

運用報告書 (全体版)

DIAMパッシブ資産分散ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|---|---|
| 商品分類 | 追加型投信/内外/資産複合 | |
| 信託期間 | 2005年12月28日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 安定的なインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得をめざします。 | |
| 主要投資対象 | DIAMパッシブ資産分散ファンド | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、日経225インデックスファンド・マザーファンド受益証券および外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 海外の公社債を主要投資対象とします。 |
| | 日経225インデックスファンド・マザーファンド | わが国の株式を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 [※] を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券 |
| | 各マザーファンドへの投資に当たっては、各資産の信託財産におけるリスク量が均等となる比率（以下、「基本リスクウェイト」といいます。）に基づき算出された資産構成比に従い、配分します。 基本リスクウェイトは、各資産の時価およびボラティリティをもとに、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社が定期的に計測します。計測の結果、原則として、基本リスクウェイトから信託財産におけるいずれかの資産のリスクウェイトが5%以上乖離した場合にはリバランスを行います。 実質組入外資産については、為替ヘッジは行いません。 マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。 | |
| 組入制限 | 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 | |
| 分配方針 | 毎決算時（原則として、奇数月の各6日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等のうち、原則として利子・配当等収益の範囲内で行います。また、毎年5月および11月の決算時には、原則として利子・配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。 | |

愛称 **三木の久**

第75期 <決算日 2018年7月6日>
第76期 <決算日 2018年9月6日>
第77期 <決算日 2018年11月6日>

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、「DIAMパッシブ資産分散ファンド」は、2018年11月6日に第77期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

DIAMパッシブ資産分散ファンド

■最近5作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期 | 基準価額 | | | 株式組入率 | 株式先物比率 | 債券組入率 | 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 |
|--------|-----------------|------------|------------|-----------|-----------|----------|-----------|--------|-------------------------------|--------------|
| | | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | | | | | | |
| 第22作成期 | 63期(2016年7月6日) | 円 8,769 | 円 40 | % △4.3 | % 22.3 | % 3.9 | % 45.8 | % - | % 29.1 | 百万円 6,009 |
| | 64期(2016年9月6日) | 9,183 | 40 | 5.2 | 23.7 | 3.5 | 43.8 | - | 26.0 | 6,236 |
| | 65期(2016年11月7日) | 8,814 | 40 | △3.6 | 19.7 | 4.9 | 45.0 | - | 21.5 | 5,842 |
| 第23作成期 | 66期(2017年1月6日) | 9,765 | 40 | 11.2 | 21.8 | 3.1 | 44.2 | - | 28.0 | 6,194 |
| | 67期(2017年3月6日) | 9,583 | 40 | △1.5 | 21.4 | 4.4 | 44.3 | - | 27.3 | 5,969 |
| | 68期(2017年5月8日) | 9,656 | 40 | 1.2 | 20.5 | 5.6 | 45.0 | - | 26.4 | 5,900 |
| 第24作成期 | 69期(2017年7月6日) | 9,763 | 40 | 1.5 | 19.7 | 4.8 | 46.8 | - | 26.5 | 5,794 |
| | 70期(2017年9月6日) | 9,581 | 40 | △1.5 | 20.9 | 3.8 | 46.8 | - | 25.8 | 5,582 |
| | 71期(2017年11月6日) | 10,196 | 40 | 6.8 | 21.0 | 4.5 | 47.0 | - | 25.3 | 5,749 |
| 第25作成期 | 72期(2018年1月9日) | 10,349 | 40 | 1.9 | 25.3 | 2.0 | 46.0 | - | 24.0 | 5,675 |
| | 73期(2018年3月6日) | 9,396 | 40 | △8.8 | 20.8 | 3.4 | 47.0 | - | 23.3 | 5,080 |
| | 74期(2018年5月7日) | 9,719 | 40 | 3.9 | 20.9 | 3.2 | 46.6 | - | 27.2 | 5,179 |
| 第26作成期 | 75期(2018年7月6日) | 9,822 | 40 | 1.5 | 21.1 | 1.7 | 47.2 | - | 27.0 | 5,151 |
| | 76期(2018年9月6日) | 9,862 | 40 | 0.8 | 20.3 | 2.9 | 46.4 | - | 26.9 | 5,069 |
| | 77期(2018年11月6日) | 9,717 | 40 | △1.1 | 21.4 | 2.4 | 46.4 | - | 27.3 | 4,893 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドは、外国債券、国内株式及び外国不動産投資信託証券(リート)に投資を行い、安定的なインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得をめざして運用しております。

上記資産を組合わせた適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 株式組入 比 率 | 株式先物 比 率 | 債券組入 比 率 | 債券先物 比 率 | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 |
|------|-------------------------|---------|--------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------------------------|
| | | 円 | 騰 落 率 | | | | | |
| 第75期 | (期 首) 2018年 5 月 7 日 | 9,719 | % - | % 20.9 | % 3.2 | % 46.6 | % - | % 27.2 |
| | 5 月 末 | 9,646 | △0.8 | 20.2 | 3.8 | 46.3 | - | 27.2 |
| | 6 月 末 | 9,827 | 1.1 | 19.7 | 3.6 | 46.4 | - | 27.8 |
| | (期 末) 2018年 7 月 6 日 | 9,862 | 1.5 | 21.1 | 1.7 | 47.2 | - | 27.0 |
| 第76期 | (期 首) 2018年 7 月 6 日 | 9,822 | - | 21.1 | 1.7 | 47.2 | - | 27.0 |
| | 7 月 末 | 9,848 | 0.3 | 22.0 | 1.7 | 46.9 | - | 27.2 |
| | 8 月 末 | 9,957 | 1.4 | 21.3 | 2.6 | 45.6 | - | 27.7 |
| | (期 末) 2018年 9 月 6 日 | 9,902 | 0.8 | 20.3 | 2.9 | 46.4 | - | 26.9 |
| 第77期 | (期 首) 2018年 9 月 6 日 | 9,862 | - | 20.3 | 2.9 | 46.4 | - | 26.9 |
| | 9 月 末 | 10,095 | 2.4 | 21.8 | 2.8 | 46.6 | - | 26.4 |
| | 10 月 末 | 9,733 | △1.3 | 19.0 | 4.5 | 47.3 | - | 27.2 |
| | (期 末) 2018年 11 月 6 日 | 9,757 | △1.1 | 21.4 | 2.4 | 46.4 | - | 27.3 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

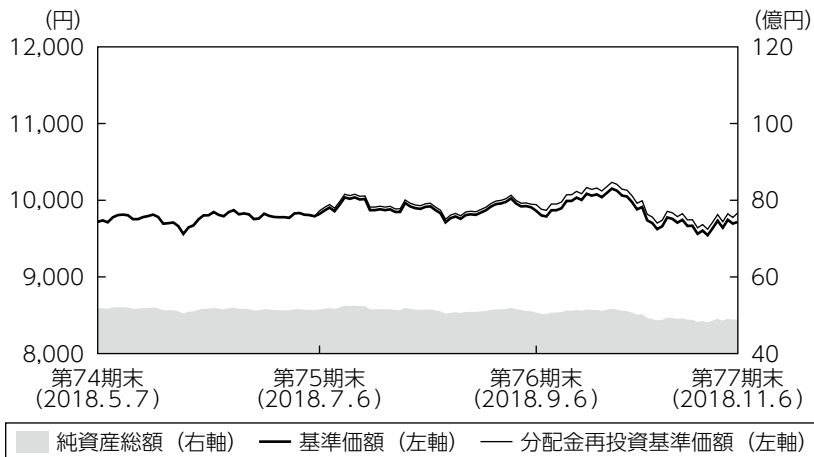
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■第75期～第77期の運用経過（2018年5月8日から2018年11月6日まで）

基準価額等の推移



第75期首： 9,719円
 第77期末： 9,717円
 （既払分配金120円）
 騰落率： 1.2%
 （分配金再投資ベース）

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

国内企業業績の先行きや中国景気への懸念が強まったこと等を背景に作成期末近辺にかけて国内株式市場が下落したことや、米国やカナダで良好な景況感とそれに伴う利上げを背景に長期金利が上昇したこと等がマイナスに寄与したものの、米国の良好な景況感等を背景に米国リートが上昇したこと、為替市場で米ドルやカナダドル等の通貨に対して円安に振れたこと等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|-------------------------|-------|
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 0.5% |
| 日経225インデックスファンド・マザーファンド | △0.5% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 5.9% |

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。米国では堅調な経済情勢を背景に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ECB（欧州中央銀行）が金融緩和政策を継続する中で金利上昇は抑えられ、欧州債の利回りは概ねレンジ内での推移となりました。

国内株式市場は上昇と下落を繰り返す振れ幅の大きい相場展開となりました。国内企業業績の好調さ、日銀の金融緩和政策の継続や良好な米国経済指標などを背景に上昇する局面がありました。一方、米国における長期金利の上昇、米中対立の激化、世界景気の先行きへの警戒などを受けて下落する局面もありました。これらの結果、日経平均株価は作成期末を22,147.75円で迎えました。

外国リート市場については、米国リート市場は、海外経済動向の影響を受けにくいとの見方からリートを選好する動きが見られ、上昇しました。作成期末にかけて、米長期金利が上昇傾向を強めたことを受けて下落しましたが、通期では上昇しました。欧州リート市場はフランスやスペインを中心に大幅下落となりました。豪州リート市場は、オーストラリアの長期金利の上昇により調整する場面も見られましたが、堅調な小売売上高などを背景とした豪州経済への期待などから、通期では上昇しました。

為替市場ではまちまちの動きとなりました。ドル/円相場は、米国の経済指標が良好だったことや、それに伴い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、前作成期末比では円安ドル高に振れました。その他主要通貨では、長期金利が上昇し内外金利差が拡大したカナダドルに対して円安に振れた一方、景気先行き懸念やイタリアやドイツの政治的不透明感が強まったユーロに対してはやや円高に振れました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

当ファンドでは、マザーファンドへの投資を通じ、外国債券、国内株式、外国リーートの3資産に投資を行いました。各マザーファンドへの投資にあたっては、各資産の信託財産におけるリスク量が均等となる比率（基本リスクウェイト：各々約33%）に基づき算出された資産構成比に従い分散投資を行いました。

