設資材
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	861	861	370	10,203		銀行
MISC BHD	748.8	1,400.8	979	26,985		海運業
NESTLE MALAYSIA BHD	—	58	858	23,657		食品
PPB GROUP BHD	298	478	890	24,555		食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	175	314	840	23,174		石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	587	732	1,357	37,402		ガス
GENTING MALAYSIA BHD	2,156	3,019	1,545	42,600		ホテル・レストラン・レジャー
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	114	147	338	9,318		タバコ
TELEKOM MALAYSIA BHD	950	1,325	728	20,084		各種電気通信サービス
SP SETIA BHD	—	1,785	539	14,856		不動産管理・開発
TENAGA NASIONAL BHD	2,675.5	3,566.5	5,685	156,678		電力
UMW HOLDINGS BHD	766	390	238	6,578		自動車
DIALOG GROUP BHD	2,434.44	3,298.44	1,019	28,089		エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	2,247.3	3,038.3	7,285	200,797		銀行
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,458.63	1,487.8	141	3,895		総合公益事業
AIRASIA BHD	1,072	—	—	—		旅客航空輸送業
AIRASIA GROUP BHD	—	1,479	573	15,815		旅客航空輸送業
SIME DARBY BERHAD	1,921	2,327	646	17,828		コングロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	352	1,454	940	25,926		ヘルスケア機器・用品

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

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(南アフリカ)							
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円			
MONDI LTD	230,65	—	—	—		不動産管理・開発	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	82.93	115.2	3,847	34,436		紙製品・林産品	
RMI HOLDINGS	793.7	1,358.45	3,775	33,787		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	528.87	638.4	2,605	23,317		保険	
VODACOM GROUP PTY LTD	475.22	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー	
SIBANYE GOLD LTD	305.22	640.73	9,680	86,643		無線通信サービス	
NEPI ROCKCASTLE PLC	720.04	1,720	1,737	15,547		金属・鉱業	
FORTRESS REIT LTD-A	789.47	375.46	4,993	44,692		不動産管理・開発	
FORTRESS REIT LTD-B	651.13	1,029.5	1,682	15,055		エクイティ不動産投資信託(REITs)	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	2,424.17	953.02	1,476	13,212		エクイティ不動産投資信託(REITs)	
BID CORP LTD	271.64	2,678.66	624	5,585		家庭用耐久財	
		356.89	9,850	88,158		食品・生活必需品小売り	
小計	株数 銘柄	30,227.48	40,441.41	465,767	4,168,619		
	株数 銘柄	52銘柄	50銘柄	—	<6.3%>		
(タイ)							
BANGKOK BANK PCL	百株	百株	千タイ・バーツ	千円			
BEC WORLD PLC	197	277	5,872	20,142		銀行	
BERLI JUCKER PCL NVDR	862	—	—	—		メディア	
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	1,001	1,355	7,621	26,143		食品・生活必需品小売り	
ROBINSON PCL-NVDR	2,939	3,480	6,333	21,724		銀行	
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	394	643	4,083	14,004		複合小売り	
TRUE CORP PCL NVDR	1,421	1,927	26,303	90,221		銀行	
KASIKORN BANK PCL NVDR	10,845.55	10,307.55	7,318	25,101		各種電気通信サービス	
TMB BANK PCL -NVDR	490	712	14,204	48,721		銀行	
IRPC PCL NVDR	10,100	10,100	2,525	8,660		銀行	
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	8,634	10,655	7,724	26,496		石油・ガス・消耗燃料	
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	3,028	2,559	5,169	17,730		石油・ガス・消耗燃料	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	101	131	2,947	10,109		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	2,290	2,932	6,860	23,532		食品	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	843	1,113	22,705	77,878		無線通信サービス	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	2,382.2	3,587.2	5,057	17,348		専門小売り	
PTT PCL	316	442	3,049	10,460		電子装置・機器・部品	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	804	1,094	59,732	204,882		石油・ガス・消耗燃料	
SIAM CEMENT PCL NVDR	1,641	2,613	4,729	16,222		食品	
KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	84.5	116.5	5,615	19,260		建設資材	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	249	249	1,780	6,106		電子装置・機器・部品	
SIAM CEMENT PCL FOREIGN	3,550	4,556	31,892	109,389		運送インフラ	
KASIKORN BANK PCL - FOREIGN	227	295	14,219	48,771		建設資材	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	921	1,231	24,866	85,291		銀行	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,136	1,390	10,981	37,664		不動産管理・開発	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	3,238	4,114	9,503	32,596		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,503.1	2,368.1	9,353	32,084		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
THAI OIL PCL NVDR	702	1,189	10,998	37,723		ホテル・レストラン・レジャー	
GLOW ENERGY PCL NVDR	416	540	4,698	16,114		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
CP ALL PCL NVDR	4,075	5,231	43,548	149,369		食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	3,016	5,448	4,658	15,977		陸運・鉄道	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	1,000.45	1,343.45	16,390	56,218		石油・ガス・消耗燃料	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	974.22	1,740.22	10,006	34,321		化学	
INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	549.33	—	—	—		化学	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,829.08	2,395.08	22,992	78,865		石油・ガス・消耗燃料	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	930	1,180	3,894	13,356		運送インフラ	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	5,784	7,407	5,481	18,800			
小計	株数 銘柄	78,776.43	95,110.1	431,519	1,480,112		
	株数 銘柄	37銘柄	35銘柄	—	<2.2%>		
(ポーランド)							
BANK MILLENNIUM SA	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円			
MBANK	526.47	526.47	453	14,458		銀行	
		12.6	15.95	700	22,318	銀行	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(ポーランド)						
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円		
KGHM POLSKA MIEDZ SA	25.96	25.96	201	6,426	銀行	
BANK PEKAO SA	102.75	141.9	1,317	41,972	金属・鉱業	
ORANGE POLSKA SA	118.44	157.27	1,943	61,906	銀行	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	586	586	337	10,753	各種電気通信サービス	
LPP SA	260.78	317.67	2,794	89,024	石油・ガス・消耗燃料	
BANK ZACHODNI WBK SA	1.12	1.3	1,170	37,296	繊維・アパレル・贅沢品	
CD PROJEKT RED SA	25.93	38.88	1,448	46,154	銀行	
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	—	75.17	902	28,738	ソフトウェア	
CCC SA	711.2	997.25	4,155	132,395	銀行	
SYNTHOS SA	26.38	33.09	906	28,886	繊維・アパレル・贅沢品	
EUROCASH SA	465.08	—	—	—	化学	
GRUPA LOTOS SA	95	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	114.12	94.8	526	16,786	石油・ガス・消耗燃料	
CYFROWY POLSAT SA	1,691.28	1,671.92	1,023	32,599	石油・ガス・消耗燃料	
GRUPA AZOTY SA	167.4	228.1	583	18,575	メディア	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	38.53	38.53	217	6,935	化学	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	612.51	811	852	27,156	電力	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	1,260.18	893.18	223	7,114	電力	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	424.49	651.15	2,819	89,828	保険	
ALIOR BANK SA	44.03	61.7	540	17,224	金属・鉱業	
DINO POLSKA SA	74.34	94.05	679	21,634	銀行	
PLAY COMMUNICATIONS SA	—	60.68	570	18,172	食品・生活必需品小売り	
	—	152.28	493	15,719	無線通信サービス	
小計	株数 銘柄	金額 数<比率>	7,385.11 22銘柄	7,674.43 23銘柄	24,861 —	792,079 <1.2%>
(ハンガリー)						
RICHTER GEDEON NYRT	百株	百株	千ハンガリー・フォント	千円		
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	122.49	148.3	78,673	33,624	医薬品	
OTP BANK NYRT	35.01	337.62	100,880	43,116	石油・ガス・消耗燃料	
	200.37	255.55	286,216	122,328	銀行	
小計	株数 銘柄	金額 数<比率>	357.87 3銘柄	741.47 3銘柄	465,770 —	199,070 <0.3%>
(ユーロ…ギリシャ)						
PIRAEUS BANK S.A.	百株	百株	千ユーロ	千円		
ALPHA BANK A.E.	5,000	250	79	10,508	銀行	
NATIONAL BANK OF GREECE	1,000	1,540.71	315	41,840	銀行	
TITAN CEMENT CO. S.A.	39.98	6,600.69	202	26,870	銀行	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	35.18	52.17	113	15,115	建設資材	
FF GROUP	100.04	254.9	290	38,531	各種電気通信サービス	
EUROBANK ERGASIAS	31.3	31.3	52	6,947	専門小売り	
OPAP SA	16.3	1,941	184	24,450	銀行	
JUMBO SA	85.01	200	192	25,512	ホテル・レストラン・レジャー	
	56.23	104.2	157	20,891	専門小売り	
小計	株数 銘柄	金額 数<比率>	6,364.04 9銘柄	10,974.97 9銘柄	1,588 —	210,667 <0.3%>
合計	株数 銘柄	金額 数<比率>	1,786,086.36 822銘柄	2,382,094.46 837銘柄	— —	61,196,927 <92.1%>

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

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

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

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(トルコ) EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	千口 162,734	千口 231,071	千トルコ・リラ 559	千円 14,645	
小計	□銘柄数 162,734	□銘柄数 231,071	□銘柄 <0.0%>	□銘柄 <0.0%>	□ —
(メキシコ) FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D CEMEX SAB DE CV FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 157 1,149,111 188.8	千口 203.9 1,546,875 322.6	千メキシコ・ペソ 36,345 19,985 10,190	千円 216,253 118,914 60,636	
小計	□銘柄数 1,494,911	□銘柄数 2,073,375	□銘柄 <0.8%>	□銘柄 <0.6%>	□ —
(南アフリカ) HYPROP INVESTMENTS LTD RESILIENT REIT LTD	千口 20,095 20,512	千口 29,707 28.6	千南アフリカ・ランド 3,334 1,826	千円 29,839 16,343	
小計	□銘柄数 40,607	□銘柄数 58,307	□銘柄 <0.1%>	□銘柄 <0.1%>	□ —
合計	□銘柄数 1,698,252	□銘柄数 2,362,753	□銘柄 <0.9%>	□銘柄 <0.7%>	□ —
					456,632

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末		
	買建額	売建額	額
外国 MINI MSCI EMG MKT	百万円 4,747		百万円 —

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

■投資信託財産の構成

2018年4月18日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 61,196,927	% 92.1
投資信託受益証券、投資証券	456,632	0.7
コール・ローン等、その他	4,820,397	7.3
投資信託財産総額	66,473,957	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、66,356,793千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.20円、1香港・ドル=13.66円、1台湾・ドル=3.65円、1トルコ・リラ=26.19円、1メキシコ・ペソ=5.95円、1フィリピン・ペソ=2.06円、100チリ・ペソ=17.97円、100コロンビア・ペソ=3.93円、1カタール・リアル=29.50円、1インド・ルピー=1.64円、1パキスタン・ルピー=0.93円、100インドネシア・ルピア=0.78円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.23円、1ブラジル・レアル=31.45円、1チェコ・コルナ=5.25円、100韓国・ウォン=10.08円、1マレーシア・リンギット=27.56円、1南アフリカ・ランド=8.95円、1タイ・バーツ=3.43円、1ポーランド・ズロチ=31.86円、100ハンガリー・フォリント=42.74円、1ユーロ=132.60円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年4月18日)現在

項	目	当期末
(A) 資	産	66,535,297,684円
コ 一 ル . □ 一 ヌ 等		3,159,747,715
株 式(評価額)		61,196,927,280
投 資 信 託 受 益 証	券(評価額)	335,168,260
投 資 証	券(評価額)	121,464,424
未 収 入 金		66,134,990
未 収 配 当 金		92,333,926
差 入 委 託 証 抱 金		1,563,521,089
(B) 負 債		91,556,922
未 払 金		77,511,922
未 解 約 金		14,045,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)		66,443,740,762
元 本		54,278,179,845
次 期 繰 越 損 益 金		12,165,560,917
(D) 受 益 権 総 口 数		54,278,179,845口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)		12,241円