【運用状況】

○各資産のリスク量

※1 リスクウェイトはみずほ第一フィナンシャルテクノロジーが計測。

※2 リスクウェイトの乖離につきましては、基本リスクウェイトへ近づけるオペレーションを実施します。

前作成期末

| | ファン ド リス ク ウ ェ ィ ト | 基 本 リ ス ク ウ ェ ィ ト | 差 |
|-------|---|---|-------|
| 外国債券 | 32.3% | 33.3% | △1.1% |
| 国内株式 | 31.6% | 33.3% | △1.7% |
| 外国リート | 36.2% | 33.3% | 2.8% |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | 0.0% |

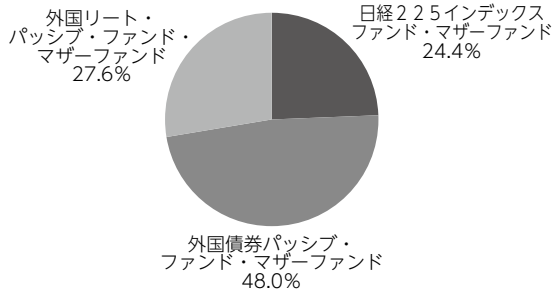
当作成期末

| | ファン ド リ ス ク ウ ェ ィ ト | 基 本 リ ス ク ウ ェ ィ ト | 差 |
|-------|---|---|-------|
| 外国債券 | 32.2% | 33.3% | △1.1% |
| 国内株式 | 33.6% | 33.3% | 0.3% |
| 外国リート | 34.1% | 33.3% | 0.8% |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | 0.0% |

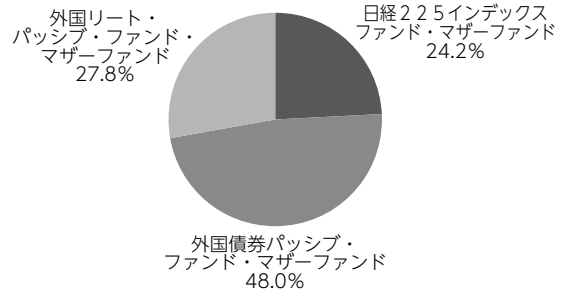
○マザーファンド組入比率

※比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

前作成期末



当作成期末



●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。

●日経225インデックスファンド・マザーファンド

ベンチマークである日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。具体的には、日経平均株価の計算手法に合わせて、現物株式では原則として日経平均株価の採用銘柄に等株数投資を行いました。また、ベンチマークとの連動性を維持するため、日経平均株価指数先物取引を積極的に活用し、株式実質組入比率を高位に保つように努めました。その結果、ファンドの投資成果がほぼ日経平均株価に連動する運用を行うことが出来ました。

●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）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。

分配金

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

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 第75期 | 第76期 | 第77期 |
|------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2018年5月8日 ～2018年7月6日 | 2018年7月7日 ～2018年9月6日 | 2018年9月7日 ～2018年11月6日 |
| 当期分配金（税引前） | 40円 | 40円 | 40円 |
| 対基準価額比率 | 0.41% | 0.40% | 0.41% |
| 当期の収益 | 40円 | 40円 | 36円 |
| 当期の収益以外 | -円 | -円 | 3円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 379円 | 380円 | 377円 |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

今後も各資産のリスク量が均等になるよう、各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率についても、高位を維持する方針です。

●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。

●日経225インデックスファンド・マザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行います。日経平均株価指数の計算手法に合わせて原則等株数投資を行います。日経平均株価指数先物取引を積極的に活用して実質組入比率を高位に保ちます。最適な取引手法の選択により運用の効率性を高め、取引に伴って発生する諸コストを最小限に抑制することで、日経平均株価と同等の騰落率を実現するように努めます。日経平均株価指数の構成銘柄が変更される場合にも、指数算出基準に則り適切に対処していく方針です。

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしてパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第75期～第77期 | | 項目の概要 |
|-------------|------------------------|---------|---|
| | (2018年5月8日～2018年11月6日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 53円 | 0.543% | (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9,838円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託銀行分は、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) | (24) | (0.239) | |
| (販売会社) | (27) | (0.271) | |
| (受託銀行) | (3) | (0.032) | |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.004 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.001) | |
| (投資証券) | (0) | (0.003) | |
| (c) 有価証券取引税 | 1 | 0.006 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (1) | (0.006) | |
| (d) その他費用 | 3 | 0.029 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用 |
| (保管費用) | (1) | (0.009) | |
| (監査費用) | (0) | (0.002) | |
| (その他) | (2) | (0.018) | |
| 合計 | 57 | 0.582 | |

(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5月8日から2018年11月6日まで）

| | 第 75 期 | | 第 77 期 | |
|-------------------------|--------|-----|---------|---------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | - | - | 88,332 | 160,000 |
| 日経225インデックスファンド・マザーファンド | - | - | 45,993 | 80,000 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | - | - | 131,942 | 160,000 |

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 第 75 期 ~ 第 77 期 |
|-------------------|-------------------------|
| | 日経225インデックスファンド・マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 6,632,005千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 8,039,624千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.82 |

(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5月8日から2018年11月6日まで）

【D I AMパッシブ資産分散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

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 第 75 期 ~ 第 77 期 |
|------------------|-----------------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 234千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.009千円 |
| (B)/(A) | 0.0% |

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

【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。

【日経225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 | | 第 75 期 ~ 第 77 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 5,381 | 百万円 2,364 | % 43.9 | 百万円 1,250 | 百万円 - | % - |

平均保有割合 13.1%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 第 75 期 ~ 第 77 期 | | |
|-----|-----------------|--------------|----------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当作成期末保有額 |
| 株 式 | 百万円 1 | 百万円 0.391 | 百万円 3 |

(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 | 第 75 期 ~ 第 77 期 | |
|-----|-----------------|--|
| | 買 付 額 | |
| 株 式 | 百万円 1 | |

【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、当作成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、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

親投資信託残高

| | 第 25 作成期末 | | 第 26 作成期末 | |
|-------------------------|-----------|-----------|-----------|-------|
| | □ 数 | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千□ | | 千円 | |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,370,643 | 1,282,311 | 2,315,726 | |
| 日経225インデックスファンド・マザーファンド | 727,392 | 681,399 | 1,166,623 | |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,235,804 | 1,103,861 | 1,342,074 | |

■投資信託財産の構成

2018年11月6日現在

| 項 目 | 第 26 作 成 期 末 | |
|-------------------------|--------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2,315,726 | 47.0 |
| 日経225インデックスファンド・マザーファンド | 1,166,623 | 23.7 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,342,074 | 27.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 99,531 | 2.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 4,923,956 | 100.0 |

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2018年11月6日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは197,038,789千円、98.7%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは38,807,342千円、95.3%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11月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.23円、1カナダ・ドル=86.35円、1オーストラリア・ドル=81.70円、1香港・ドル=14.46円、1シンガポール・ドル=82.37円、1ニュージーランド・ドル=75.43円、1イギリス・ポンド=147.81円、1イスラエル・シェケル=30.71円、1デンマーク・クローネ=17.32円、1ノルウェー・クローネ=13.55円、1スウェーデン・クローナ=12.49円、1メキシコ・ペソ=5.70円、1マレーシア・リンギット=27.12円、1南アフリカ・ランド=7.99円、1ポーランド・ズロチ=30.02円、1ユーロ=129.17円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年7月6日)、 (2018年9月6日)、 (2018年11月6日)現在

| 項 目 | 第 75 期 末 | 第 76 期 末 | 第 77 期 末 |
|------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| (A) 資 産 | 5,181,480,923円 | 5,109,773,053円 | 4,923,956,522円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 54,436,764 | 31,936,185 | 99,531,472 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 2,481,413,624 | 2,421,382,153 | 2,315,726,697 |
| 日経225インデックスファンド・マザーファンド(評価額) | 1,177,281,876 | 1,175,413,528 | 1,166,623,479 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 1,418,348,659 | 1,381,041,187 | 1,342,074,874 |
| 未 収 入 金 | 50,000,000 | 100,000,000 | — |
| (B) 負 債 | 30,169,609 | 40,522,457 | 30,373,644 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 20,978,300 | 20,561,273 | 20,143,868 |
| 未 払 解 約 金 | 1,955 | 10,474,073 | 1,153,729 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 9,156,380 | 9,453,113 | 9,044,546 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 32,974 | 33,998 | 31,501 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 5,151,311,314 | 5,069,250,596 | 4,893,582,878 |
| 元 本 | 5,244,575,014 | 5,140,318,388 | 5,035,967,218 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △93,263,700 | △71,067,792 | △142,384,340 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 5,244,575,014口 | 5,140,318,388口 | 5,035,967,218口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 9,822円 | 9,862円 | 9,717円 |

(注) 第74期末における元本額は5,329,203,175円、当作作期間(第75期～第77期)中における追加設定元本額は21,058,344円、同解約元本額は314,294,301円です。

■損益の状況

〔自 2018年5月8日〕
〔至 2018年7月6日〕

〔自 2018年7月7日〕
〔至 2018年9月6日〕

〔自 2018年9月7日〕
〔至 2018年11月6日〕

| 項 目 | 第 75 期 | 第 76 期 | 第 77 期 |
|--------------------------|---------------|---------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △8,121円 | 29,327円 | 100,128円 |
| 受 取 利 息 | 49 | 49 | 63 |
| そ の 他 収 益 金 | - | 37,808 | 108,963 |
| 支 払 利 息 | △8,170 | △8,530 | △8,898 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 84,080,965 | 50,269,974 | △43,610,643 |
| 売 買 益 | 119,071,330 | 60,887,644 | 5,243,213 |
| 売 買 損 | △34,990,365 | △10,617,670 | △48,853,856 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △9,189,354 | △9,487,111 | △9,076,047 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 74,883,490 | 40,812,190 | △52,586,562 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △146,120,805 | △90,248,350 | △68,499,550 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △1,048,085 | △1,070,359 | △1,154,360 |
| (配 当 等 相 当 額) | (22,170,303) | (21,991,517) | (21,746,277) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△23,218,388) | (△23,061,876) | (△22,900,637) |
| (G) 合 計(D + E + F) | △72,285,400 | △50,506,519 | △122,240,472 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △20,978,300 | △20,561,273 | △20,143,868 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G + H) | △93,263,700 | △71,067,792 | △142,384,340 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △1,048,085 | △1,070,359 | △1,154,360 |
| (配 当 等 相 当 額) | (22,175,209) | (22,002,238) | (21,752,655) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△23,223,294) | (△23,072,597) | (△22,907,015) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 176,754,528 | 173,559,394 | 168,145,766 |
| 繰 越 損 益 金 | △268,970,143 | △243,556,827 | △309,375,746 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 第 75 期 | 第 76 期 | 第 77 期 |
|-------------------------------|-------------|-------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 21,298,862円 | 21,136,907円 | 18,444,259円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 22,175,209 | 22,002,238 | 21,752,655 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 176,433,966 | 172,983,760 | 169,845,375 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d) | 219,908,037 | 216,122,905 | 210,042,289 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 419.31 | 420.45 | 417.08 |
| (g) 分 配 金 | 20,978,300 | 20,561,273 | 20,143,868 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 40 | 40 | 40 |

■分配金のお知らせ

| 決 算 期 | 第 75 期 | 第 76 期 | 第 77 期 |
|-----------|--------|--------|--------|
| 1万口当たり分配金 | 40円 | 40円 | 40円 |

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

■約款変更のお知らせ

信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年8月8日)

■その他のお知らせ

当投資信託が組入れている親投資信託において保有しているオリンパス株式会社の株式について、同社による有価証券報告書等の虚偽記載により当投資信託が被った損失の回復を図るために提訴した損害賠償請求訴訟が和解により終結したため、2018年9月に当該和解金を計上いたしました。

(2018年9月11日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2018年2月21日）

（計算期間 2017年2月22日～2018年2月21日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | シティ世界国債インデックス | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|-----------------------------|-------|--------|--------|---------|
| | 円 | 期中騰落率 | （除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（ベンチマーク） | 期中騰落率 | | | |
| 11期（2014年2月21日） | 16,392 | 13.0% | 102,469.19 | 12.6% | 97.6% | - | 383,685 |
| 12期（2015年2月23日） | 18,820 | 14.8% | 117,697.87 | 14.9% | 97.5% | - | 345,838 |
| 13期（2016年2月22日） | 17,881 | △5.0% | 111,769.89 | △5.0% | 97.6% | - | 267,780 |
| 14期（2017年2月21日） | 17,364 | △2.9% | 108,792.68 | △2.7% | 97.9% | - | 248,485 |
| 15期（2018年2月21日） | 17,876 | 2.9% | 111,885.82 | 2.8% | 97.7% | - | 217,863 |

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

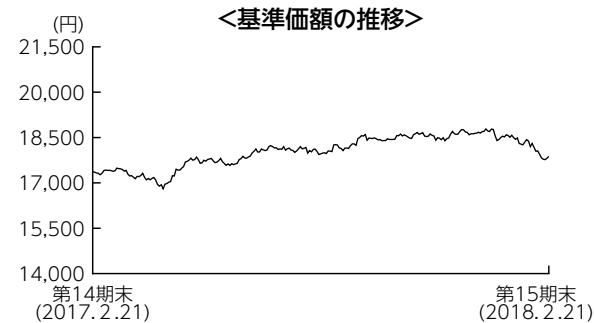
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2017年2月22日から2018年2月21日まで）

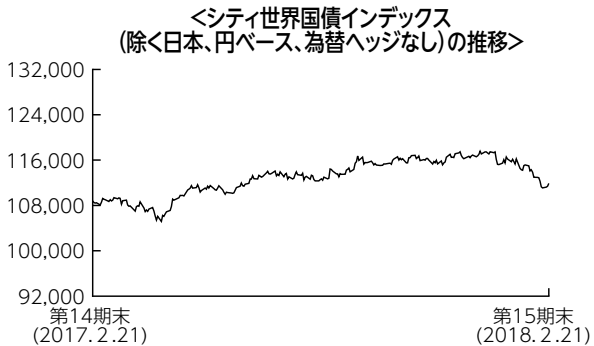


基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

ポートフォリオについて

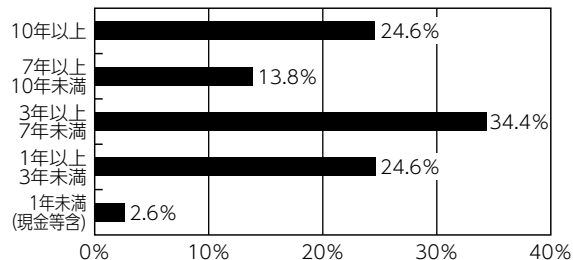
ベンチマークとリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

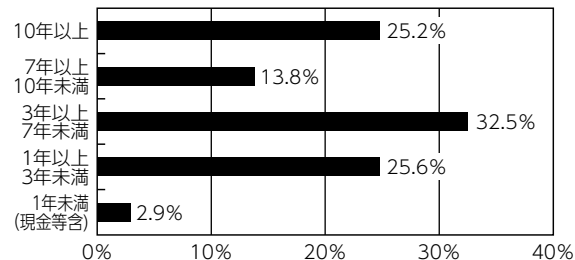
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

| 国 | 当ファンド | 世界国債 インデックス | 差 |
|---------------|---------|----------------|-------|
| 北米 | 米国 | 44.3% | △0.1% |
| | カナダ | 2.2% | △0.0% |
| | 計 | 46.4% | △0.2% |
| 中南米 | メキシコ | 0.8% | △0.0% |
| | 計 | 0.8% | △0.0% |
| 欧州 | オーストリア | 1.4% | △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% |
| | 英国 | 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 | 41.9% | △0.6% |
| | カナダ | 2.1% | △0.1% |
| | 計 | 43.4% | △0.7% |
| 中南米 | メキシコ | 0.8% | △0.0% |
| | 計 | 0.8% | △0.0% |
| 欧州 | オーストリア | 1.6% | △0.1% |
| | ベルギー | 2.5% | △0.1% |
| | フィンランド | 0.6% | △0.0% |
| | フランス | 10.3% | △0.2% |
| | ドイツ | 7.1% | △0.2% |
| | アイルランド | 0.8% | △0.1% |
| | イタリア | 10.0% | △0.2% |
| | オランダ | 2.1% | △0.1% |
| | スペイン | 5.9% | △0.1% |
| | ユーロ計 | 40.9% | △1.0% |
| | デンマーク | 0.6% | △0.0% |
| スウェーデン | 0.5% | △0.0% | |
| スイス | 0.0% | △0.2% | |
| 英国 | 7.0% | △0.2% | |
| ポーランド | 0.7% | △0.0% | |
| ノルウェー | 0.3% | △0.0% | |
| | 計 | 49.9% | △1.5% |
| アジア・ オセアニア | オーストラリア | 2.2% | △0.1% |
| | シンガポール | 0.4% | △0.0% |
| | マレーシア | 0.4% | △0.1% |
| | 計 | 2.9% | △0.2% |
| アフリカ | 南アフリカ | 0.6% | △0.0% |
| | 計 | 0.6% | △0.0% |
| 現金など | 2.3% | - | - |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | - |

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.8%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(18,042円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2017年2月22日から2018年2月21日まで)
公社債

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

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等 (2017年2月22日から2018年2月21日まで)
期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|-----------------------------|------|---------|--------------|--------------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ノルウェー) | | % | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| NORWAY 1.75 02/17/27 | 国債証券 | 1.7500 | 500 | 493 | 6,776 | 2027/02/17 |
| NORWAY 3.0 03/14/24 | 国債証券 | 3.0000 | 7,400 | 8,012 | 109,936 | 2024/03/14 |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国債証券 | 1.7500 | 3,800 | 3,810 | 52,278 | 2025/03/13 |
| NORWAY 4.5 05/22/19 | 国債証券 | 4.5000 | 6,560 | 6,876 | 94,350 | 2019/05/22 |
| NORWAY 2.0 05/24/23 | 国債証券 | 2.0000 | 7,600 | 7,815 | 107,223 | 2023/05/24 |
| NORWAY 3.75 05/25/21 | 国債証券 | 3.7500 | 11,500 | 12,475 | 171,159 | 2021/05/25 |
| 小計 | — | — | 43,360 | 45,354 | 622,265 | — |
| (スウェーデン) | | % | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | |
| SWEDEN 4.25 03/12/19 | 国債証券 | 4.2500 | 8,800 | 9,268 | 123,079 | 2019/03/12 |
| SWEDEN 3.5 03/30/39 | 国債証券 | 3.5000 | 6,200 | 8,329 | 110,613 | 2039/03/30 |
| SWEDEN 2.5 05/12/25 | 国債証券 | 2.5000 | 10,300 | 11,771 | 156,319 | 2025/05/12 |
| SWEDEN 3.5 06/01/22 | 国債証券 | 3.5000 | 12,870 | 14,822 | 196,846 | 2022/06/01 |
| SWEDEN 1.5 11/13/23 | 国債証券 | 1.5000 | 9,700 | 10,382 | 137,884 | 2023/11/13 |
| SWEDEN 1.0 11/12/26 | 国債証券 | 1.0000 | 7,000 | 7,171 | 95,232 | 2026/11/12 |
| SWEDEN 5.0 12/01/20 | 国債証券 | 5.0000 | 11,410 | 13,136 | 174,458 | 2020/12/01 |
| 小計 | — | — | 66,280 | 74,882 | 994,434 | — |
| (メキシコ) | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 国債証券 | 5.7500 | 5,000 | 4,417 | 25,401 | 2026/03/05 |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 国債証券 | 8.5000 | 31,000 | 32,705 | 188,059 | 2029/05/31 |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 国債証券 | 7.7500 | 10,000 | 9,955 | 57,242 | 2031/05/29 |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 10,000 | 9,852 | 56,649 | 2027/06/03 |
| MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22 | 国債証券 | 6.5000 | 26,000 | 24,902 | 143,186 | 2022/06/09 |
| MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21 | 国債証券 | 6.5000 | 38,000 | 36,733 | 211,215 | 2021/06/10 |
| MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 | 国債証券 | 8.0000 | 30,000 | 30,232 | 173,835 | 2020/06/11 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 国債証券 | 7.7500 | 22,000 | 21,673 | 124,622 | 2042/11/13 |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47 | 国債証券 | 8.0000 | 5,000 | 5,046 | 29,016 | 2047/11/07 |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 国債証券 | 8.5000 | 15,000 | 15,951 | 91,721 | 2038/11/18 |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 国債証券 | 10.0000 | 13,000 | 15,722 | 90,404 | 2036/11/20 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 国債証券 | 7.7500 | 7,000 | 6,944 | 39,929 | 2034/11/23 |
| MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 国債証券 | 10.0000 | 35,000 | 39,314 | 226,056 | 2024/12/05 |
| MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23 | 国債証券 | 8.0000 | 14,000 | 14,212 | 81,721 | 2023/12/07 |
| MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19 | 国債証券 | 5.0000 | 26,000 | 24,838 | 142,821 | 2019/12/11 |
| 小計 | — | — | 287,000 | 292,501 | 1,681,884 | — |
| (マレーシア) | | % | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円 | |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27 | 国債証券 | 3.8920 | 800 | 779 | 21,447 | 2027/03/15 |
| MALAYSIA 3.48 03/15/23 | 国債証券 | 3.4800 | 1,220 | 1,200 | 33,057 | 2023/03/15 |
| MALAYSIA 3.492 03/31/20 | 国債証券 | 3.4920 | 2,200 | 2,205 | 60,717 | 2020/03/31 |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26 | 国債証券 | 4.3920 | 3,070 | 3,116 | 85,791 | 2026/04/15 |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 国債証券 | 4.4980 | 1,800 | 1,803 | 49,646 | 2030/04/15 |
| MALAYSIA 4.127 04/15/32 | 国債証券 | 4.1270 | 1,850 | 1,766 | 48,632 | 2032/04/15 |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 国債証券 | 3.8440 | 1,210 | 1,124 | 30,963 | 2033/04/15 |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 国債証券 | 3.5020 | 2,570 | 2,419 | 66,596 | 2027/05/31 |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28 | 国債証券 | 3.7330 | 2,000 | 1,937 | 53,350 | 2028/06/15 |
| MALAYSIA 4.16 07/15/21 | 国債証券 | 4.1600 | 5,500 | 5,618 | 154,679 | 2021/07/15 |
| MALAYSIA 4.181 07/15/24 | 国債証券 | 4.1810 | 1,430 | 1,447 | 39,840 | 2024/07/15 |
| MALAYSIA 3.418 08/15/22 | 国債証券 | 3.4180 | 3,000 | 2,954 | 81,337 | 2022/08/15 |
| MALAYSIA 5.248 09/15/28 | 国債証券 | 5.2480 | 1,600 | 1,717 | 47,280 | 2028/09/15 |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 国債証券 | 4.9350 | 1,500 | 1,526 | 42,029 | 2043/09/30 |