(注1) 期首元本額 40,377,016,196円
 追加設定元本額 34,751,524,923円
 一部解約元本額 20,850,361,274円

(注2) 期末における元本の内訳

D IAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>
 3,441,256,718円

D IAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)
 489,621,999円

MITO ラップ型ファンド (安定型) 5,858,861円

MITO ラップ型ファンド (中立型) 15,725,843円

MITO ラップ型ファンド (積極型) 18,210,990円

グローバル8資産ラップファンド (安定型) 32,046,647円

グローバル8資産ラップファンド (中立型) 33,302,831円

グローバル8資産ラップファンド (積極型) 18,874,652円

たわらノーロード 新興国株式 3,548,910,360円

たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け> 1,108,649,964円

たわらノーロード バランス (8資産均等型) 46,087,081円

たわらノーロード バランス (堅実型) 231,164円

たわらノーロード バランス (標準型) 825,703円

たわらノーロード バランス (積極型) 2,623,761円

たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) 22,478円

たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) 1,736,519円

たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) 2,911,111円

たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) 2,316,179円

たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) 4,884,872円

たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 20,920円

たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 96,850円

たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 130,676円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	499,825円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	429,132,057円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	43,983,763円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	150,861,940円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	334,818,063円
投資のソムリエ	6,969,149,974円
クルーズコントロール	1,270,017,724円
投資のソムリエ<DC年金>	497,851,493円
D IAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	177,667,170円
クルーズコントロール<DC年金>	493,741円
D IAMコア資産設計ファンド (堅実型)	15,100,712円
D IAMコア資産設計ファンド (積極型)	47,035,027円
投資のソムリエ<DC年金>/リスク抑制型	109,132,260円
ダイナミック・ナビゲーション	1,539,998円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,864,479,581円
ワールドアセットバランス (基本コース)	1,787,762,556円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	6,173,904,750円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	1,141,571円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	835,867円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	532,814円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	2,248,337円
エマージング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用)	4,783,607,576円
エマージング株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,636,951,676円
D IAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	10,995,106,377円
D IAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	7,209,978,814円
期末元本合計	54,278,179,845円

■損益の状況

当期 自2017年4月19日 至2018年4月18日

項	目	当期
(A) 配 受 受 そ 支	当等取利他利 取配利 益	1,110,706,152円 1,093,266,982 13,524,688 4,119,612 △205,130
(B) 有 価 売 売	價証券売買 買 買	益 益 損
(C) 先 物 取 取	物取引等取引 引 引	益 益 損
(D) そ の 他	費 用	△59,461,883
(E) 当 期	損 益 金(A + B + C + D)	9,263,951,397
(F) 前 期	繰 越 損 益 金	486,674,169
(G) 解 約 差	損 益 金	△4,666,749,726
(H) 追 加 信 託 差	損 益 金	7,081,685,077
(I) 合 次 期 繰 越 損 益 金(I)	計(E + F + G + H) 益 金	12,165,560,917 12,165,560,917

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

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(平成30年3月1日)

エマージング債券パッジブ・マザーファンド

運用報告書

第10期（決算日 2018年4月18日）
 (計算期間 2017年4月19日～2018年4月18日)

エマージング債券パッジブ・マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰落率	中騰落率			
6期(2014年4月18日)	円 14,588	% 0.3	ポイント 70,225.03	% 1.8	% 96.1	% 38,833 百万円
7期(2015年4月20日)	18,383	26.0	84,996.05	21.0	96.5	— 51,976
8期(2016年4月18日)	17,120	△6.9	81,716.02	△3.9	96.5	— 51,487
9期(2017年4月18日)	17,917	4.7	88,609.40	8.4	96.8	— 80,269
10期(2018年4月18日)	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4	— 111,615

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

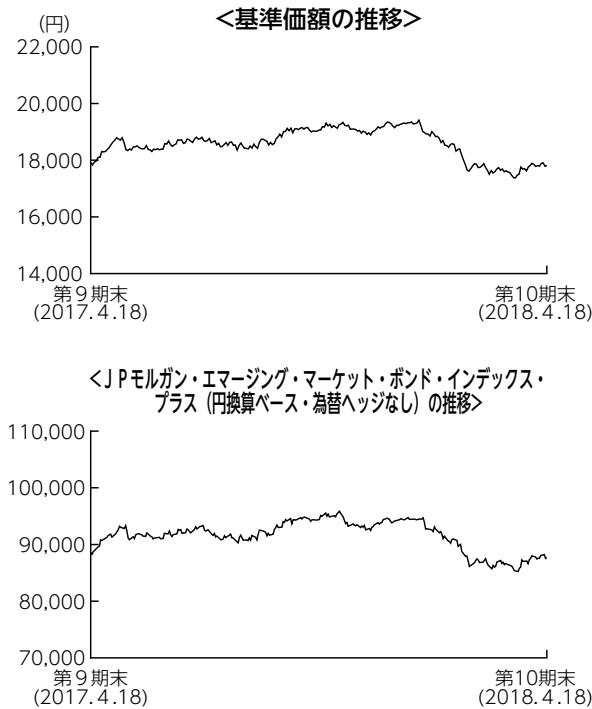
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017 年 4 月 18 日	円 17,917	% —	ポイント 88,609.40	% —	% 96.8
4 月 末	18,310	2.2	90,839.08	2.5	96.2
5 月 末	18,400	2.7	91,461.20	3.2	95.5
6 月 末	18,594	3.8	91,987.11	3.8	95.5
7 月 末	18,475	3.1	90,853.52	2.5	95.2
8 月 末	18,742	4.6	92,518.04	4.4	96.4
9 月 末	19,077	6.5	94,279.65	6.4	96.0
10 月 末	19,127	6.8	94,889.37	7.1	94.9
11 月 末	19,035	6.2	93,154.63	5.1	96.5
12 月 末	19,277	7.6	94,436.09	6.6	94.7
2018 年 1 月 末	18,458	3.0	90,231.09	1.8	96.3
2 月 末	17,878	△0.2	87,510.37	△1.2	109.2
3 月 末	17,687	△1.3	87,022.13	△1.8	96.6
(期 末) 2018 年 4 月 18 日	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、賃建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年4月19日から2018年4月18日まで）



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

基準価額の推移

当期末の基準価額は17,815円となり、前期末比で0.6%下落しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場での円高米ドル安が進行した結果、基準価額は下落しました。

投資環境

当期の新興国債券の利回りは上昇しました。

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

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

為替市場では、期初から2018年1月にかけては、北朝鮮情勢の緊迫化や米国の政治不透明感が円高要因となりましたが、2月以降は世界的な株式市場の下落や米中貿易戦争への懸念からリスク回避の円買いが進みました。

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○国別構成比

期首（前期末）

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

※1 ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.0%下落しました。当ファンドはベンチマークを0.5%上回りました。これは、運用の基本方針で規定された格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが理由です。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

期末

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



■1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	2円 (2) (0)	0.009% (0.009) (0.000)
合 計	2	0.009

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(18,582円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。また、その他費用（その他）には、余資運用に対してかかる費用を含みます。

■売買及び取引の状況（2017年4月19日から2018年4月18日まで）

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ 力	国 債 証 券	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
			734,858	405,245 (3,198)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等（2017年4月19日から2018年4月18日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うち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 949,163	千アメリカ・ドル 1,003,633	千円 107,589,494	% 96.4	% 26.7	% 72.6	% 18.1	% 5.7
合計	-	-	107,589,494	96.4	26.7	72.6	18.1	5.7

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

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

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	種類	利率	額面金額	当期		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	千円	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	6.0500	11,900	13,557	1,453,318	2040/01/11
BRAZIL 5.625 01/07/41	国債証券	5.6250	8,900	8,664	928,796	2041/01/07
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国債証券	4.6000	10,600	10,170	1,090,299	2046/01/23
BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	4.2500	16,100	16,063	1,722,036	2025/01/07
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	5,000	6,118	655,930	2026/01/29
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債証券	7.7500	5,900	8,012	858,977	2031/01/14
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	3,000	3,613	387,392	2044/01/22
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	国債証券	5.5500	11,400	12,560	1,346,524	2045/01/21
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	国債証券	4.6650	4,700	4,734	507,512	2024/01/17
TURKEY 11.875 01/15/30	国債証券	11.8750	5,100	7,557	810,129	2030/01/15
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	国債証券	6.3750	3,000	3,725	399,330	2032/01/15
COLOMBIA 6.125 01/18/41	国債証券	6.1250	10,000	11,525	1,235,480	2041/01/18
INDONESIA 5.25 01/17/42	国債証券	5.2500	6,900	7,314	784,082	2042/01/17
INDONESIA 6.75 01/15/44	国債証券	6.7500	7,700	9,773	1,047,673	2044/01/15
BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	5.0000	13,200	11,688	1,253,032	2045/01/27
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	国債証券	4.3500	7,000	6,498	696,641	2047/01/15
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	国債証券	4.0000	5,200	5,320	570,355	2021/01/15
TURKEY 6.0 01/14/41	国債証券	6.0000	11,700	10,852	1,163,420	2041/01/14
INDONESIA 5.125 01/15/45	国債証券	5.1250	6,800	7,082	759,204	2045/01/15
INDONESIA 5.25 01/08/47	国債証券	5.2500	4,200	4,455	477,583	2047/01/08
BRAZIL 8.25 01/20/34	国債証券	8.2500	6,000	7,563	810,817	2034/01/20
PANAMA 6.7 01/26/36	国債証券	6.7000	10,200	12,831	1,375,547	2036/01/26
BRAZIL 7.125 01/20/37	国債証券	7.1250	8,100	9,436	1,011,592	2037/01/20
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	6,300	8,577	919,489	2038/01/17
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国債証券	3.9500	6,200	6,114	655,448	2040/01/20
INDONESIA 5.95 01/08/46	国債証券	5.9500	4,000	4,651	498,591	2046/01/08
BRAZIL 4.875 01/22/21	国債証券	4.8750	11,000	11,456	1,228,136	2021/01/22
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	3.6000	9,200	9,085	973,912	2025/01/30
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	国債証券	5.0000	4,000	4,470	479,184	2037/01/13
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	10,200	10,310	1,105,249	2025/01/15
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	4,200	4,264	457,169	2027/01/08
ROMANIA 4.875 01/22/24	国債証券	4.8750	2,400	2,530	271,312	2024/01/22
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	5,400	5,588	599,065	2026/01/28
CROATIA 6.0 01/26/24	国債証券	6.0000	4,800	5,306	568,882	2024/01/26

銘柄	当期				末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千円		
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	国債証券	4.1250	10,000	10,157	1,088,884	2026/01/21
INDONESIA 5.875 01/15/24	国債証券	5.8750	8,800	9,695	1,039,318	2024/01/15
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	7,000	7,330	785,878	2026/01/08
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	国債証券	6.5000	2,800	2,974	318,889	2020/01/20
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国債証券	4.2000	5,000	5,211	558,624	2024/01/21
PANAMA 5.2 01/30/20	国債証券	5.2000	6,800	7,109	762,127	2020/01/30
HUNGARY 6.25 01/29/20	国債証券	6.2500	8,500	8,979	962,655	2020/01/29
BRAZIL 2.625 01/05/23	国債証券	2.6250	9,200	8,740	936,928	2023/01/05
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	国債証券	3.5000	6,200	6,289	674,277	2021/01/21
BRAZIL 8.75 02/04/25	国債証券	8.7500	3,000	3,791	406,438	2025/02/04
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国債証券	3.7000	5,000	4,729	506,980	2042/02/02
TURKEY 7.375 02/05/25	国債証券	7.3750	11,300	12,446	1,334,313	2025/02/05
TURKEY 6.625 02/17/45	国債証券	6.6250	10,700	10,490	1,124,535	2045/02/17
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国債証券	9.5000	6,600	9,887	1,059,971	2030/02/02
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国債証券	5.6250	10,200	11,204	1,201,143	2044/02/26
ROMANIA 6.75 02/07/22	国債証券	6.7500	8,300	9,220	988,461	2022/02/07
BRAZIL 5.625 02/21/47	国債証券	5.6250	11,400	10,981	1,177,168	2047/02/21
COLOMBIA 4.0 02/26/24	国債証券	4,0000	8,100	8,191	878,088	2024/02/26
HUNGARY 5.375 02/21/23	国債証券	5.3750	8,100	8,752	938,315	2023/02/21
PANAMA 3.875 03/17/28	国債証券	3.8750	6,200	6,215	666,301	2028/03/17
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	7.5000	15,263	17,110	1,834,216	2030/03/31
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	4.7500	16,000	15,648	1,677,465	2044/03/08
TURKEY 5.625 03/30/21	国債証券	5.6250	6,700	6,926	742,530	2021/03/30
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	国債証券	5.5000	3,800	4,294	460,386	2026/03/30
PERU 6.55 03/14/37	国債証券	6.5500	6,200	7,943	851,536	2037/03/14
HUNGARY 7.625 03/29/41	国債証券	7.6250	3,800	5,509	590,643	2041/03/29
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	国債証券	3.7000	7,400	7,025	753,100	2041/03/01
TURKEY 5.125 03/25/22	国債証券	5.1250	5,300	5,370	575,682	2022/03/25
TURKEY 5.75 03/22/24	国債証券	5.7500	9,300	9,500	1,018,444	2024/03/22
HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	5.3750	5,800	6,322	677,811	2024/03/25
PANAMA 3.75 03/16/25	国債証券	3.7500	6,000	6,030	646,416	2025/03/16
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	国債証券	3.6250	8,900	9,016	966,597	2022/03/15
HUNGARY 6.375 03/29/21	国債証券	6.3750	8,600	9,345	1,001,878	2021/03/29
CROATIA 6.375 03/24/21	国債証券	6.3750	4,500	4,862	521,257	2021/03/24
COLOMBIA 2.625 03/15/23	国債証券	2.6250	4,300	4,110	440,617	2023/03/15
TURKEY 3.25 03/23/23	国債証券	3.2500	5,100	4,712	505,180	2023/03/23
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	国債証券	5.5000	6,000	6,236	668,522	2020/03/09
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国債証券	4.1500	10,600	10,711	1,148,251	2027/03/28
TURKEY 6.0 03/25/27	国債証券	6,0000	10,400	10,426	1,117,711	2027/03/25
PANAMA 9.375 04/01/29	国債証券	9.3750	4,900	7,105	761,656	2029/04/01
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	5.6250	11,200	11,702	1,254,476	2042/04/04
TURKEY 4.25 04/14/26	国債証券	4.2500	6,000	5,435	582,719	2026/04/14
TURKEY 4.875 04/16/43	国債証券	4.8750	10,100	8,098	868,124	2043/04/16
INDONESIA 4.625 04/15/43	国債証券	4.6250	4,000	3,936	422,024	2043/04/15
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	国債証券	4.5000	9,000	9,108	976,474	2022/04/04
INDONESIA 3.75 04/25/22	国債証券	3.7500	9,000	9,043	969,488	2022/04/25
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	5,0000	15,200	15,530	1,664,896	2020/04/29
COLOMBIA 3.875 04/25/27	国債証券	3.8750	9,400	9,241	990,700	2027/04/25
CROATIA 5.5 04/04/23	国債証券	5.5000	5,800	6,231	668,012	2023/04/04
INDONESIA 3.375 04/15/23	国債証券	3.3750	4,500	4,416	473,427	2023/04/15
BRAZIL 6.0 04/07/26	国債証券	6,0000	8,200	9,007	965,625	2026/04/07
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	4,600	4,604	493,627	2026/04/14
COLOMBIA 8.125 05/21/24	国債証券	8.1250	4,300	5,278	565,851	2024/05/21
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	国債証券	5.8750	4,200	4,523	484,872	2022/05/30
TURKEY 6.75 05/30/40	国債証券	6.7500	6,700	6,784	727,253	2040/05/30
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	国債証券	6.8750	6,300	6,561	703,353	2019/05/27

銘柄	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	千円		
TURKEY 5.75 05/11/47	国債証券	5.7500	10,400	9,159	981,874	2047/05/11
PANAMA 4.5 05/15/47	国債証券	4.5000	5,000	5,054	541,837	2047/05/15
INDONESIA 4.875 05/05/21	国債証券	4.8750	9,700	10,130	1,085,988	2021/05/05
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	4.7500	11,800	11,877	1,273,232	2026/05/27
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	14,800	15,059	1,614,324	2045/06/15
TURKEY 7.0 06/05/20	国債証券	7.0000	8,700	9,195	985,753	2020/06/05
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	5.2500	24,800	23,839	2,555,593	2047/06/23
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	国債証券	8.3750	4,300	4,578	490,830	2019/06/17
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	国債証券	4.2500	8,800	8,475	908,616	2027/06/23
PERU 7.35 07/21/25	国債証券	7.3500	11,000	13,675	1,465,981	2025/07/21
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	国債証券	5.3750	3,200	3,073	329,445	2044/07/24
COLOMBIA 4.375 07/12/21	国債証券	4.3750	10,800	11,169	1,197,413	2021/07/12
CROATIA 6.625 07/14/20	国債証券	6.6250	5,800	6,234	668,336	2020/07/14
INDONESIA 3.85 07/18/27	国債証券	3.8500	4,000	3,915	419,765	2027/07/18
PERU 4.125 08/25/27	国債証券	4.1250	6,600	6,920	741,834	2027/08/25
ROMANIA 4.375 08/22/23	国債証券	4.3750	5,600	5,759	617,453	2023/08/22
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	6,200	6,627	710,500	2025/09/16
COLOMBIA 7.375 09/18/37	国債証券	7.3750	6,800	8,772	940,358	2037/09/18
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債証券	6.7500	6,000	7,399	793,194	2034/09/27
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	国債証券	5.8750	5,200	5,606	601,031	2043/09/16
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	国債証券	4.8750	10,200	10,504	1,126,122	2023/09/16
TURKEY 6.25 09/26/22	国債証券	6.2500	8,500	8,966	961,261	2022/09/26
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	9,200	9,485	1,016,813	2110/10/12
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	6,200	7,893	846,199	2034/10/23
BRAZIL 8.875 10/14/19	国債証券	8.8750	4,600	5,020	538,240	2019/10/14
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	6,200	5,828	624,808	2028/10/12
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	国債証券	5,0000	2,800	2,553	273,697	2046/10/12
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	4,0000	12,700	13,022	1,395,979	2023/10/02
TURKEY 4.875 10/09/26	国債証券	4.8750	10,600	9,930	1,064,561	2026/10/09
PERU 5.625 11/18/50	国債証券	5.6250	13,000	15,699	1,682,981	2050/11/18
TURKEY 7.5 11/07/19	国債証券	7.5000	8,400	8,877	951,627	2019/11/07
CROATIA 6.75 11/05/19	国債証券	6.7500	8,200	8,669	929,408	2019/11/05
HUNGARY 5.75 11/22/23	国債証券	5.7500	8,200	9,068	972,165	2023/11/22
合計	—	—	949,163	1,003,633	107,589,494	—

■投資信託財産の構成

2018年4月18日現在

項目	当期		末	
	評価額	比率	千円	%
公 社 債	107,589,494	96.4		
コール・ローン等、その他	4,040,840	3.6		
投 資 信 託 財 産 総 額	111,630,334	100.0		

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、111,339,008千円、99.7%です。

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年4月18日)現在

項目	当期末
(A) 資産 一ヶ月以内等 社債(評価額) 未収入金 未収利息 前払費用 (B) 負債 未払金 未払解約金 (C) 純資産総額(A-B) 元本 次期繰越損益金 (D) 受益権総口数 1万口当たり基準価額(C/D)	111,876,591,958円 2,857,407,644 107,589,494,462 246,537,000 936,081,610 247,071,242 261,518,320 246,257,320 15,261,000 111,615,073,638 62,651,486,172 48,963,587,466 62,651,486,172口 17,815円

(注 1) 期首元本額
追加設定元本額
一部解約元本額

(注 2) 期末における元本の内訳

D IAM新興国債券インディックファンド<為替ヘッジなし>	44,801,349,582円
追加設定元本額	44,252,595,865円
一部解約元本額	26,402,459,275円
(注 2) 期末における元本の内訳	
D IAM新興国債券インディックファンド<為替ヘッジなし>	265,352,419円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	31,696,669円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,276,054円
たわらノーロード バランス（標準型）	3,409,421円
たわらノーロード バランス（積極型）	2,706,951円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	74,492円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	114,911円
たわらノーロード 最適化バランス（成型型）	468,720円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	224,993円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	343,828円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	59,295,344円
D IAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	30,468,731円
D IAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	104,407,098円
D IAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	231,884,436円
投資のソムリエ	8,030,523,614円
クルーズコントロール	878,591,978円
投資のソムリエ<DC年金>	573,807,004円
D IAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	122,747,118円
クルーズコントロール<DC年金>	341,245円
D IAMコア資産設計ファンド（堅実型）	4,182,056円
D IAMコア資産設計ファンド（積極型）	13,011,019円
投資のソムリエ<DC年金>/リスク抑制型	376,827,557円
ダイナミック・ナビゲーション	177,753円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,413,104,090円
ワールドアセットバランス（基本コース）	859,189,179円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,176,151,984円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	1,313,456円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	959,305円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	1,837,939円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	2,591,303円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	16,514,072,473円
エマージング債券バッジファンドVA（適格機関投資家専用）	3,261,708,145円
D IAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	7,576,092,789円
D IAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	4,968,287,970円
D IAMプロパティ・リスクファスター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	2,951,435,236円
D IAMプロパティ・リスクファスター・パリティ戦略ファンドII（適格機関投資家専用）	2,324,514,542円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,868,294,350円
期末元本合計	62,651,486,172円

■損益の状況

当期 自2017年4月19日 至2018年4月18日

項目	当期
(A) 配当受取益	4,730,514,573円
支払利息	4,730,919,751
(B) 有価証券売買益	△405,178
売買益	△5,545,889,985
売買損	642,531,914
(C) その他費用	△6,188,421,899
(D) 当期損益金(A+B+C)	△824,647,111
(E) 前期繰越損益金	35,468,257,167
(F) 解約差損益金	△22,544,128,725
(G) 追加信託差損益金	36,864,106,135
(H) 合計(D+E+F+G)	48,963,587,466
次期繰越損益金(H)	48,963,587,466

(注 1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

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

(平成29年9月29日)

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

(平成30年3月1日)

J－REITインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2018年6月6日）
 (計算期間 2017年6月7日～2018年6月6日)

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	東証REIT指数		投資証券組入比率	不動産投信指數先物比率	純資産額
		期騰落率	中			
8期（2014年6月6日）	円 14,064	% 25.3	ポイント 2,619.15	% 25.7	% 99.0	% － 百万円 27,010
9期（2015年6月8日）	17,124	21.8	3,194.43	22.0	98.9	－ 29,321
10期（2016年6月6日）	18,293	6.8	3,414.59	6.9	99.1	－ 23,383
11期（2017年6月6日）	17,626	△3.6	3,285.51	△3.8	98.3	1.5 29,280
12期（2018年6月6日）	18,181	3.1	3,386.35	3.1	97.8	1.7 35,462

(注1) 不動産投信指數先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

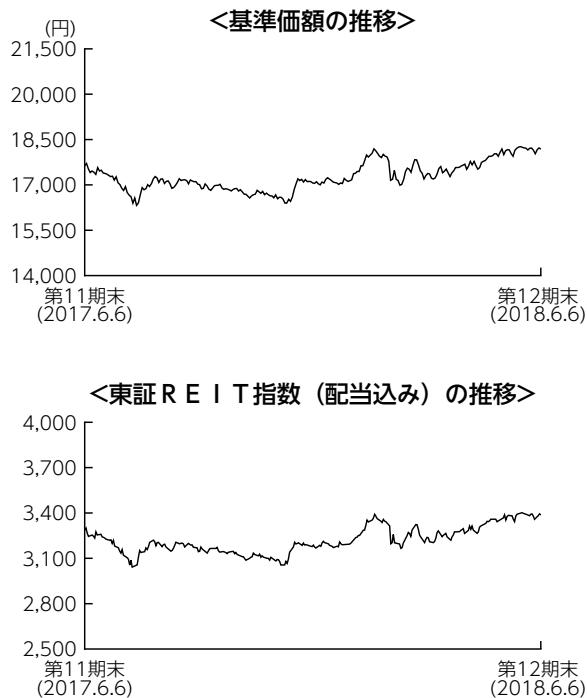
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、賃建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年6月7日から2018年6月6日まで）



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

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

■1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 (0)	0.002% (0.001)
(投 資 証 券)	(0)	(0.001)
合 計	0	0.002

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(17,285円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2017年6月7日から2018年6月6日まで)