| 銘柄 | 種類 | 利率 | 額面金額 | 期 | | 償還年月日 |
|-----------------------------|------|---------|--------------|--------------|-----------|------------|
| | | | | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (マレーシア) | | % | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円 | |
| MALAYSIA 4.378 11/29/19 | 国債証券 | 4.3780 | 3,680 | 3,745 | 103,117 | 2019/11/29 |
| 小計 | — | — | 33,430 | 33,363 | 918,489 | — |
| (南アフリカ) | | % | 千南アフリカ・ランド | 千南アフリカ・ランド | 千円 | |
| SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30 | 国債証券 | 8.0000 | 13,110 | 12,597 | 115,522 | 2030/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44 | 国債証券 | 8.7500 | 10,000 | 9,622 | 88,233 | 2044/01/31 |
| SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40 | 国債証券 | 9.0000 | 8,000 | 7,924 | 72,663 | 2040/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37 | 国債証券 | 8.5000 | 10,910 | 10,394 | 95,317 | 2037/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48 | 国債証券 | 8.7500 | 17,000 | 16,383 | 150,234 | 2048/02/28 |
| SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41 | 国債証券 | 6.5000 | 11,760 | 8,836 | 81,028 | 2041/02/28 |
| SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23 | 国債証券 | 7.7500 | 10,000 | 10,134 | 92,929 | 2023/02/28 |
| SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31 | 国債証券 | 7.0000 | 11,600 | 10,118 | 92,788 | 2031/02/28 |
| SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35 | 国債証券 | 8.8750 | 3,000 | 2,981 | 27,339 | 2035/02/28 |
| SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32 | 国債証券 | 8.2500 | 10,000 | 9,614 | 88,164 | 2032/03/31 |
| SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36 | 国債証券 | 6.2500 | 14,700 | 11,184 | 102,563 | 2036/03/31 |
| SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21 | 国債証券 | 6.7500 | 10,160 | 10,087 | 92,505 | 2021/03/31 |
| SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26 | 国債証券 | 10.5000 | 25,000 | 28,743 | 263,580 | 2026/12/21 |
| 小計 | — | — | 155,240 | 148,622 | 1,362,871 | — |
| (ポーランド) | | % | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | |
| POLAND 5.75 04/25/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,440 | 1,761 | 56,309 | 2029/04/25 |
| POLAND 1.5 04/25/20 | 国債証券 | 1.5000 | 3,000 | 2,989 | 95,583 | 2020/04/25 |
| POLAND 2.25 04/25/22 | 国債証券 | 2.2500 | 4,000 | 3,964 | 126,754 | 2022/04/25 |
| POLAND 2.5 07/25/26 | 国債証券 | 2.5000 | 4,200 | 3,954 | 126,425 | 2026/07/25 |
| POLAND 3.25 07/25/25 | 国債証券 | 3.2500 | 4,700 | 4,713 | 150,702 | 2025/07/25 |
| POLAND 2.5 07/25/27 | 国債証券 | 2.5000 | 2,300 | 2,133 | 68,207 | 2027/07/25 |
| POLAND 1.75 07/25/21 | 国債証券 | 1.7500 | 2,200 | 2,170 | 69,391 | 2021/07/25 |
| POLAND 3.25 07/25/19 | 国債証券 | 3.2500 | 2,500 | 2,562 | 81,921 | 2019/07/25 |
| POLAND 5.75 09/23/22 | 国債証券 | 5.7500 | 3,200 | 3,639 | 116,350 | 2022/09/23 |
| POLAND 5.25 10/25/20 | 国債証券 | 5.2500 | 6,890 | 7,499 | 239,745 | 2020/10/25 |
| POLAND 5.75 10/25/21 | 国債証券 | 5.7500 | 3,680 | 4,126 | 131,932 | 2021/10/25 |
| POLAND 4.0 10/25/23 | 国債証券 | 4.0000 | 3,100 | 3,284 | 105,018 | 2023/10/25 |
| POLAND 5.5 10/25/19 | 国債証券 | 5.5000 | 2,690 | 2,856 | 91,331 | 2019/10/25 |
| 小計 | — | — | 43,900 | 45,657 | 1,459,674 | — |
| (ユーロ…アイルランド) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| IRISH 2.0 02/18/45 | 国債証券 | 2.0000 | 890 | 918 | 121,816 | 2045/02/18 |
| IRISH 3.4 03/18/24 | 国債証券 | 3.4000 | 930 | 1,093 | 145,083 | 2024/03/18 |
| IRISH 5.4 03/13/25 | 国債証券 | 5.4000 | 1,260 | 1,669 | 221,532 | 2025/03/13 |
| IRISH 3.9 03/20/23 | 国債証券 | 3.9000 | 700 | 829 | 110,004 | 2023/03/20 |
| IRISH 0.8 03/15/22 | 国債証券 | 0.8000 | 1,150 | 1,185 | 157,336 | 2022/03/15 |
| IRISH 4.5 04/18/20 | 国債証券 | 4.5000 | 1,130 | 1,250 | 165,923 | 2020/04/18 |
| IRISH 2.4 05/15/30 | 国債証券 | 2.4000 | 1,100 | 1,236 | 164,030 | 2030/05/15 |
| IRISH 1.0 05/15/26 | 国債証券 | 1.0000 | 1,350 | 1,363 | 180,940 | 2026/05/15 |
| IRISH 1.7 05/15/37 | 国債証券 | 1.7000 | 750 | 753 | 99,960 | 2037/05/15 |
| IRISH 4.4 06/18/19 | 国債証券 | 4.4000 | 480 | 511 | 67,810 | 2019/06/18 |
| IRISH 5.0 10/18/20 | 国債証券 | 5.0000 | 1,000 | 1,143 | 151,681 | 2020/10/18 |
| IRISH 5.9 10/18/19 | 国債証券 | 5.9000 | 950 | 1,051 | 139,487 | 2019/10/18 |
| 小計 | — | — | 11,690 | 13,006 | 1,725,608 | — |
| (ユーロ…オランダ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 国債証券 | 3.7500 | 1,800 | 2,702 | 358,581 | 2042/01/15 |