(1) 投資証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
国内	千口	千円	千口	千円
日本アコモデーションファンド投資法人	1,099 (-)	507,245 (-)	0.903 (-)	417,945 (-)
MCUBS M i d C i t y 投資法人	2,372 (3,416)	284,558 (-)	1.783 (-)	207,783 (-)
森ヒルズリート投資法人	3,552 (-)	487,856 (-)	2.921 (-)	397,705 (-)
産業ファンド投資法人	2,309 (3,597)	476,522 (-)	1.961 (-)	356,851 (-)
アドバンス・レジデンス投資法人	3,064 (-)	844,583 (-)	2.52 (-)	684,463 (-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,005 (1,033)	232,549 (29,160)	0.706 (-)	188,392 (-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,545 (-)	731,632 (-)	1.205 (-)	564,556 (-)
G L P 投資法人	7,245 (-)	854,059 (-)	4.832 (-)	580,473 (-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,288 (-)	308,152 (-)	1.012 (-)	238,203 (-)
日本プロロジスリート投資法人	4,777 (-)	1,134,440 (-)	3.396 (-)	805,577 (-)
星野リゾート・リート投資法人	0.615 (-)	342,881 (-)	0.399 (-)	221,951 (-)
O n e リート投資法人	0.361 (-)	83,622 (-)	0.297 (-)	71,022 (-)
イオンリート投資法人	3,365 (-)	392,651 (-)	2.542 (-)	296,173 (-)
ヒューリックリート投資法人	2,361 (-)	390,349 (-)	1.823 (-)	301,974 (-)
日本リート投資法人	0.888 (-)	284,984 (-)	0.73 (-)	232,248 (-)
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	11.891 (14.21)	295,490 (-)	3.085 (-)	175,490 (-)
日本ヘルスケア投資法人	0.16 (-)	26,850 (-)	0.132 (-)	22,034 (-)
積水ハウス・リート投資法人	3,109 (7,37505)	331,913 (352,965)	2.125 (-)	255,150 (-)
トーセイ・リート投資法人	0.634 (-)	68,857 (-)	0.411 (-)	44,313 (-)
ケネディクス商業リート投資法人	1.202 (-)	284,595 (-)	0.988 (-)	232,231 (-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
	千口	千円	千口	千円	千口	千円	千円	千円
ヘルスケア&メディカル投資法人		0.407	41,562		0.335	34,618		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
サムティ・レジデンシャル投資法人		0.576	51,689		0.474	42,482		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
ジャパン・シニアリビング投資法人		0.131	19,154		0.131	19,960		
		(△0.202)	(△29,160)		(-)	(-)		
野村不動産マスターファンド投資法人		9.858	1,453,636		7.787	1,132,882		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
いちごホテルリート投資法人		0.522	61,827		0.436	51,718		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
ラサールロジポート投資法人		2.495	278,378		2.052	230,794		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
スター・アジア不動産投資法人		0.842	89,384		0.605	63,527		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
マリモ地方創生リート投資法人		0.324	35,679		0.188	20,044		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.694	240,612		0.482	165,136		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
大江戸温泉リート投資法人		0.652	57,596		0.404	34,944		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
さくら総合リート投資法人		0.796	72,751		0.654	60,919		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
投資法人みらい		0.504	89,779		0.35	62,400		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
森トラスト・ホテルリート投資法人		0.717	104,213		0.59	85,798		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
三菱地所物流リート投資法人		0.586	159,885		0.192	52,298		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
C R E ロジスティクスファンド投資法人		0.448	50,790		0.022	2,527		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
ザイマックス・リート投資法人		0.412	46,714		0.02	2,289		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
日本ビルファンド投資法人		3.203	1,846,803		2.634	1,503,968		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
ジャパンリアルエステイト投資法人		3.347	1,851,404		2.58	1,415,315		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
日本リテールファンド投資法人		6.34	1,299,317		5.36	1,096,646		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
オリックス不動産投資法人		6.63	1,079,664		5.263	853,937		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
日本プライムリアルティ投資法人		2.088	799,298		1.717	646,784		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
プレミア投資法人		2.988	324,484		2.457	267,667		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
東急リアル・エステート投資法人		2.216	308,452		1.822	249,502		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
グローバル・ワン不動産投資法人		0.824	210,223		0.571	175,875		
		(1.86)	(-)		(-)	(-)		
ユナイテッド・アーバン投資法人		7.296	1,211,715		6	985,649		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
森トラスト総合リート投資法人		2.365	395,608		1.944	318,264		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
インヴィンシブル投資法人		10.55	501,052		7.057	340,529		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
フロンティア不動産投資法人		1.124	510,404		0.924	414,679		
		(-)	(-)		(-)	(-)		
平和不動産リート投資法人		2.062	196,820		1.696	162,226		
		(-)	(-)		(-)	(-)		

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
	千円	千円	千円	千円
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,298	494,685	1,793	377,688
	(-)	(-)	(-)	(-)
福岡リート投資法人	1,742	293,283	1,322	225,475
	(-)	(-)	(-)	(-)
ケネディクス・オフィス投資法人	1,036	667,103	0,795	513,897
	(-)	(-)	(-)	(-)
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	2,088	240,775	1,891	217,999
	(△2,977)	(△352,965)	(-)	(-)
いちごオフィスリート投資法人	2,562	197,977	2,107	162,751
	(-)	(-)	(-)	(-)
大和証券オフィス投資法人	0.71	416,779	0,584	345,528
	(-)	(-)	(-)	(-)
阪急リート投資法人	1,481	199,437	1,126	149,204
	(-)	(-)	(-)	(-)
スタートプロシード投資法人	0.523	82,758	0,431	68,821
	(-)	(-)	(-)	(-)
大和ハウスリート投資法人	4,002	1,053,370	2,823	737,622
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,175	785,743	7,853	613,064
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本賃貸住宅投資法人	3.72	307,148	3,059	251,869
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパンエクセレント投資法人	2,963	401,019	2,436	327,306
	(-)	(-)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 2,182	百万円 2,040	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等 (2017年6月7日から2018年6月6日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期					
区分	分	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
		百万円 311	百万円 311	% 100.0	百万円 -	百万円 -	% -
金銭信託							

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	付	当期	
		買	額
投資証券		百万円 1,266	

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

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

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

銘柄	期首(前期末) □ 数	当期			末比 率
		□ 数	評価額		
不動産ファンド	千口	千口	千円		%
ザイマックス・リート投資法人	—	0.392	44,570		0.1
日本ビルファンド投資法人	3.551	4.12	2,554,400		7.2
ジャパンリアルエステイト投資法人	3.466	4.233	2,400,111		6.8
日本リテールファンド投資法人	7.053	8.033	1,596,960		4.5
オリックス不動産投資法人	7.074	8.441	1,455,228		4.1
日本プライムリアルティ投資法人	2.315	2.686	1,074,400		3.0
プレミア投資法人	3.312	3.843	404,667		1.1
東急リアル・エステート投資法人	2.458	2.852	424,377		1.2
グローバル・ワン不動産投資法人	0.589	2.702	297,220		0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	8.087	9.383	1,596,986		4.5
森トラスト総合リート投資法人	2.62	3.041	487,168		1.4
インヴィンシブル投資法人	8.175	11.668	586,900		1.7
フロンティア不動産投資法人	1.247	1.447	654,044		1.8
平和不動産リート投資法人	2.283	2.649	276,025		0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	2.329	2.834	635,099		1.8
福岡リート投資法人	1.78	2.2	379,500		1.1
ケネディクス・オフィス投資法人	1.072	1.313	879,710		2.5
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	2.78	—	—		—
いちごオフィスリート投資法人	2.839	3.294	277,684		0.8
大和証券オフィス投資法人	0.791	0.917	583,212		1.6
阪急リート投資法人	1.502	1.857	255,708		0.7
スターツプロシード投資法人	0.578	0.67	109,277		0.3
大和ハウスクリート投資法人	3.771	4.95	1,284,030		3.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9.957	12.279	1,008,105		2.8
日本賃貸住宅投資法人	4.124	4.785	414,859		1.2
ジャパンエクセント投資法人	3.283	3.81	547,497		1.5
合計	□ 数・金額 銘柄数<比率>	144,844 58銘柄<98.3%>	215,55705 59銘柄<97.8%>	34,681,169 —	— 97.8

(注1) <>内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄	別	当 期 末			
		買 建 額		売 建 額	
国内 東 証 R E I T			百万円 602		百万円 -

■投資信託財産の構成

2018年6月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 34,681,169	% 96.4
コール・ローン等、その他	1,290,170	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	35,971,340	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年6月6日)現在

項	目	当期末
(A) 資	産	35,971,340,086円
コ 一 ル . 口 一 ヌ 等		1,050,557,425
投 資 証 券(評価額)		34,681,169,205
未 収 入 金		1,576,692
未 収 配 当 金		230,700,864
差 入 委 託 証 拠 金		7,335,900
(B) 負 債		508,660,237
未 払 金		191,407,137
未 払 解 約 金		317,253,100
(C) 純 資 産 総 額(A-B)		35,462,679,849
元 本		19,505,563,952
次 期 繰 越 損 益 金		15,957,115,897
(D) 受 益 権 総 口 数		19,505,563,952口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)		18,181円

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期　自2017年6月7日 至2018年6月6日

項	目	当期
(A) 配 受 取 受 取 そ の 他 支 払	当 等 配 利 収 益 金 息 金 利 息	1,264,127,194円 1,263,967,545 212 679,889 △520,452
(B) 有 価 証 券 売 買 売 買 買 賣	債 券 利 益 金 益 損 益 益 損 損	△207,450,418 1,002,666,019 △1,210,116,437
(C) 先 物 取 引 取 取	物 引 引 取 引 等 取 引 損 益 益 損	16,919,674 41,782,480 △24,862,806
(D) 当 期 損 益	益 金(A + B + C)	1,073,596,450
(E) 前 期 繰 越	損 益 金	12,668,365,265
(F) 解 約 差 損	損 益 金	△10,343,772,310
(G) 追 加 信 託 差 損	損 益 金	12,558,926,492
(H) 合 次 期 繰 越 損 益	計(D + E + F + G) 金(H)	15,957,115,897 15,957,115,897

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

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(平成30年3月1日)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第11期（決算日 2018年6月22日）
 (対象期間 2017年6月23日～2018年6月22日)

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

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

(注2) S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックス L L C またはその関連会社（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード＆プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ L L C（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズ L L C（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、S P D J I、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I T インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

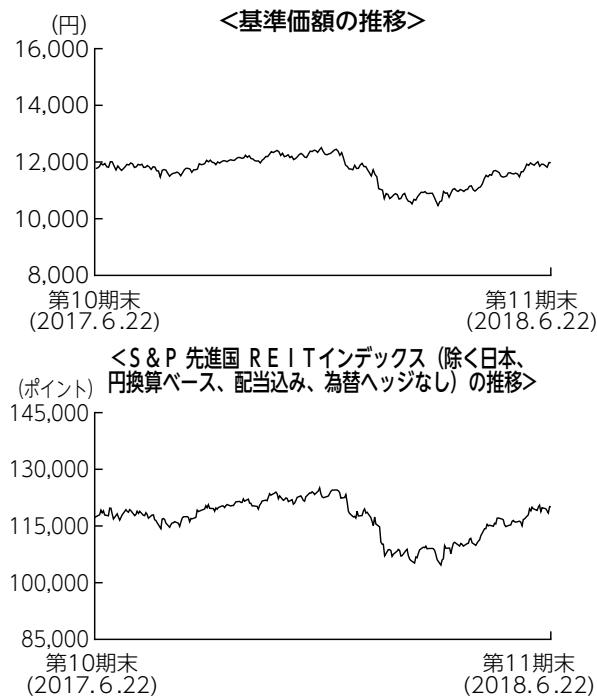
(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注) 謙落率は期首比です。

■当期の運用経過（2017年6月23日から2018年6月22日まで）



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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

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

基準価額の推移

当期末の基準価額は11,979円となり、前期末に比べ1.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

■1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券)	3円 (1) (2)	0.024% (0.005) (0.019)
(b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券)	5 (0) (5)	0.044 (0.002) (0.042)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	8 (6) (3)	0.071 (0.047) (0.024)
合計	16	0.139

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(11,685円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況(2017年6月23日から2018年6月22日まで)

投資信託受益証券、投資証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	35,568 (-)	4,390 (-)	23,082 (-)	2,829 (-)
ALEXANDER'S INC.	1,315 (-)	520 (-)	0,929 (-)	342 (-)
BOSTON PROPERTIES INC	48,246 (-)	5,900 (-)	35,714 (-)	4,275 (-)
CEDAR REALTY TRUST INC	14,876 (-)	71 (-)	6,755 (-)	31 (-)
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2.1 (-)	23 (-)	21.54 (-)	240 (-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	60,744 (-)	1,757 (-)	43,308 (-)	1,185 (-)
APARTMENT INV & MGMT CO-A	48,621 (-)	2,038 (-)	35,197 (-)	1,452 (-)
AGREE REALTY CORP	9.73 (-)	474 (-)	5,673 (-)	268 (-)
SL GREEN	31,168 (-)	3,094 (-)	28.52 (-)	2,763 (-)
EPR PROPERTIES	20,013 (-)	1,258 (-)	14,423 (-)	866 (-)
PROLOGIS INC	165,308 (-)	10,354 (-)	121.41 (-)	7,613 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	43,627 (-)	7,526 (-)	32,387 (-)	5,447 (-)
LEXINGTON REALTY TRUST	63,299 (-)	573 (-)	46,286 (-)	408 (-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	31,241 (-)	2,715 (-)	21,935 (-)	1,866 (-)
CBL & ASSOCIATES	40,727 (-)	254 (-)	28,048 (-)	156 (-)
MACK CALI	27,595 (-)	575 (-)	19,639 (-)	393 (-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	47,065 (-)	1,885 (-)	32,786 (-)	1,283 (-)
COUSINS PROPERTIES INC	132,374 (-)	1,186 (-)	97,362 (-)	857 (-)

	貢 付		元 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
アメリカ				
LASALLE HOTEL PROPERTIES	35,456	1,032	27,718	817
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	6,189	120	4,067	75
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DDR CORP	83,402	738	62,964	504
(△61,545)	(-)	(-)	(-)	(-)
ISTAR INC	17,531	194	12,866	134
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	116,046	3,157	86,42	2,311
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	23,641	150	9,894	60
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,011	5,090	15,576	3,655
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	116,119	7,296	86,195	5,303
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,222	2,952	17,899	2,116
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	38,704	1,173	26,083	782
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GGP INC	215,503	4,672	147,743	3,181
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FELCOR LODGING TR INC	4.23	31	—	—
(△47.1)	(-)	(-)	(-)	(-)
HCP INC	150,101	3,837	112,127	2,746
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	38,809	1,179	30,137	901
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	41,956	1,266	28,694	837
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,438	1,510	22,265	1,038
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	50,068	1,389	36,338	996
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	116,976	7,288	85,049	5,055
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	11,267	972	8,006	681
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	136.14	2,303	100,97	1,610
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	30,471	2,182	22,236	1,549
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	12,384	535	8,839	361
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	71,223	1,269	51,351	871
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	21,192	328	12,67	199
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
LIBERTY PROPERTY TRUST	45,476	1,885	32,979	1,352
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	51,818	872	37,507	629
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	100,888	3,593	65,736	2,267
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	35,031	2,044	29,753	1,738
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,798	2,597	20,166	1,730
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	23,844	627	18,904	472
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	貢 付		元 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
アメリカ				
HOST HOTELS & RESORTS INC	236.436	4,576	176.532	3,472
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	36.516	3,533	27.405	2,569
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10.002	182	8.814	159
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	12.461	908	8.846	618
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	24.056	136	16.165	86
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.413	56	1.54	34
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	16.168	174	9.952	101
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	9.201	239	4.925	124
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	5.75	706	4.064	483
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	20.975	267	13.732	170
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	91.773	4,934	65.189	3,398
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	48.632	2,990	36.227	2,178
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	86.682	3,190	64.418	2,321
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	31.819	924	22.611	624
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CORECIVIC INC	34.891	808	24.997	549
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	2.873	157	1.901	97
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	97.015	15,456	72.899	11,528
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	13.899	1,148	10.076	823
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	46.827	9,543	34.659	6,812
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	28.022	2,520	18.37	1,631
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
TAUBMAN CENTERS INC	18.58	1,069	13.445	756
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER FACTORY OUTLET	28.446	676	21.603	512
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	8.919	128	3.367	42
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.313	125	2.312	41
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.773	182	1.834	111
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	112.512	6,524	83.438	4,630
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	55.048	4,063	40.774	2,874
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON REIT	23.747	702	16.294	465
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GEO GROUP INC	37.161	910	27.563	626
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
WEINGARTEN REALTY INVST	37.299	1,117	26.943	780
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	貢 付		元 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
アメリカ				
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	42.94	1,772	30.887	1,199
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	23.768	413	17.226	281
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	40.361	3,405	29.938	2,496
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	24.965	239	17.549	164
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	66.983	1,070	46.71	754
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	55.111	1,496	39.235	1,059
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	61.867	6,763	45.653	4,943
(16.082)	(-)	(-)	(-)	(-)
EDUCATION REALTY TRUST INC	22.596	789	15.525	513
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	57.89	646	40.329	456
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	108.235	1,411	77.981	998
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	50.774	1,940	33.384	1,248
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	28.505	1,647	20.08	1,151
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	4.648	287	1.57	99
(△29.51)	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	33.479	618	23.601	424
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	37.258	720	32.643	610
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	31.202	475	22.551	340
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	17.497	618	11.145	390
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12.214	446	8.665	302
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	50.154	1,067	36.019	776
(17.05)	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	22.282	423	2.292	48
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	10.136	1,068	7.217	757
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	309.897	2,335	233.005	1,685
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CHESAPEAKE LODGING TRUST	19.176	526	14.536	394
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19.567	702	14.083	513
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	39.855	671	22.283	361
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	9.6	163	3.676	54
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	12.884	268	6.647	135
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	54.269	1,065	34.909	637
(33.6)	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	6.771	85	2.849	34
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	44.323	1,468	31.803	1,003
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	貢 付		元 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ				
STAG INDUSTRIAL INC	30,512	793	19,604	489
	(-)	(-)	(-)	(-)
SELECT INCOME REIT	17,116	369	11,794	249
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	62.86	786	51,797	628
	(-)	(-)	(-)	(-)
CYRUSONE INC	34,229	1,929	19,132	1,076
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	33,193	2,172	24,015	1,540
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	39,987	1,381	18,939	497
	(7,694)	(213)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	6,522	85	0.996	11
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	66,838	1,882	45,082	1,219
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,074	1,131	11,828	849
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHEELER REIT INC	-	-	0.529	2
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	9.738	135	5,811	77
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	50,351	1,347	34,113	862
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	137,042	1,100	122,264	993
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	59.94	1,023	35,753	577
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	26,252	768	14,554	420
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	85,043	1,781	55,045	1,121
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	28,487	280	11.76	107
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	28,557	966	20,845	695
	(31.91)	(-)	(-)	(-)
MANULIFE US REAL ESTATE-RTS	-	-	108.24	22
	(108.24)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	69,605	1,557	57,488	1,262
	(82,512)	(-)	(-)	(-)
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	8.96	101	3,207	34
	(-)	(-)	(-)	(-)
FOREST CITY REALTY TRUST INC	97,419	2,269	59,084	1,326
	(-)	(-)	(-)	(-)
PARKWAY INC	1.4	31	16.17	308
	(-)	(-)	(-)	(-)
QTS REALTY TRUST INC	14,765	680	9,839	460
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT MTA REIT	-	-	-	-
	(17,097)	(-)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	40,914	768	27,422	508
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	8,484	176	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	33,568	726	26,038	556
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	65,197	2,321	46,922	1,666
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	104,435	1,814	66,086	1,059
	(-)	(-)	(-)	(-)

	貢 付		元 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
アメリカ				
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5.448	52	2.446	21
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
STARWOOD WAYPOINT HOMES	23	815	5.107	182
(△51.123)	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	4.918	51	3.502	29
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	8.304	72	3.831	28
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CITY OFFICE REIT INC	10.099	123	3.736	40
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON PRIME GROUP INC	44.785	330	30.203	205
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	16.96	283	8.924	137
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	7.684	84	65.13	778
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	15.187	130	9.009	66
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
STORE CAPITAL CORP	50.443	1,251	36.114	871
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PARAMOUNT GROUP INC	125.554	1,959	38.957	572
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8.725	80	0.447	3
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	32.789	760	22.073	491
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
INFRAREIT INC	20.285	446	4.153	78
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	14.977	303	4.283	84
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	31	651	21.602	458
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3.289	79	1.427	34
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	12.181	310	5.942	143
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	4.283	107	1.679	42
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	79.852	1,482	42.304	784
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL NET LEASE INC	18.304	365	9.533	175
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
TIER REIT INC	11.234	220	7.446	141
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	3.36	88	1.78	44
(△29.92)	(-)	(-)	(-)	(-)
QUALITY CARE PROPERTIES INC	25.2	409	17.593	272
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CLIPPER REALTY INC	5.515	61	0.346	2
(-)	(-)	(△0.24553)	(-)	(-)
MANULIFE US REIT	496.4	454	190.9	176
(-)	(-)	(△8)	(-)	(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	70.737	1,957	34.638	982
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	10.586	130	7.773	92
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	6.495	266	3.721	146
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	16.007	379	10.781	247
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ COLONY NORTHSTAR INC	千口 171.797 (-)	千アメリカ・ドル 1,687 (-)	千口 150.141 (-)	千アメリカ・ドル 1,314 (-)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	21.793 (-)	653 (-)	15.449 (-)	454 (-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	24.262 (-)	877 (-)	17.065 (-)	612 (-)
MORGARD REAL ESTATE INV TR	8.498 (-)	117 (-)	7.302 (-)	99 (-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	46.171 (-)	967 (-)	33.815 (-)	698 (-)
CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	10.604 (△13.699)	492 (△642)	8.995 (-)	406 (-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	50.951 (-)	1,220 (-)	39.609 (-)	943 (-)
ALLIED PROPERTIES REIT	17.319 (-)	706 (-)	11.791 (-)	476 (-)
COMINAR REAL ESTATE INV TR	29.698 (-)	395 (-)	21.082 (-)	286 (-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	14.289 (-)	306 (-)	18.536 (-)	405 (-)
NORTHVIEW APARTMENT REIT	5.882 (-)	138 (-)	3.836 (-)	90 (-)
ONEREIT	7.232 (-)	26 (-)	17.06 (-)	71 (-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.884 (-)	342 (-)	6.02 (-)	260 (-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.993 (-)	244 (-)	13.972 (-)	190 (-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	10.548 (-)	142 (-)	6.579 (-)	86 (-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13 (-)	124 (-)	6.586 (-)	65 (-)
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	35.323 (-)	247 (-)	80.153 (-)	641 (-)
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	- (-)	- (-)	4.63 (-)	150 (-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14.546 (-)	161 (-)	8.249 (-)	91 (-)
MORGARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	4.016 (-)	57 (-)	2.69 (-)	37 (-)
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28.834 (-)	357 (-)	15.739 (-)	203 (-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	12.677 (-)	120 (-)	7.559 (-)	75 (-)
AGELLAN COMMERCIAL REIT	2.13 (-)	25 (-)	- (-)	- (-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	17.406 (-)	134 (-)	- (-)	- (-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.45 (-)	377 (-)	5.313 (-)	265 (-)
CHOICE PROPERTIES REIT	50.105 (28.72)	602 (266)	36.799 (-)	433 (-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.046 (-)	97 (-)	5.599 (-)	75 (-)
PLAZA RETAIL REIT	- (-)	- (-)	19.36 (-)	82 (-)
SLATE RETAIL REIT	4.87 (-)	60 (-)	5.021 (-)	61 (-)

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SLATE OFFICE REIT	5,277 (-)	40 (-)	4.22 (-)	31 (-)
KILLAM APARTMENT REIT	9,773 (-)	134 (-)	7,686 (-)	105 (-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	149,024 (-)	452 (-)	106,871 (-)	320 (-)
MIRVAC GROUP	1,127,404 (-)	2,514 (-)	821,762 (-)	1,772 (-)
INVESTA OFFICE FUND	157,303 (-)	714 (-)	158,635 (-)	709 (-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	469,495 (-)	484 (-)	229,645 (-)	229 (-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	94,772 (-)	383 (-)	65,971 (-)	257 (-)
ASPEN GROUP	- (-)	- (-)	31,613 (-)	32 (-)
GPT GROUP	567,751 (-)	2,815 (-)	421,279 (-)	2,070 (-)
ABACUS PROPERTY GROUP	104,214 (-)	384 (-)	64,474 (-)	233 (-)
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	41,666 (-)	116 (-)	22,721 (-)	60 (-)
ALE PROPERTY GROUP	6.83 (-)	31 (-)	67.33 (-)	307 (-)
STOCKLAND	784,313 (-)	3,342 (-)	569,694 (-)	2,365 (-)
WESTFIELD CORP	522,039 (-)	4,388 (-)	1,173,799 (-)	10,266 (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	34.6 (-)	93 (-)	22,733 (-)	60 (-)
DEXUS	335,477 (-)	3,238 (-)	235,182 (-)	2,225 (-)
GOODMAN GROUP	496,993 (-)	4,196 (-)	361,583 (-)	2,960 (-)
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	4.76 (-)	30 (\triangle 7)	22.26 (-)	152 (-)
360 CAPITAL GROUP LTD	- (-)	- (-)	62,283 (-)	59 (-)
VICINITY CENTRES	1,004,506 (-)	2,625 (-)	750,089 (-)	1,967 (-)
CHARTER HALL GROUP	131.84 (-)	766 (-)	91,573 (-)	522 (-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	45.893 (-)	146 (-)	25,998 (-)	81 (-)
GENERATION HEALTHCARE REIT	- (-)	- (-)	49.49 (-)	113 (-)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	219,066 (-)	502 (-)	156,174 (-)	353 (-)
ARENA REIT	57,515 (-)	128 (-)	28,969 (-)	65 (-)
PROPERTYLINK GROUP	110.27 (-)	108 (-)	168,228 (-)	161 (-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	31,088 (-)	130 (-)	18,627 (-)	71 (-)
INDUSTRIA REIT	26,972 (-)	66 (-)	28,223 (-)	66 (-)
NATIONAL STORAGE REIT	116,261 (-)	176 (-)	64.51 (-)	94 (-)