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

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

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

| 銘 | 柄 | 当 | | | | 期 | | 末 | | | | | | | | | |
|-------------------|----------|---|---|---|---|--------|--------|---|--------|----|---|------------|---|---|---|---|------------|
| | | 種 | 類 | 利 | 率 | 額 | 面 | 金 | 額 | | 償 | 還 | 年 | 月 | 日 | | |
| | | | | | | | | | 外 | 貨 | | | | | | 建 | 金 |
| (ユーロ…スペイン) | | | | % | | 千 | ユー | ロ | 千 | ユー | ロ | 千 | 円 | | | | |
| SPAIN 4.7 | 07/30/41 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7000 | 2,100 | | 2,955 | | | 392,153 | | | | | 2041/07/30 |
| SPAIN 3.45 | 07/30/66 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.4500 | 950 | | 1,077 | | | 142,960 | | | | | 2066/07/30 |
| SPAIN 4.65 | 07/30/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6500 | 2,600 | | 3,270 | | | 433,885 | | | | | 2025/07/30 |
| SPAIN 1.95 | 07/30/30 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.9500 | 2,700 | | 2,736 | | | 363,098 | | | | | 2030/07/30 |
| SPAIN 5.75 | 07/30/32 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500 | 2,400 | | 3,557 | | | 471,937 | | | | | 2032/07/30 |
| SPAIN 2.35 | 07/30/33 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3500 | 1,000 | | 1,031 | | | 136,782 | | | | | 2033/07/30 |
| SPAIN 4.6 | 07/30/19 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.6000 | 4,100 | | 4,391 | | | 582,670 | | | | | 2019/07/30 |
| SPAIN 0.75 | 07/30/21 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500 | 1,700 | | 1,738 | | | 230,676 | | | | | 2021/07/30 |
| SPAIN 1.15 | 07/30/20 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.1500 | 2,100 | | 2,163 | | | 287,093 | | | | | 2020/07/30 |
| SPAIN 2.75 | 10/31/24 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 2,700 | | 3,027 | | | 401,656 | | | | | 2024/10/31 |
| SPAIN 5.15 | 10/31/28 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.1500 | 2,100 | | 2,821 | | | 374,308 | | | | | 2028/10/31 |
| SPAIN 5.15 | 10/31/44 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.1500 | 1,500 | | 2,249 | | | 298,491 | | | | | 2044/10/31 |
| SPAIN 2.9 | 10/31/46 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.9000 | 1,800 | | 1,899 | | | 252,062 | | | | | 2046/10/31 |
| SPAIN 4.85 | 10/31/20 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.8500 | 2,900 | | 3,283 | | | 435,602 | | | | | 2020/10/31 |
| SPAIN 2.15 | 10/31/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1500 | 2,600 | | 2,793 | | | 370,584 | | | | | 2025/10/31 |
| SPAIN 1.45 | 10/31/27 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.4500 | 1,400 | | 1,390 | | | 184,512 | | | | | 2027/10/31 |
| SPAIN 1.3 | 10/31/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3000 | 2,600 | | 2,590 | | | 343,634 | | | | | 2026/10/31 |
| SPAIN 4.4 | 10/31/23 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.4000 | 2,300 | | 2,783 | | | 369,245 | | | | | 2023/10/31 |
| SPAIN 4.3 | 10/31/19 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3000 | 4,200 | | 4,525 | | | 600,431 | | | | | 2019/10/31 |
| 小 | 計 | - | - | - | - | - | 83,630 | | 97,575 | | | 12,945,318 | | | | | - |
| (ユーロ…イタリア) | | | | % | | 千 | ユー | ロ | 千 | ユー | ロ | 千 | 円 | | | | |
| ITALY BTPS 4.5 | 02/01/20 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 4,500 | | 4,898 | | | 649,898 | | | | | 2020/02/01 |
| ITALY BTPS 5.75 | 02/01/33 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500 | 2,400 | | 3,342 | | | 443,478 | | | | | 2033/02/01 |
| ITALY BTPS 4.0 | 02/01/37 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 3,500 | | 4,137 | | | 548,948 | | | | | 2037/02/01 |
| ITALY BTPS 2.7 | 03/01/47 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7000 | 1,650 | | 1,537 | | | 203,954 | | | | | 2047/03/01 |
| ITALY BTPS 3.45 | 03/01/48 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.4500 | 250 | | 264 | | | 35,095 | | | | | 2048/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 | 03/01/24 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 3,700 | | 4,393 | | | 582,874 | | | | | 2024/03/01 |
| ITALY BTPS 2.8 | 03/01/67 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8000 | 1,400 | | 1,246 | | | 165,381 | | | | | 2067/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 | 03/01/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000 | 2,400 | | 2,954 | | | 391,963 | | | | | 2025/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 | 03/01/19 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 5,100 | | 5,356 | | | 710,623 | | | | | 2019/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 | 03/01/22 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000 | 4,400 | | 5,175 | | | 686,604 | | | | | 2022/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 | 03/01/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 2,900 | | 3,495 | | | 463,730 | | | | | 2026/03/01 |
| ITALY BTPS 4.25 | 03/01/20 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500 | 4,600 | | 5,004 | | | 663,925 | | | | | 2020/03/01 |
| ITALY BTPS 3.75 | 03/01/21 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | 3,300 | | 3,652 | | | 484,542 | | | | | 2021/03/01 |
| ITALY BTPS 1.65 | 03/01/32 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6500 | 2,800 | | 2,530 | | | 335,717 | | | | | 2032/03/01 |
| ITALY BTPS 3.5 | 03/01/30 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 | 2,950 | | 3,292 | | | 436,834 | | | | | 2030/03/01 |
| ITALY BTPS 0.95 | 03/15/23 | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.9500 | 2,500 | | 2,502 | | | 331,973 | | | | | 2023/03/15 |
| ITALY BTPS 1.35 | 04/15/22 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3500 | 2,500 | | 2,572 | | | 341,323 | | | | | 2022/04/15 |
| ITALY BTPS 6.0 | 05/01/31 | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.0000 | 3,700 | | 5,182 | | | 687,574 | | | | | 2031/05/01 |
| ITALY BTPS 4.5 | 05/01/23 | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 1,400 | | 1,650 | | | 218,910 | | | | | 2023/05/01 |
| ITALY BTPS 3.75 | 05/01/21 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | 2,300 | | 2,552 | | | 338,614 | | | | | 2021/05/01 |
| ITALY BTPS 1.85 | 05/15/24 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8500 | 600 | | 618 | | | 82,109 | | | | | 2024/05/15 |
| ITALY BTPS 1.6 | 06/01/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6000 | 1,500 | | 1,473 | | | 195,502 | | | | | 2026/06/01 |
| ITALY BTPS 1.5 | 06/01/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 2,500 | | 2,480 | | | 329,131 | | | | | 2025/06/01 |
| ITALY BTPS 2.2 | 06/01/27 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2000 | 2,800 | | 2,843 | | | 377,271 | | | | | 2027/06/01 |
| ITALY BTPS 3.75 | 08/01/21 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | 3,200 | | 3,570 | | | 473,663 | | | | | 2021/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 | 08/01/34 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000 | 2,800 | | 3,675 | | | 487,673 | | | | | 2034/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 | 08/01/39 | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000 | 3,000 | | 3,990 | | | 529,353 | | | | | 2039/08/01 |

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

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

■投資信託財産の構成

2018年2月21日現在

| 項 目 | 期 間 | |
|-------------------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 212,805,760 | % 97.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 5,129,614 | 2.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 217,935,374 | 100.0 |

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年2月21日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 218,310,227,233円 |
| コ ー ル ・ 公 司 等 | 3,270,760,374 |
| 未 収 入 金 | 374,880,520 |
| 未 収 利 息 | 1,828,216,079 |
| 前 払 費 用 | 30,610,131 |
| (B) 負 債 | 447,097,960 |
| 未 払 金 | 374,852,960 |
| 未 払 解 約 金 | 72,245,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 217,863,129,273 |
| 元 本 | 121,875,729,918 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 95,987,399,355 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 121,875,729,918口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 17,876円 |

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

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

D I AM DC バランス・F (成長型) 119,784,654円
 クルーズコントロール<DC年金> 175,031円
 D I AMコア資産設計ファンド (堅実型) 1,547,650円
 D I AMコア資産設計ファンド (積極型) 4,761,061円
 ダイナミック・ナビゲーション 116,328円
 D I AMパッシブ資産分散ファンド 1,427,367,462円
 D I AM海唇フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) 6,984,591,409円
 D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け) 4,074,076,473円
 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) 3,765,907,771円
 先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) 576,382,992円
 D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 107,448,126円
 D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 971,191,594円
 D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 712,187,045円
 D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 57,495,581円
 D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 107,057,634円
 D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 26,555,966円
 D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 12,520,379円
 D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 72,192,093円
 D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 85,457,559円
 D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 3,803,080,276円
 D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 2,505,827,352円
 D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 4,224,822,451円
 D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) 766,253,872円
 D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) 516,627,848円
 D I AMアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 3,600,829,521円
 D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) 9,268,529,264円
 D I AMグローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け) 13,975,529円
 D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 85,144,612円
 D I AM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定) 3,043,371,686円
 D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 15,217,078,121円
 D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 19,907,287,350円
 D I AMバランス30VA (適格機関投資家限定) 2,361,904円
 D I AMバランス50VA (適格機関投資家限定) 34,508,457円
 D I AMバランス70VA (適格機関投資家限定) 5,621,656円
 D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定) 17,709,441,950円
 D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 107,900,809円
 D I AMバランス20VA (適格機関投資家限定) 83,137,353円
 D I AMバランス40VA (適格機関投資家限定) 59,633,095円
 D I AMバランス60VA (適格機関投資家限定) 165,250円
 期末元本合計 121,875,729,918円

■損益の状況

当期 自2017年2月22日 至2018年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

日経225インデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2018年11月6日）

（計算期間 2017年11月7日～2018年11月6日）

日経225インデックスファンド・マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 2005年12月28日から無期限です。 |
| 運用方針 | 日経平均株価（日経225）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 | わが国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 | | 日経平均株価 | | 株式組入率 | 株式先物率 | 純資産額 |
|------------------|--------|------|-----------|-------|-------|-------|--------|
| | 円 | 騰落率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | | |
| 9期 (2014年11月6日) | 円 | % | 円 | % | % | % | 百万円 |
| | 12,097 | 18.9 | 16,792.48 | 17.1 | 73.4 | 22.1 | 3,495 |
| 10期 (2015年11月6日) | 14,091 | 16.5 | 19,265.60 | 14.7 | 78.2 | 21.5 | 3,139 |
| 11期 (2016年11月7日) | 12,818 | △9.0 | 17,177.21 | △10.8 | 79.9 | 19.8 | 3,923 |
| 12期 (2017年11月6日) | 17,123 | 33.6 | 22,548.35 | 31.3 | 82.0 | 17.4 | 5,185 |
| 13期 (2018年11月6日) | 17,121 | △0.0 | 22,147.75 | △1.8 | 89.7 | 10.2 | 11,997 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