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
オーストラリア				
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	37,167 (-)	千オーストラリア・ドル 116 (-)	21,077 (-)	千オーストラリア・ドル 64 (-)
GDI PROPERTY GROUP	101,652 (-)	123 (-)	66,156 (-)	79 (-)
RURAL FUNDS GROUP	123.27 (-)	271 (-)	18,376 (-)	37 (-)
SCENTRE GROUP	1,641,206 (-)	6,596 (-)	1,192,262 (-)	4,805 (-)
VIVA ENERGY REIT	129,189 (-)	274 (-)	86,022 (-)	175 (-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	674 (-)	45,145 (-)	516 (-)	34,528 (-)
PROSPERITY REIT	321 (-)	1,065 (-)	217 (-)	714 (-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	326 (-)	1,682 (-)	196 (-)	1,007 (-)
CHAMPION REIT	545 (-)	3,001 (-)	397 (-)	2,221 (-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	289 (-)	1,534 (-)	228 (-)	1,219 (-)
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	70 (-)	165 (-)	331 (-)	770 (-)
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	435 (-)	4,118 (-)	323 (-)	3,040 (-)
SPRING REIT	96 (-)	332 (-)	51 (-)	172 (-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND MALL TRUST	826.7 (-)	1,695 (-)	608.9 (-)	1,237 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INV'T	784 (-)	2,091 (\triangle 9)	591.7 (-)	1,576 (-)
CACHE LOGISTICS TRUST NEW	37 (-)	30 (-)	— (-)	— (-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST NEW	84.3 (\triangle 84.3)	139 (-)	— (-)	— (-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,003,969 (\triangle 84.3)	1,759 (-)	688.6 (-)	1,205 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	705.5 (-)	1,356 (\triangle 11)	622.3 (-)	1,190 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	804.5 (-)	1,000 (\triangle 5)	443.3 (-)	559 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	317.6 (-)	240 (\triangle 1)	242.6 (-)	182 (-)
ASCOTT RESIDENCE TRUST	511.2 (-)	601 (\triangle 12)	369.2 (-)	434 (-)
FRASERS COMMERCIAL TRUST	163.1 (-)	232 (\triangle 4)	97.7 (-)	139 (-)
KEPPEL REIT	552.5 (-)	660 (\triangle 1)	406.8 (-)	486 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	225.7 (-)	495 (-)	171.1 (-)	377 (-)
ESR REIT	300.63 (-)	172 (-)	117.2 (-)	66 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	254.9 (-)	421 (\triangle 1)	167.6 (-)	282 (-)
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	129.9 (-)	211 (\triangle 15)	134.4 (-)	215 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	132.4 (-)	179 (\triangle 8)	82.8 (-)	113 (-)

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

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
DERWENT LONDON PLC	34.42	1,000	25.713	738
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	43.129	361	31.544	262
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSOM PLC	247.617	1,297	184.754	938
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	243.79	2,355	177.686	1,702
	(△19.106)	(△183)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	33.075	324	22.574	222
	(-)	(-)	(-)	(-)
MCKAY SECURITIES PLC	8.22	18	37.28	76
	(-)	(-)	(-)	(-)
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	2.657	13	23.12	110
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTU PROPERTIES PLC	283.823	640	220.269	476
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	85.375	644	50.555	385
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	236.878	274	122.778	138
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	85.904	851	78.012	757
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	327.879	1,882	240.125	1,374
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	95.455	612	68.182	432
	(△17.674)	(△124)	(-)	(-)
ASSURA PLC	836.837	516	383.531	224
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	107.887	68	57.613	35
	(-)	(-)	(-)	(-)
HANSTEEN HOLDINGS PLC	164.542	214	248.879	340
	(-)	(△57)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	62.206	296	42.918	202
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	186.525	332	132.499	231
	(-)	(-)	(-)	(-)
RDI REIT PLC	319.207	117	238.186	85
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEWRIVER REIT PLC	123.322	398	73.415	218
	(-)	(-)	(-)	(-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	34.053	37	25.381	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37.06	37	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	457.502	671	297.438	432
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	144.289	143	84.219	76
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXI REIT PLC	64.029	66	35.069	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGIONAL REIT LTD	80.788	83	43.457	43
	(-)	(-)	(-)	(-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	9.53	10	58.01	57
	(-)	(-)	(-)	(-)
イスラエル	千口	千イスラエル・シュケル	千口	千イスラエル・シュケル
REIT 1 LTD	42.547	618	28.26	411
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ（アイルランド）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
GREEN REIT PLC	225.198	345	164.209	249
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
ユーロ(アイルランド)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
HIBERNIA REIT PLC	215.595 (-)	319 (-)	146.345 (-)	218 (-)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	73.969 (-)	106 (-)	58.083 (-)	82 (-)
ユーロ(オランダ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14.709 (-)	518 (-)	10.348 (-)	365 (-)
VASTNED RETAIL	6.201 (-)	242 (-)	5.667 (-)	222 (-)
WERELDHAVE NV	12.278 (-)	440 (-)	9.382 (-)	326 (-)
NSI NV	4.101 (-)	138 (-)	2.583 (-)	86 (-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	— (57.184)	— (-)	— (-)	— (-)
ユーロ(ベルギー)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
BEFIMMO	7.34 (-)	389 (-)	5.25 (-)	278 (-)
COFINIMMO SA	6.576 (-)	702 (-)	5.371 (-)	568 (-)
RETAIL ESTATES	2.398 (-)	175 (-)	1.246 (-)	89 (-)
WERELDHAVE BELGIUM	— (-)	— (-)	0.78 (-)	72 (-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	5.027 (-)	113 (-)	2.644 (-)	59 (-)
WAREHOUSES DE PAUW	5.023 (-)	494 (-)	3.546 (-)	347 (-)
MONTEA SCA	— (-)	— (-)	2.231 (-)	98 (-)
AEDIFICA	5.485 (-)	426 (-)	3.848 (-)	292 (-)
COFINIMMO SA-RTS	(8.342)	— (-)	— (-)	— (-)
MONTEA SCA-RTS	(2.231)	— (-)	2.231 (-)	1 (-)
RETAIL ESTATES NV-RTS	(2.623)	— (-)	2.623 (-)	2 (-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	— (-)	— (-)	2.014 (-)	78 (-)
ユーロ(フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
GECINA SA	17.827 (-)	2,533 (-)	11.246 (-)	1,637 (-)
ICADE	13.263 (-)	1,041 (-)	9.788 (-)	782 (-)
ALTAREA	1.265 (-)	256 △(14)	0.649 (-)	130 (-)
KLEPIERRE	66.513 (-)	2,277 (-)	49.646 (-)	1,688 (-)
COVIVIO	15.504 (-)	1,359 (-)	10.931 (-)	950 (-)
MERCIALYS	14.557 (-)	249 (-)	11.07 (-)	189 (-)
UNIBAIL-RODAMCO SE	46.03 (△57.184)	9,123 (-)	22.756 (-)	4,523 (-)
GECINA SA-RTS	— (15.11)	— (-)	15.11 (-)	39 (-)
ユーロ(ドイツ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	18.169 (-)	169 (-)	12.916 (-)	121 (-)

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
ユーロ（ドイツ） ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千口 57.559 (-)	千ユーロ 715 (△29)	千口 31.031 (-)	千ユーロ 387 (-)
ユーロ（スペイン） INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	千口 193.071 (-) 24.223 (-) 32.598 (-) 118.664 (-) 9.903 (-)	千ユーロ 1,642 (-) 213 (△11) 524 (-) 1,373 (△32) 168 (-)	千口 56.091 (-) 14.499 (-) 23.633 (-) 137.88 (-) 32.103 (-)	千ユーロ 499 (-) 132 (-) 380 (-) 1,604 (-) 582 (-)
ユーロ（イタリア） BENI STABILI SPA IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE SIIQ SPA-RTS	千口 346.934 (-) 55.539 (△117.492) — (14.759)	千ユーロ 245 (-) 99 (-) — (-)	千口 252.972 (-) 30.127 (-) 14.759 (-)	千ユーロ 180 (-) 26 (-) 15 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

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

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期								
	区分	買付額等A		うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C		うち利害関係人との取引状況D	D/C
金銭信託		百万円	172	百万円	172	%	百万円	172	%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、資産管理サービス信託銀行です。