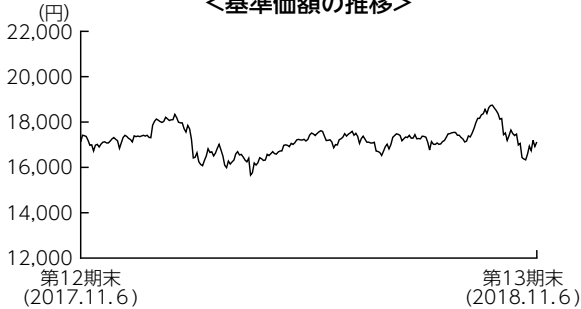
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 日 経 平 均 株 価 | | 株式組入率 比 | 株式先物率 比 |
|---------------------|-------------|--------|----------------|--------|------------|------------|
| | | 騰 落 率 | (ベンチマーク) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2017年11月6日 | 円 17,123 | % - | 円 22,548.35 | % - | % 82.0 | % 17.4 |
| 11 月 末 | 17,257 | 0.8 | 22,724.96 | 0.8 | 78.4 | 18.7 |
| 12 月 末 | 17,308 | 1.1 | 22,764.94 | 1.0 | 91.0 | 8.9 |
| 2018年1 月 末 | 17,560 | 2.6 | 23,098.29 | 2.4 | 82.5 | 17.2 |
| 2 月 末 | 16,772 | △2.0 | 22,068.24 | △2.1 | 88.7 | 11.2 |
| 3 月 末 | 16,427 | △4.1 | 21,454.30 | △4.9 | 86.8 | 13.2 |
| 4 月 末 | 17,210 | 0.5 | 22,467.87 | △0.4 | 87.3 | 12.4 |
| 5 月 末 | 17,003 | △0.7 | 22,201.82 | △1.5 | 83.1 | 15.7 |
| 6 月 末 | 17,106 | △0.1 | 22,304.51 | △1.1 | 84.2 | 15.6 |
| 7 月 末 | 17,291 | 1.0 | 22,553.72 | 0.0 | 92.7 | 7.1 |
| 8 月 末 | 17,538 | 2.4 | 22,865.15 | 1.4 | 89.0 | 10.9 |
| 9 月 末 | 18,626 | 8.8 | 24,120.04 | 7.0 | 88.5 | 11.3 |
| 10 月 末 | 16,936 | △1.1 | 21,920.46 | △2.8 | 80.8 | 19.1 |
| (期 末) 2018年11月6日 | 17,121 | △0.0 | 22,147.75 | △1.8 | 89.7 | 10.2 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2017年11月7日から2018年11月6日まで）

<基準価額の推移>



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は17,121円となり、前期末に比べ0.01%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米国における長期金利の上昇、米中対立の激化、世界景気の先行きへの警戒などを受けて国内株式市場が下落したことから、基準価額は下落しました。

投資環境

国内株式市場は上昇と下落を繰り返す振れ幅の大きい相場展開となりました。国内企業業績の好調さ、日銀の金融緩和政策の継続や良好な米国経済指標などを背景に上昇する局面がありました。一方、米国における長期金利の上昇、米中対立の激化、世界景気の先行きへの警戒などを受けて下落する局面もありました。これらの結果、日経平均株価は期末を22,147.75円で迎えました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。具体的には、日経平均株価の計算手法に合わせて、現物株式では原則として日経平均株価の採用銘柄に等株数投資を行いました。

また、ベンチマークとの連動性を維持するため、日経平均株価指数先物取引を積極的に活用し、株式実質組入比率を高位に保つように努めました。その結果、ファンドの投資成果がほぼ日経平均株価に連動する運用を行うことが出来ました。

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1.8%下落しました。

当ファンドはベンチマークを1.8%上回りました。その差は、主に保有株式の配当金計上によるものです。

今後の運用方針

引き続き、日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行います。原則として日経平均株価の計算手法に合わせて等株数投資を行います。日経平均株価指数先物取引を積極的に活用して株式実質組入比率を高位に保ちます。最適な取引手法の選択により運用の効率性を高め、取引コストを最小限に抑制することで、日経平均株価と同等の騰落率を実現するように努めます。日経平均株価の構成銘柄が変更される場合にも、指数算出基準に則り適切に対処していく方針です。

■ 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) | 1円 (0) (1) | 0.007% (0.000) (0.007) |
| (b) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 0 (0) | 0.000 (0.000) |
| 合 計 | 1 | 0.007 |

(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(17,192円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2017年11月7日から2018年11月6日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---------|--|--------------------|------------------|-------|-----------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 国 内 上 場 | | 2,226.3 (△89.5) | 7,754,077 (-) | 347.6 | 1,250,597 |

(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 |
| | | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 国 内 | 株 式 先 物 取 引 | 18,032 | 17,677 | - | - |

(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 | 9,004,675千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 6,781,735千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 1.32 |

(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11月7日から2018年11月6日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 区 分 | 当 期 | | | 期 | | |
|-----|--------------|--------------------|-----------|--------------|--------------------|--------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 株 式 | 百万円 7,754 | 百万円 3,580 | % 46.2 | 百万円 1,250 | 百万円 - | % - |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | 期 |
|-----|----------|--------------|-------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
| 株 式 | 百万円 2 | 百万円 0.391 | 百万円 3 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|-----|----------|
| | 買 付 額 |
| 株 式 | 百万円 1 |

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 519千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 0.123千円 |
| (B)／(A) | 0.0% |

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、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-----|---------|---|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 水産・農林業 (0.2%) | | | | |
| 日本水産 | 7 | 18 | 12,744 | |
| マルハニチロ | 0.7 | 1.8 | 7,281 | |
| 鉱業 (0.1%) | | | | |
| 国際石油開発帝石 | 2.8 | 7.2 | 9,291 | |
| 建設業 (2.5%) | | | | |
| コムシスホールディングス | 7 | 18 | 54,540 | |
| 大成建設 | 1.4 | 3.6 | 18,432 | |
| 大林組 | 7 | 18 | 18,900 | |
| 清水建設 | 7 | 18 | 17,082 | |
| 長谷工コーポレーション | 1.4 | 3.6 | 5,220 | |
| 鹿島建設 | 7 | 9 | 13,770 | |
| 大和ハウス工業 | 7 | 18 | 61,506 | |
| 積水ハウス | 7 | 18 | 30,294 | |
| 日揮 | 7 | 18 | 38,070 | |
| 千代田化工建設 | 7 | 18 | 7,524 | |
| 食料品 (4.6%) | | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 7 | 18 | 40,374 | |
| 明治ホールディングス | 1.4 | 3.6 | 27,684 | |
| 日本ハム | 7 | 9 | 36,180 | |
| サッポロホールディングス | 1.4 | 3.6 | 8,614 | |
| アサヒグループホールディングス | 7 | 18 | 92,718 | |
| キリンホールディングス | 7 | 18 | 48,456 | |
| 宝ホールディングス | 7 | 18 | 29,142 | |
| キッコーマン | 7 | 18 | 106,920 | |
| 味の素 | 7 | 18 | 33,264 | |
| ニチレイ | 3.5 | 9 | 23,427 | |
| 日本たばこ産業 | 7 | 18 | 51,228 | |
| 繊維製品 (0.2%) | | | | |
| 東洋紡 | 0.7 | 1.8 | 2,919 | |
| ユニチカ | 0.7 | 1.8 | 1,058 | |
| 帝人 | 1.4 | 3.6 | 7,034 | |
| 東レ | 7 | 18 | 14,666 | |
| パルプ・紙 (0.2%) | | | | |
| 王子ホールディングス | 7 | 18 | 13,356 | |
| 日本製紙 | 0.7 | 1.8 | 3,499 | |
| 化学 (8.4%) | | | | |
| クラレ | 7 | 18 | 28,530 | |
| 旭化成 | 7 | 18 | 22,635 | |
| 昭和電工 | 0.7 | 1.8 | 9,090 | |
| 住友化学 | 7 | 18 | 10,782 | |
| 日産化学 | 7 | 18 | 101,880 | |
| 東ソー | 3.5 | 9 | 13,914 | |
| トクヤマ | 1.4 | 3.6 | 9,626 | |
| デンカ | 1.4 | 3.6 | 13,266 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-----|---------|---|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 信越化学工業 | 7 | 18 | 176,544 | |
| 三井化学 | 1.4 | 3.6 | 10,119 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 3.5 | 9 | 8,362 | |
| 宇部興産 | 0.7 | 1.8 | 4,485 | |
| 日本化薬 | 7 | 18 | 24,858 | |
| 花王 | 7 | 18 | 137,646 | |
| 富士フィルムホールディングス | 7 | 18 | 87,498 | |
| 資生堂 | 7 | 18 | 136,350 | |
| 日東電工 | 7 | 18 | 113,256 | |
| 医薬品 (8.7%) | | | | |
| 協和発酵キリン | 7 | 18 | 39,654 | |
| 武田薬品工業 | 7 | 18 | 83,304 | |
| アステラス製薬 | 35 | 90 | 156,285 | |
| 大日本住友製薬 | 7 | 18 | 49,914 | |
| 塩野義製薬 | 7 | 18 | 130,932 | |
| 中外製薬 | 7 | 18 | 122,400 | |
| エーザイ | 7 | 18 | 180,720 | |
| 第一三共 | 7 | 18 | 77,274 | |
| 大塚ホールディングス | 7 | 18 | 100,350 | |
| 石油・石炭製品 (0.5%) | | | | |
| 昭和シェル石油 | 7 | 18 | 38,934 | |
| J X T Gホールディングス | 7 | 18 | 13,701 | |
| ゴム製品 (0.9%) | | | | |
| 横浜ゴム | 3.5 | 9 | 20,889 | |
| ブリヂストン | 7 | 18 | 78,588 | |
| ガラス・土石製品 (1.4%) | | | | |
| AGC | 1.4 | 3.6 | 13,536 | |
| 日本板硝子 | 0.7 | 1.8 | 1,812 | |
| 日本電気硝子 | 2.1 | 5.4 | 15,708 | |
| 住友大阪セメント | 7 | 1.8 | 7,803 | |
| 太平洋セメント | 0.7 | 1.8 | 5,976 | |
| 東海カーボン | 7 | 18 | 33,264 | |
| TOTO | 3.5 | 9 | 37,620 | |
| 日本硝子 | 7 | 18 | 30,240 | |
| 鉄鋼 (0.2%) | | | | |
| 新日鐵住金 | 0.7 | 1.8 | 3,965 | |
| 神戸製鋼所 | 0.7 | 1.8 | 1,807 | |
| ジェイエフイーホールディングス | 0.7 | 1.8 | 3,956 | |
| 日新製鋼 | 0.7 | 1.8 | 2,800 | |
| 大平洋金属 | 0.7 | 1.8 | 5,985 | |
| 非鉄金属 (1.0%) | | | | |
| 日本軽金属ホールディングス | 7 | 18 | 4,518 | |
| 三井金属鉱業 | 0.7 | 1.8 | 5,859 | |
| 東邦亜鉛 | 0.7 | 1.8 | 7,056 | |
| 三菱マテリアル | 0.7 | 1.8 | 5,832 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 住友金属鉱山 | 3.5 | 9 | 33,552 |
| DOWAホールディングス | 1.4 | 3.6 | 12,744 |
| 古河機械金属 | 0.7 | — | — |
| 古河電気工業 | 0.7 | 1.8 | 5,760 |
| 住友電気工業 | 7 | 18 | 28,584 |
| フジクラ | 7 | 18 | 8,982 |
| 金属製品 (0.4%) | | | |
| SUMCO | 0.7 | 1.8 | 2,916 |
| 東洋製鐵グループホールディングス | 7 | 18 | 42,228 |
| 機械 (4.9%) | | | |
| 日本製鋼所 | 1.4 | 3.6 | 9,478 |
| オークマ | 1.4 | 3.6 | 21,456 |
| アマダホールディングス | 7 | 18 | 19,980 |
| 小松製作所 | 7 | 18 | 56,448 |
| 住友重機械工業 | 1.4 | 3.6 | 12,906 |
| 日立建機 | 7 | 18 | 56,610 |
| クボタ | 7 | 18 | 32,274 |
| 荏原製作所 | 1.4 | 3.6 | 11,844 |
| ダイキン工業 | 7 | 18 | 237,870 |
| 日本精工 | 7 | 18 | 19,836 |
| NTN | 7 | 18 | 6,768 |
| ジェイテクト | 7 | 18 | 24,912 |
| 日立造船 | 1.4 | 3.6 | 1,486 |
| 三菱重工業 | 0.7 | 1.8 | 7,689 |
| IHI | 0.7 | 1.8 | 7,443 |
| 電気機器 (17.3%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 7 | 18 | 20,610 |
| コニカミノルタ | 7 | 18 | 19,368 |
| ミネベアミツミ | 7 | 18 | 31,410 |
| 日立製作所 | 7 | 3.6 | 12,556 |
| 三菱電機 | 7 | 18 | 26,523 |
| 富士電機 | 7 | 3.6 | 13,140 |
| 安川電機 | 7 | 18 | 62,460 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 7 | 3.6 | 8,715 |
| 日本電気 | 0.7 | 1.8 | 6,219 |
| 富士通 | 7 | 1.8 | 12,583 |
| 沖電気工業 | 0.7 | 1.8 | 2,757 |
| セイコーエプソン | 14 | 36 | 67,320 |
| パナソニック | 7 | 18 | 21,222 |
| ソニー | 7 | 18 | 109,620 |
| TDK | 7 | 18 | 180,360 |
| アルプス電気 | 7 | 18 | 46,764 |
| パイオニア | 7 | 18 | 1,728 |
| 横河電機 | 7 | 18 | 39,078 |
| アドバンテスト | 14 | 36 | 88,200 |
| カシオ計算機 | 7 | 18 | 31,392 |
| ファナック | 7 | 18 | 381,690 |
| 京セラ | 14 | 36 | 226,008 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 太陽誘電 | 7 | 18 | 45,900 |
| SCREENホールディングス | 1.4 | 3.6 | 21,852 |
| キヤノン | 10.5 | 27 | 87,750 |
| リコー | 7 | 18 | 20,610 |
| 東京エレクトロン | 7 | 18 | 280,890 |
| 輸送用機器 (5.5%) | | | |
| デンソー | 7 | 18 | 92,592 |
| 三井E&Sホールディングス | 0.7 | 1.8 | 2,505 |
| 川崎重工業 | 0.7 | 1.8 | 4,905 |
| 日産自動車 | 7 | 18 | 18,585 |
| いすゞ自動車 | 3.5 | 9 | 13,968 |
| トヨタ自動車 | 7 | 18 | 119,340 |
| 日野自動車 | 7 | 18 | 19,818 |
| 三菱自動車工業 | 0.7 | 1.8 | 1,305 |
| マツダ | 1.4 | 3.6 | 4,426 |
| 本田技研工業 | 14 | 36 | 119,412 |
| スズキ | 7 | 18 | 99,090 |
| SUBARU | 7 | 18 | 53,046 |
| ヤマハ発動機 | 7 | 18 | 41,778 |
| 精密機器 (3.2%) | | | |
| テルモ | 14 | 36 | 228,780 |
| ニコン | 7 | 18 | 35,910 |
| オリンパス | 7 | 18 | 67,680 |
| シチズン時計 | 7 | 18 | 12,132 |
| その他製品 (1.2%) | | | |
| 凸版印刷 | 7 | 9 | 14,598 |
| 大日本印刷 | 3.5 | 9 | 23,103 |
| ヤマハ | 7 | 18 | 94,680 |
| 電気・ガス業 (0.2%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 0.7 | 1.8 | 1,036 |
| 中部電力 | 0.7 | 1.8 | 2,853 |
| 関西電力 | 0.7 | 1.8 | 3,076 |
| 東京瓦斯 | 1.4 | 3.6 | 9,748 |
| 大阪瓦斯 | 1.4 | 3.6 | 7,362 |
| 陸運業 (2.2%) | | | |
| 東武鉄道 | 1.4 | 3.6 | 11,196 |
| 東京急行電鉄 | 3.5 | 9 | 16,650 |
| 小田急電鉄 | 3.5 | 9 | 21,024 |
| 京王電鉄 | 1.4 | 3.6 | 21,528 |
| 京成電鉄 | 3.5 | 9 | 30,915 |
| 東日本旅客鉄道 | 0.7 | 1.8 | 17,946 |
| 西日本旅客鉄道 | 0.7 | 1.8 | 13,602 |
| 東海旅客鉄道 | 0.7 | 1.8 | 38,376 |
| 日本通運 | 0.7 | 1.8 | 12,906 |
| ヤマトホールディングス | 7 | 18 | 51,075 |
| 海運業 (0.1%) | | | |
| 日本郵船 | 0.7 | 1.8 | 3,463 |
| 商船三井 | 0.7 | 1.8 | 5,041 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|--------------------------|-----------|-----------|-------------|---|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 |
| 川崎汽船 | 千株 0.7 | 千株 1.8 | 千円 2,968 | |
| 空運業 (0.1%) | | | | |
| ANAホールディングス | 0.7 | 1.8 | 6,946 | |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | | |
| 三菱倉庫 | 3.5 | 9 | 24,012 | |
| 情報・通信業 (10.1%) | | | | |
| ヤフー | 2.8 | 7.2 | 2,354 | |
| トレンドマイクロ | 7 | 18 | 118,440 | |
| スカパーJ SATホールディングス | 0.7 | 1.8 | 927 | |
| 日本電信電話 | 1.4 | 3.6 | 15,436 | |
| KDDI | 42 | 108 | 262,764 | |
| NTTドコモ | 0.7 | 1.8 | 4,546 | |
| 東宝 | 0.7 | 1.8 | 6,588 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 35 | 90 | 124,020 | |
| コナミホールディングス | 7 | 18 | 85,500 | |
| ソフトバンクグループ | 21 | 54 | 463,050 | |
| 卸売業 (2.3%) | | | | |
| 双日 | 0.7 | 1.8 | 743 | |
| 伊藤忠商事 | 7 | 18 | 37,584 | |
| 丸紅 | 7 | 18 | 16,099 | |
| 豊田通商 | 7 | 18 | 73,350 | |
| 三井物産 | 7 | 18 | 34,299 | |
| 住友商事 | 7 | 18 | 31,644 | |
| 三菱商事 | 7 | 18 | 57,672 | |
| 小売業 (14.4%) | | | | |
| J. フロント リテイリング | 3.5 | 9 | 14,139 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 7 | 18 | 24,930 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 7 | 18 | 89,748 | |
| ユニ・ファミー・マートホールディングス | 7 | 18 | 256,320 | |
| 高島屋 | 7 | 9 | 16,533 | |
| 丸井グループ | 7 | 18 | 44,298 | |
| イオン | 7 | 18 | 47,898 | |
| ファーストリテイリング | 7 | 18 | 1,051,920 | |
| 銀行業 (0.9%) | | | | |
| コンソルディア・フィナンシャルグループ | 7 | 18 | 9,576 | |
| 新生銀行 | 0.7 | 1.8 | 3,196 | |
| あおぞら銀行 | 0.7 | 1.8 | 7,083 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 7 | 18 | 12,193 | |
| りそなホールディングス | 0.7 | 1.8 | 1,105 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 0.7 | 1.8 | 8,274 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 0.7 | 1.8 | 8,033 | |
| 千葉銀行 | 7 | 18 | 13,338 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 7 | 3.6 | 10,458 | |
| 静岡銀行 | 7 | 18 | 18,234 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 7 | 18 | 3,522 | |
| 証券・商品先物取引業 (0.4%) | | | | |
| 大和証券グループ本社 | 7 | 18 | 11,741 | |
| 野村ホールディングス | 7 | 18 | 9,693 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------------|-------------------------|------------------------|------------------------|-----------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 |
| 松井証券 | 千株 7 | 千株 18 | 千円 21,816 | |
| 保険業 (1.0%) | | | | |
| SOMPOホールディングス | 1.8 | 4.5 | 21,847 | |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 2.1 | 5.4 | 18,835 | |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 1.4 | 3.6 | 9,802 | |
| 第一生命ホールディングス | 0.7 | 1.8 | 4,055 | |
| 東京海上ホールディングス | 3.5 | 9 | 49,815 | |
| T&Dホールディングス | 1.4 | 3.6 | 6,816 | |
| その他金融業 (0.3%) | | | | |
| クレディセゾン | 7 | 18 | 32,940 | |
| 不動産業 (1.6%) | | | | |
| 東急不動産ホールディングス | 7 | 18 | 11,628 | |
| 三井不動産 | 7 | 18 | 46,341 | |
| 三菱地所 | 7 | 18 | 32,742 | |
| 東京建物 | 3.5 | 9 | 11,106 | |
| 住友不動産 | 7 | 18 | 72,810 | |
| サービス業 (4.7%) | | | | |
| ディー・エヌ・エー | 2.1 | 5.4 | 10,535 | |
| 電通 | 7 | 18 | 96,840 | |
| サイバーエージェント | - | 3.6 | 18,756 | |
| 楽天 | 7 | 18 | 15,984 | |
| リクルートホールディングス | 21 | 54 | 162,540 | |
| 日本郵政 | 7 | 18 | 24,084 | |
| 東京ドーム | 3.5 | 9 | 8,982 | |
| セコム | 7 | 18 | 162,882 | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 > | 千株 2,217.7 225銘柄 | 千株 3,006.9 225銘柄 | 千円 10,761,015 <89.7%> |