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)	当期				末比率
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
不動産ファンド (アメリカ)						
MANULIFE US REIT	206	511.5	439	48,409	0.1	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	30.95	43,436	5,490	604,256	1.1	
ALEXANDER'S INC.	1.22	1,606	618	68,043	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	52.56	65,092	7,965	876,582	1.6	
CEDAR REALTY TRUST INC	25.41	33,531	157	17,343	0.0	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	19.44	—	—	—	—	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	66.79	84,226	2,676	294,571	0.6	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	53.3	66,724	2,805	308,698	0.6	
AGREE REALTY CORP	9.11	13,167	706	77,769	0.1	
SL GREEN	34.6	37,248	3,732	410,734	0.8	
EPR PROPERTIES	21.84	27,43	1,794	197,451	0.4	
PROLOGIS INC	181.05	224,948	14,385	1,583,115	3.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	47.05	58,29	9,904	1,089,941	2.1	
LEXINGTON REALTY TRUST	74.96	91,973	814	89,677	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	29.76	39,066	3,581	394,108	0.7	
CBL & ASSOCIATES	59.39	72,069	434	47,825	0.1	
MACK CALI	30.33	38,286	784	86,289	0.2	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	50.99	65,269	2,811	309,437	0.6	
COUSINS PROPERTIES INC	143.17	178,182	1,689	185,892	0.3	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	38.72	46,458	1,616	177,922	0.3	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10.31	12,432	279	30,769	0.1	
DDR CORP	106.09	64,983	1,161	127,866	0.2	
ISTAR INC	23.73	28,395	315	34,748	0.1	
DUKE REALTY TRUST	120.81	150,436	4,322	475,638	0.9	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25.98	39,727	281	30,953	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	22.41	27,845	6,532	718,925	1.4	
EQUITY RESIDENTIAL	125.37	155,294	9,761	1,074,283	2.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	24.54	30,863	3,817	420,109	0.8	
FIRST INDUSTRIAL RT	40.15	52,771	1,745	192,110	0.4	
GGP INC	199.09	266,85	5,537	609,361	1.1	
FELCOR LODGING TR INC	42.87	—	—	—	—	
HCP INC	160.11	198,084	4,876	536,694	1.0	
EQUITY COMMONWEALTH	42.44	51,112	1,603	176,508	0.3	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	39.731	52,993	1,510	166,208	0.3	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	34.637	43,81	2,186	240,582	0.5	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	55.985	69,715	1,969	216,737	0.4	
WELLTOWER INC	125.02	156,947	9,228	1,015,594	1.9	
EAST GROUP	11.48	14,741	1,383	152,231	0.3	
KIMCO REALTY	144.51	179,68	3,126	344,063	0.6	
KILROY REALTY CORP	33.37	41,605	3,127	344,221	0.6	
LTC PROPERTIES INC	13.29	16,835	711	78,350	0.1	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	80.937	100,809	1,804	198,583	0.4	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	24.51	33,032	521	57,363	0.1	
LIBERTY PROPERTY TRUST	50.04	62,537	2,749	302,541	0.6	
BRANDYWINE REALTY TRUST	60.02	74,331	1,226	134,972	0.3	
IRON MOUNTAIN INC	83.42	118,572	4,114	452,795	0.9	
THE MACERICH COMPANY	40.72	45,998	2,631	289,550	0.5	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27.71	37,342	3,403	374,579	0.7	
ACADIA REALTY TRUST	29.32	34,26	960	105,757	0.2	
HOST HOTELS & RESORTS INC	252.82	312,724	6,764	744,402	1.4	
MID AMERICA	38.83	47,941	4,738	521,417	1.0	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14.45	15,638	333	36,742	0.1	
NATIONAL HEALTH INVS INC	14.01	17,625	1,313	144,502	0.3	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	42.12	50,011	297	32,692	0.1	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5.68	6,553	174	19,247	0.0	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	23.2	29,416	339	37,390	0.1	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期					末 率
		口 数	口 数	外 貨	建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%		
GETTY REALTY CORP	9.05	13,326	362	39,918	0.1		
PS BUSINESS PARKS	6.76	8,446	1,066	117,347	0.2		
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	26.53	33,773	432	47,648	0.1		
REALTY INCOME CORP	93.31	119,894	6,416	706,160	1.3		
REGENCY CENTERS CORP	49.68	62,085	3,805	418,761	0.8		
UDR INC	90.85	113,114	4,167	458,591	0.9		
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	33.78	42,988	1,205	132,652	0.2		
CORECIVIC INC	40.28	50,174	1,130	124,402	0.2		
SAUL CENTERS INC	4.07	5,042	260	28,697	0.1		
SIMON PROPERTY GROUP INC	106.55	130,666	22,145	2,437,087	4.6		
LIFE STORAGE INC	15.91	19,733	1,890	208,084	0.4		
PUBLIC STORAGE	51.04	63,208	14,022	1,543,128	2.9		
SUN COMMUNITIES INC	24,074	33,726	3,251	357,830	0.7		
TAUBMAN CENTERS INC	20.71	25,845	1,535	168,947	0.3		
TANGER FACTORY OUTLET	33.3	40,143	933	102,756	0.2		
UMH PROPERTIES INC	9.33	14,882	218	24,058	0.0		
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8.67	12,671	238	26,285	0.0		
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4.32	5,259	351	38,637	0.1		
VENTAS INC	121.18	150,254	8,271	910,276	1.7		
VORNADO REALTY TRUST	58.86	73,134	5,348	588,579	1.1		
WASHINGTON REIT	25.86	33,313	984	108,296	0.2		
GEO GROUP INC	42.04	51,638	1,345	148,092	0.3		
WEINGARTEN REALTY INVST	40.33	50,686	1,583	174,312	0.3		
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	45.84	57,893	2,479	272,875	0.5		
KITE REALTY GROUP TRUST	28.99	35,532	618	68,039	0.1		
EXTRA SPACE STORAGE INC	42.77	53,193	5,302	583,574	1.1		
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	37.34	44,756	371	40,880	0.1		
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	75.33	95,603	1,613	177,596	0.3		
CUBESMART	61.435	77,311	2,466	271,407	0.5		
DIGITAL REALTY TRUST INC	54.58	86,876	9,318	1,025,481	1.9		
EDUCATION REALTY TRUST INC	25.09	32,161	1,299	143,023	0.3		
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	67.56	85,121	1,051	115,689	0.2		
MEDICAL PROPERTIES TRUST	124.44	154,694	2,178	239,698	0.5		
DOUGLAS EMMETT INC	50.21	67.6	2,707	297,947	0.6		
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	31.317	39,742	2,593	285,421	0.5		
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	26.432	—	—	—	—		
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	37.86	47,738	926	101,971	0.2		
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	49.79	54,405	1,066	117,410	0.2		
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	35.63	44,281	638	70,221	0.1		
TERRENO REALTY CORP	17.2	23,552	879	96,781	0.2		
AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,067	17,616	670	73,745	0.1		
RLJ LODGING TRUST	42.95	74,135	1,676	184,546	0.3		
AMERICOLD REALTY TRUST	—	19,99	444	48,947	0.1		
CORESITE REALTY CORP	11.61	14,529	1,605	176,680	0.3		
VEREIT INC	330.79	407,682	3,008	331,106	0.6		
CHESAPEAKE LODGING TRUST	20.88	25,52	818	90,067	0.2		
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23.78	29,264	1,158	127,531	0.2		
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRU	24.56	42,132	618	68,065	0.1		
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES	10.21	16,134	249	27,485	0.1		
CHATHAM LODGING TRUST	13.28	19,517	400	44,073	0.1		
SABRA HEALTH CARE REIT INC	22.66	75,62	1,614	177,674	0.3		
WHITESTONE REIT	13.92	17,842	219	24,190	0.0		
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	53.35	65,87	2,295	252,627	0.5		
STAG INDUSTRIAL INC	29.95	40,858	1,102	121,358	0.2		
SELECT INCOME REIT	22.03	27,352	598	65,890	0.1		
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	81.21	92,273	1,200	132,111	0.2		
CYRUSONE INC	26.659	41,756	2,423	266,662	0.5		
WP CAREY INC	36.16	45,338	2,981	328,106	0.6		
ALEXANDER & BALDWIN INC	—	28,742	617	67,942	0.1		
GLADSTONE LAND CORP	—	5,526	69	7,595	0.0		

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	千口	口数	千口	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(アメリカ)							
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	65,147	86,903	2,288	251,811	0.5		%
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17.47	21,716	1,797	197,783	0.4		
WHEELER REIT INC	3.49	2,961	11	1,215	0.0		
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	15.26	19,187	290	31,989	0.1		
GRAMERCY PROPERTY TRUST	51.92	68,158	1,883	207,246	0.4		
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	165.52	180,298	1,498	164,885	0.3		
PHYSICIANS REALTY TRUST	51.88	76,067	1,219	134,189	0.3		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	22.37	34,068	1,064	117,124	0.2		
AMERICAN HOMES 4 RENT	80.34	110,338	2,408	265,075	0.5		
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	19.27	35,997	371	40,921	0.1		
JBG SMITH PROPERTIES	—	39,622	1,484	163,340	0.3		
INVITATION HOMES INC	26.32	120,949	2,734	300,948	0.6		
MEDSEQUITIES REALTY TRUST INC	7.39	13,143	139	15,331	0.0		
FOREST CITY REALTY TRUST INC	74.8	113,135	2,607	286,984	0.5		
PARKWAY INC	14.77	—	—	—	—		
QTS REALTY TRUST INC	16.55	21,476	846	93,119	0.2		
SPIRIT MTA REIT	—	17,097	178	19,643	0.0		
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	42.45	55,942	956	105,274	0.2		
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	—	8,484	192	21,175	0.0		
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	42.2	49,73	1,119	123,247	0.2		
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	66.43	84,705	2,980	328,033	0.6		
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	89.202	127,551	2,247	247,331	0.5		
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10.9	13,902	148	16,324	0.0		
STARWOOD WAYPOINT HOMES	33.23	—	—	—	—		
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	7.5	8,916	81	8,958	0.0		
FARMLAND PARTNERS INC	10.05	14,523	131	14,496	0.0		
CITY OFFICE REIT INC	8.1	14,463	182	20,038	0.0		
WASHINGTON PRIME GROUP INC	64.37	78,952	648	71,333	0.1		
CARETRUST REIT INC	24.33	32,366	542	59,732	0.1		
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	57.446	—	—	—	—		
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	28.4	34,578	261	28,730	0.1		
STORE CAPITAL CORP	58.22	72,549	1,970	216,845	0.4		
PARAMOUNT GROUP INC	—	86,597	1,336	147,047	0.3		
GLOBAL MEDICAL REIT INC	—	8,278	76	8,381	0.0		
URBAN EDGE PROPERTIES	34.22	44,936	1,022	112,552	0.2		
INFRAREIT INC	—	16,132	347	38,240	0.1		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	8	18,694	363	40,013	0.1		
XENIA HOTELS & RESORTS INC	35.9	45,298	1,132	124,626	0.2		
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5.9	7,762	210	23,200	0.0		
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	15.13	21,369	634	69,797	0.1		
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	4.37	6,974	203	22,402	0.0		
APPLE HOSPITALITY REIT INC	53.59	91,138	1,676	184,446	0.3		
GLOBAL NET LEASE INC	19.85	28,621	566	62,333	0.1		
TIER REIT INC	16.54	20,328	487	53,667	0.1		
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	28.34	—	—	—	—		
QUALITY CARE PROPERTIES INC	32.229	39,836	874	96,183	0.2		
CLIPPER REALTY INC	—	5,169	44	4,863	0.0		
PARK HOTELS & RESORTS INC	49.2	85,299	2,670	293,911	0.6		
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	18.7	21,513	313	34,541	0.1		
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	8.23	11,004	475	52,375	0.1		
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	20.78	26,006	611	67,256	0.1		
COLONY NORTHSTAR INC	186.96	208,616	1,339	147,391	0.3		
小計	口数	金額	口数	金額	口数	金額	比率
	銘柄	口数	比	率	銘柄	比	率
(カナダ)							
SMARTCENTRES REIT	21.51	27,854	845	69,937	0.1		
CANADIAN APT PPTYS REIT	22.39	29,587	1,275	105,497	0.2		
MORGUARD REAL ESTATE INV TR	8.82	10,016	133	11,037	0.0		
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	48.3	60,656	1,237	102,368	0.2		
CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	12.09	—	—	—	—	—	—

銘柄	期首(前期末)		当期				期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	千円	比率		
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%			
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	54	65,342	1,585	131,197	0.2			
ALLIED PROPERTIES REIT	13.99	19,518	827	68,464	0.1			
COMINAR REAL ESTATE INV'T TR	29.93	38,546	492	40,722	0.1			
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV'T TRU	16.71	12,463	296	24,508	0.0			
NORTHVIEW APARTMENT REIT	8.05	10,096	262	21,691	0.0			
ONEREIT	9.828	—	—	—	—			
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.917	9,781	450	37,230	0.1			
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	26.12	30,141	402	33,314	0.1			
CROMBIE REAL ESTATE INV'	14.08	18,049	235	19,501	0.0			
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13.7	20,114	219	18,121	0.0			
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUS	44.83	—	—	—	—			
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTY	4.63	—	—	—	—			
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	14.84	21,137	239	19,829	0.0			
MORGARD NORTH AMERICAN RESIDENT	6.12	7,446	113	9,418	0.0			
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM	24.14	37,235	541	44,820	0.1			
DREAM INDUSTRIAL REIT	8.77	13,888	143	11,845	0.0			
AGELLAN COMMERCIAL REIT	4.9	7,03	93	7,775	0.0			
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	—	17,406	150	12,484	0.0			
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	7.78	9,917	535	44,262	0.1			
CHOICE PROPERTIES REIT	16.32	58,346	707	58,502	0.1			
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11.277	12,724	165	13,695	0.0			
PLAZA RETAIL REIT	19.36	—	—	—	—			
SLATE RETAIL REIT	7.89	7,739	100	8,323	0.0			
SLATE OFFICE REIT	11,022	12,079	92	7,634	0.0			
KILLAM APARTMENT REIT	13.28	15,367	230	19,069	0.0			
小計	□数 銘柄	□数 銘柄	金額 数<比率>	502,594	572,477	11,377	941,254	— 1.8
29銘柄<1.8%>	25銘柄<1.8%>							
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%			
BWP TRUST	163.73	205,883	681	55,417	0.1			
MIRVAC GROUP	1,256.98	1,562,622	3,500	284,642	0.5			
INVESTA OFFICE FUND	212.77	211,438	1,103	89,753	0.2			
CROMWELL PROPERTY GROUP	434.98	674,83	755	61,462	0.1			
CHARTER HALL RETAIL REIT	111.64	140,441	610	49,679	0.1			
ASPEN GROUP	31.613	—	—	—	—			
GPT GROUP	614.9	761,372	3,966	322,575	0.6			
ABACUS PROPERTY GROUP	97.7	137,44	540	43,924	0.1			
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	69.61	88,555	239	19,515	0.0			
ALE PROPERTY GROUP	60.5	—	—	—	—			
STOCKLAND	816.67	1,031,289	4,310	350,553	0.7			
WESTFIELD CORP	651.76	—	—	—	—			
INGENIA COMMUNITIES GROUP	73.368	85,235	231	18,853	0.0			
DEXUS	328.88	429,175	4,308	350,401	0.7			
GOODMAN GROUP	540.98	676,39	6,703	545,089	1.0			
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	17.5	—	—	—	—			
360 CAPITAL GROUP LTD	62.283	—	—	—	—			
VICINITY CENTRES	1,108.8	1,363,217	3,680	299,313	0.6			
CHARTER HALL GROUP	156.43	196,697	1,298	105,569	0.2			
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	84.27	104,165	380	30,918	0.1			
GENERATION HEALTHCARE REIT	49.49	—	—	—	—			
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	244.21	307,102	773	62,933	0.1			
ARENA REIT	80.13	108,676	240	19,530	0.0			
PROPERTYLINK GROUP	209.18	151,222	161	13,158	0.0			
CHARTER HALL LONG WALE REIT	60.04	72,501	321	26,118	0.0			
INDUSTRIA REIT	43.83	42,579	110	8,967	0.0			
NATIONAL STORAGE REIT	172.15	223,901	364	29,678	0.1			
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	46.56	62,65	208	16,965	0.0			
GDI PROPERTY GROUP	173.07	208,566	272	22,133	0.0			
RURAL FUNDS GROUP	—	104,894	222	18,083	0.0			
SCENTRE GROUP	1,810.29	2,259,234	9,850	801,023	1.5			
VIVA ENERGY REIT	140.57	183,737	400	32,572	0.1			
小計	□数 銘柄	□数 銘柄	金額 数<比率>	9,924,884	11,393,811	45,238	3,678,834	— 6.9
31銘柄<8.1%>	26銘柄<6.9%>							

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	千円	比率		
(香港)								
LINK REIT	752.52	910.52	千香港・ドル	887,195	千円	%		
PROSPERITY REIT	418	522	63,235	23,582	1.7			
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	362	492	1,680	37,136	0.0			
CHAMPION REIT	723.07	871.07	2,646	65,994	0.1			
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	342	403	4,703	30,701	0.1			
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRU	261	—	2,188	—	—			
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	476	588	5,468	76,721	0.1			
SPRING REIT	306	351	1,168	16,398	0.0			
小計	3,640.59	4,137.59	81,092	1,137,730	—	—	—	2.1
	□銘柄数	□銘柄数	千銘柄<2.0%>	千銘柄<2.1%>	—	—	—	
(シンガポール)								
CAPITALAND MALL TRUST	918.96	1,136.76	千シンガポール・ドル	188,000	千円	%		
ASCENDAS REAL ESTATE INV'T	822.06	1,014.36	2,318	214,631	0.4			
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	733.01	1,132.679	2,647	150,595	0.3			
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	869.59	952.79	1,857	129,767	0.2			
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	515.02	876.22	1,600	86,662	0.2			
STARHILL GLOBAL REIT	475.5	550.5	1,068	29,008	0.1			
ASCOTT RESIDENCE TRUST	406.015	548.015	357	48,426	0.1			
FRASERS COMMERCIAL TRUST	205.48	270.88	597	29,865	0.1			
KEPPEL REIT	624	769.7	368	68,639	0.1			
FRASERS CENTREPOINT TRUST	193	247.6	846	43,959	0.1			
ESR REIT	356	539.43	542	21,209	0.0			
CDL HOSPITALITY TRUSTS	227	314.3	261	41,278	0.1			
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	239.08	234.58	509	27,955	0.1			
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	187	236.6	344	25,894	0.0			
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	200.095	235.095	319	26,492	0.0			
PARKWAY LIFE REIT	129.5	167.7	326	35,212	0.1			
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	647	798.3	434	20,386	0.0			
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	402.02	524.22	251	80,747	0.2			
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	600	811.8	996	101,351	0.2			
CACHE LOGISTICS TRUST	306	435.78	1,250	26,496	0.0			
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	335.9	357.2	326	12,596	0.0			
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	623	912.6	155	84,342	0.2			
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	268	317.2	1,040	19,672	0.0			
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	273	359.6	242	18,657	0.0			
SPH REIT	274	265.4	230	21,408	0.0			
OUE HOSPITALITY TRUST	394.02	488.62	264	31,095	0.1			
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	236	276.1	383	14,437	0.0			
OUE COMMERCIAL REIT	195.5	—	178	—	—			
KEPPEL DC REIT	267	402.2	195.5	43,692	0.1			
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL T	353	572.75	538	48,290	0.1			
小計	12,275.75	15,748.979	20,855	1,690,774	—	—	—	3.2
	□銘柄数	□銘柄数	千銘柄<3.1%>	千銘柄<3.2%>	—	—	—	
(ニュージーランド)								
PRECINCT PROPERTIES	338.74	423.696	千ニュージーランド・ドル	42,486	千円	%		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	115.5	129.943	561	20,012	0.1			
GOODMAN PROPERTY TRUST	336	441.448	264	48,108	0.0			
KIWI PROPERTY GROUP LTD	452	606.953	635	62,011	0.1			
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	152.47	—	819	—	—			
ARGOSY PROPERTY LTD	280.51	356.878	—	—	—			
INVESTORE PROPERTY LTD	65.12	88.877	387	29,304	0.1			
STRIDE STAPLED GROUP	119.27	149.101	131	9,954	0.0			
小計	1,859.61	2,196.896	3,075	232,753	—	—	—	0.4
	□銘柄数	□銘柄数	千銘柄<0.5%>	千銘柄<0.4%>	—	—	—	
(イギリス)								
BRITISH LAND CO PLC	349.88	419.592	千イギリス・ポンド	415,607	千円	%		
CAPITAL & REGIONAL PLC	149.76	229.731	2,848	17,398	0.8			
DERWENT LONDON PLC	37.83	46.537	119	207,658	0.0			
BIG YELLOW GROUP PLC	51.7	63.285	1,423	85,511	0.4			
HAMMERSOHN PLC	270.65	333.513	586	258,417	0.2			
	□銘柄数	□銘柄数	千銘柄<0.5%>	千銘柄<0.4%>	—	—	—	0.5

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	
(イギリス)							
LAND SECURITIES GROUP PLC	千口 270.14	千口 317.138	千イギリス・ポンド 2,991	千円 436,482	0.8	%	
WORKSPACE GROUP PLC	40.31	50.811	556	81,187	0.2		
MCKAY SECURITIES PLC	29.06	—	—	—	—		
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	20.463	—	—	—	—		
INTU PROPERTIES PLC	308.69	372.244	707	103,203	0.2		
UNITE GROUP PLC	77.1	111.92	931	135,958	0.3		
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	198.84	312.94	357	52,148	0.1		
SHAFTESBURY PLC	95.12	103.012	960	140,168	0.3		
SEGRO PLC	337.27	425.024	2,805	409,328	0.8		
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	110.3	119.899	853	124,586	0.2		
ASSURA PLC	560.02	1,013.326	585	85,465	0.2		
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	171.09	221.364	137	20,026	0.0		
HANSTEEN HOLDINGS PLC	251.91	167.573	177	25,968	0.0		
SAFESTORE HOLDINGS LTD	70.06	89.348	469	68,447	0.1		
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	241.3	295.326	549	80,154	0.2		
RDI REIT PLC	447.86	528.881	183	26,779	0.1		
NEWRIVER REIT PLC	81.127	131.034	354	51,720	0.1		
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	72.808	81.48	83	12,186	0.0		
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	—	37.06	33	4,953	0.0		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	466.886	626.95	955	139,422	0.3		
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	168.53	228.6	200	29,221	0.1		
LXI REIT PLC	44.44	73.4	81	11,888	0.0		
REGIONAL REIT LTD	80.97	118.301	111	16,330	0.0		
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	48.48	—	—	—	—		
小計	□数 銘柄 数<比率>	5,052,594	6,518,289	20,834	3,040,225	—	
	□数 銘柄 数<比率>	28銘柄<5.4%>	26銘柄<5.7%>	—	—	—	5.7
(イスラエル)							
REIT 1 LTD	千口 56	千口 70,287	千イスラエル・シェケル 991	千円 30,098	0.1	%	
小計	□数 銘柄 数<比率>	56	70,287	991	30,098	—	0.1
1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	—	—	—		0.1
(ヨーロ…アイルランド)							
GREEN REIT PLC	千口 232.64	千口 293,629	千ユーロ 444	千円 56,787	0.1	%	
HIBERNIA REIT PLC	230.28	299.53	461	58,923	0.1		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	122.99	138,876	191	24,410	0.0		
小計	□数 銘柄 数<比率>	585.91	732,035	1,096	140,121	—	0.3
3銘柄<0.2%>	3銘柄<0.3%>	3銘柄<0.3%>	—	—	—		0.3
(ヨーロ…オランダ)							
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	千口 16,763	千口 21,124	千ユーロ 765	千円 97,789	0.2	%	
VASTNED RETAIL	6.26	6,794	276	35,365	0.1		
WERELDHAVE NV	13.92	16,816	558	71,294	0.1		
NSI NV	6,107	7,625	271	34,626	0.1		
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	—	57,184	10,796	1,379,124	2.6		
小計	□数 銘柄 数<比率>	43.05	109,543	12,667	1,618,200	—	3.0
4銘柄<0.5%>	5銘柄<3.0%>	—	—	—	—		3.0
(ヨーロ…ベルギー)							
BEFIMMO	千口 7.71	千口 9.8	千ユーロ 507	千円 64,845	0.1	%	
COFINIMMO SA	7	8,205	849	108,479	0.2		
RETAIL ESTATES	2.08	3,232	245	31,377	0.1		
WERELDHAVE BELGIUM	0.78	—	—	—	—		—
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4.49	6,873	150	19,183	0.0		
WAREHOUSES DE PAUW	5.56	7,037	757	96,722	0.2		
MONTEA SCA	2,231	—	—	—	—		—
AEDIFICA	6.01	7,647	596	76,192	0.1		
COFINIMMO SA-RTS	—	8,342	5	745	0.0		
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,014	—	—	—	—		—
小計	□数 銘柄 数<比率>	37,875	51,136	3,112	397,546	—	0.7
9銘柄<0.8%>	7銘柄<0.7%>	—	—	—	—		0.7
(ヨーロ…フランス)							
GECINA SA	千口 13.68	千口 20,261	千ユーロ 2,917	千円 372,692	0.7	%	
ICADE	15.46	18,935	1,529	195,314	0.4		

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		
(ユーロ…フランス) ALTAREA KLEPIERRE COVIVIO MERCIALYS UNIBAIL-RODAMCO SE	千口 0.902 70.45 18.09 19.06 33.91	千口 1,518 87.317 22.663 22.547 —	千ユーロ 303 2,861 2,010 337 —	千円 38,781 365,512 256,783 43,058 —	% 0.1 0.7 0.5 0.1 —		
小計	口数 銘柄数<比率>	171,552 7銘柄<4.5%>	173,241 6銘柄<2.4%>	9,958 —	1,272,143 —		2.4
(ユーロ…ドイツ) HAMBORNER REIT AG ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千口 27.89 34.83	千口 33.143 61.358	千ユーロ 302 789	千円 38,653 100,873	% 0.1 0.2		
小計	口数 銘柄数<比率>	62.72 2銘柄<0.2%>	94,501 2銘柄<0.3%>	1,092 —	139,526 —		0.3
(ユーロ…スペイン) INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS S MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	千口 — 30 37,214 159.33 22.2	千口 136.98 39,724 46,179 815 —	千ユーロ 1,292 373 815 1,742 —	千円 165,091 47,698 104,233 222,563 —	% 0.3 0.1 0.2 0.4 —		
小計	口数 銘柄数<比率>	248,744 4銘柄<0.8%>	362,997 4銘柄<1.0%>	4,224 —	539,588 —		1.0
(ユーロ…イタリア) BENI STABILI SPA IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	千口 343,798 112.11	千口 437.76 20.03	千ユーロ 327 138	千円 41,827 17,662	% 0.1 0.0		
小計	口数 銘柄数<比率>	455,908 2銘柄<0.1%>	457.79 2銘柄<0.1%>	465 —	59,489 —		0.1
合計	口数 銘柄数<比率>	42,503,759 324銘柄<99.7%>	52,573,48 311銘柄<99.3%>	— —	52,796,215 —		99.3

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

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

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

■投資信託財産の構成

2018年6月22日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券、投資証券	千円 52,796,215	% 98.9
コール・ローン等、その他	589,533	1.1
投資信託財産総額	53,385,749	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、53,059,037千円、99.4%です。

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年6月22日)現在

項	目	当期末
(A) 資	産	53,466,516,162円
コ 一 ル ル 口 一 シ 等		379,841,373
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)		5,388,679,098
投 資 託 券(評価額)		47,407,536,710
未 収 入 金		169,047,927
未 収 配 当 金		121,411,054
(B) 負 債		318,147,369
未 払 金		251,515,859
未 払 解 約 金		66,631,000
そ の 他 未 払 費 用		510
(C) 純 資 産 総 額(A-B)		53,148,368,793
元 本		44,369,434,317
次 期 繰 越 損 益 金		8,778,934,476
(D) 受 益 権 総 口 数		44,369,434,317口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)		11,979円

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2017年6月23日 至2018年6月22日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		2,019,083,051円
受 取 配 当 金		2,018,183,517
受 取 利 息		1,117,924
そ の 他 収 益 金		1,415
支 払 利 息		△219,805
(B) 有 値 証 券 売 買 損 益		△1,304,484,815
売 買 益		2,874,742,828
売 買 損		△4,179,227,643
(C) そ の 他 費 用		△34,678,818
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		679,919,418
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		6,470,248,917
(F) 解 約 差 損 益 金		△4,324,322,200
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		5,953,088,341
(H) 合 計(D + E + F + G)		8,778,934,476
次 期 繰 越 損 益 金(H)		8,778,934,476

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(平成30年3月1日)