(注1) 銘柄欄の () 内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(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。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(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 | 百万円 1,221 | 百万円 - |
| 日 経 2 2 5 | | |

■投資信託財産の構成

2018年11月6日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 10,761,015 | 81.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,477,762 | 18.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 13,238,778 | 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11月6日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 13,238,157,233円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 2,257,638,857 |
| 株 式(評価額) | 10,761,015,780 |
| 未 収 入 金 | 29,781,476 |
| 未 収 配 当 金 | 66,381,120 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 123,340,000 |
| (B) 負 債 | 1,240,360,990 |
| 未 払 金 | 1,216,701,990 |
| 未 払 解 約 金 | 23,659,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 11,997,796,243 |
| 元 本 | 7,007,457,342 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 4,990,338,901 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 7,007,457,342口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D) | 17,121円 |

(注1) 期首元本額 3,028,440,704円
追加設定元本額 7,516,315,906円
一部解約元本額 3,537,299,268円

(注2) 期末における元本の内訳
たわらノーロード 日経225 5,802,313,342円
日経225リスクコントロールオープン 483,010,549円
D I A M バランス・インカム・オープン (毎月分配型) 40,734,304円
D I A M パッシブ資産分散ファンド 681,399,147円
期末元本合計 7,007,457,342円

■損益の状況

当期 自2017年11月7日 至2018年11月6日

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 134,271,407円 |
| 受 取 配 当 金 | 133,399,410 |
| そ の 他 収 益 金 | 1,731,296 |
| 支 払 利 息 | △859,299 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 3,558,786 |
| 売 買 益 | 764,850,969 |
| 売 買 損 | △761,292,183 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | △38,147,934 |
| 取 引 益 | 232,425,636 |
| 取 引 損 | △270,573,570 |
| (D) そ の 他 費 用 | △1,172 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D) | 99,681,087 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 2,157,097,446 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △2,589,127,726 |
| (H) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 5,322,688,094 |
| (I) 合 計 (E+F+G+H) | 4,990,338,901 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I) | 4,990,338,901 |

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

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

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

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第11期（決算日 2018年6月22日）

（対象期間 2017年6月23日～2018年6月22日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

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

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

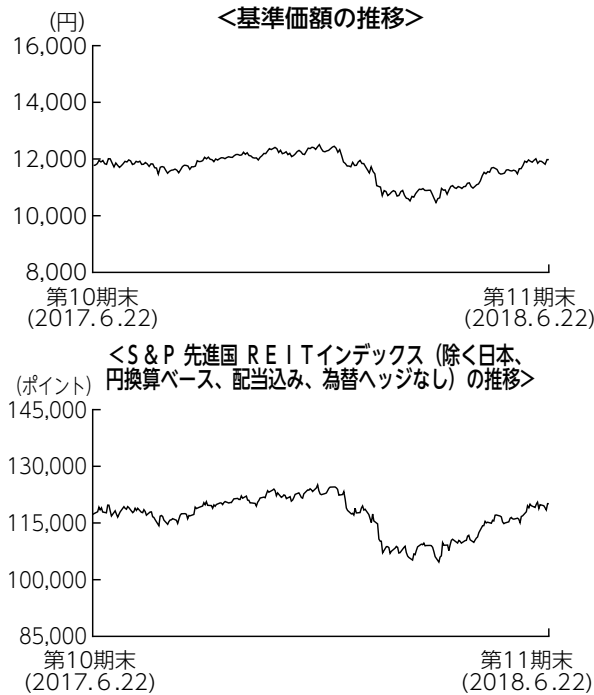
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2017年6月23日から2018年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は11,979円となり、前期末に比べ1.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(11,685円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2017年6月23日から2018年6月22日まで)

投資信託受益証券、投資証券

| | 買 | | 売 | |
|--------------------------------|----------------|---------------|---------------|--------------|
| | □ 数 | 金 付 額 | □ 数 | 金 付 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 35.568 (-) | 4,390 (-) | 23.082 (-) | 2,829 (-) |
| ALEXANDER'S INC. | 1.315 (-) | 520 (-) | 0.929 (-) | 342 (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | 48.246 (-) | 5,900 (-) | 35.714 (-) | 4,275 (-) |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 14.876 (-) | 71 (-) | 6.755 (-) | 31 (-) |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 2.1 (-) | 23 (-) | 21.54 (-) | 240 (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 60.744 (-) | 1,757 (-) | 43.308 (-) | 1,185 (-) |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 48.621 (-) | 2,038 (-) | 35.197 (-) | 1,452 (-) |
| AGREE REALTY CORP | 9.73 (-) | 474 (-) | 5.673 (-) | 268 (-) |
| SL GREEN | 31.168 (-) | 3,094 (-) | 28.52 (-) | 2,763 (-) |
| EPR PROPERTIES | 20.013 (-) | 1,258 (-) | 14.423 (-) | 866 (-) |
| PROLOGIS INC | 165.308 (-) | 10,354 (-) | 121.41 (-) | 7,613 (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 43.627 (-) | 7,526 (-) | 32.387 (-) | 5,447 (-) |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 63.299 (-) | 573 (-) | 46.286 (-) | 408 (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 31.241 (-) | 2,715 (-) | 21.935 (-) | 1,866 (-) |
| CBL & ASSOCIATES | 40.727 (-) | 254 (-) | 28.048 (-) | 156 (-) |
| MACK CALI | 27.595 (-) | 575 (-) | 19.639 (-) | 393 (-) |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 47.065 (-) | 1,885 (-) | 32.786 (-) | 1,283 (-) |
| COUSINS PROPERTIES INC | 132.374 (-) | 1,186 (-) | 97.362 (-) | 857 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|------------------------------|-----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 35.456 | 1,032 | 27.718 | 817 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 6.189 | 120 | 4.067 | 75 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DDR CORP | 83.402 | 738 | 62.964 | 504 |
| | (△61.545) | (-) | (-) | (-) |
| ISTAR INC | 17.531 | 194 | 12.866 | 134 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DUKE REALTY TRUST | 116.046 | 3,157 | 86.42 | 2,311 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 23.641 | 150 | 9.894 | 60 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 21.011 | 5,090 | 15.576 | 3,655 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | 116.119 | 7,296 | 86.195 | 5,303 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 24.222 | 2,952 | 17.899 | 2,116 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 38.704 | 1,173 | 26.083 | 782 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GGP INC | 215.503 | 4,672 | 147.743 | 3,181 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FELCOR LODGING TR INC | 4.23 | 31 | - | - |
| | (△47.1) | (-) | (-) | (-) |
| HCP INC | 150.101 | 3,837 | 112.127 | 2,746 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY COMMONWEALTH | 38.809 | 1,179 | 30.137 | 901 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 41.956 | 1,266 | 28.694 | 837 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 31.438 | 1,510 | 22.265 | 1,038 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 50.068 | 1,389 | 36.338 | 996 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WELLTOWER INC | 116.976 | 7,288 | 85.049 | 5,055 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EAST GROUP | 11.267 | 972 | 8.006 | 681 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIMCO REALTY | 136.14 | 2,303 | 100.97 | 1,610 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KILROY REALTY CORP | 30.471 | 2,182 | 22.236 | 1,549 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LTC PROPERTIES INC | 12.384 | 535 | 8.839 | 361 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SENIOR HOUSING PPTYS TRUST | 71.223 | 1,269 | 51.351 | 871 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 21.192 | 328 | 12.67 | 199 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 45.476 | 1,885 | 32.979 | 1,352 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 51.818 | 872 | 37.507 | 629 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | 100.888 | 3,593 | 65.736 | 2,267 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE MACERICH COMPANY | 35.031 | 2,044 | 29.753 | 1,738 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 29.798 | 2,597 | 20.166 | 1,730 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ACADIA REALTY TRUST | 23.844 | 627 | 18.904 | 472 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

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

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

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|----------|----------------|---------|----------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | | 千□ 千アメリカ・ドル | | 千□ 千アメリカ・ドル |
| STAG INDUSTRIAL INC | 30.512 | 793 | 19.604 | 489 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SELECT INCOME REIT | 17.116 | 369 | 11.794 | 249 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 62.86 | 786 | 51.797 | 628 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CYRUSONE INC | 34.229 | 1,929 | 19.132 | 1,076 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WP CAREY INC | 33.193 | 2,172 | 24.015 | 1,540 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 39.987 | 1,381 | 18.939 | 497 |
| | (7.694) | (213) | (-) | (-) |
| GLADSTONE LAND CORP | 6.522 | 85 | 0.996 | 11 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 66.838 | 1,882 | 45.082 | 1,219 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 16.074 | 1,131 | 11.828 | 849 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WHEELER REIT INC | - | - | 0.529 | 2 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 9.738 | 135 | 5.811 | 77 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GRAMERCY PROPERTY TRSUT | 50.351 | 1,347 | 34.113 | 862 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 137.042 | 1,100 | 122.264 | 993 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 59.94 | 1,023 | 35.753 | 577 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 26.252 | 768 | 14.554 | 420 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 85.043 | 1,781 | 55.045 | 1,121 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 28.487 | 280 | 11.76 | 107 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| JBG SMITH PROPERTIES | 28.557 | 966 | 20.845 | 695 |
| | (31.91) | (-) | (-) | (-) |
| MANULIFE US REAL ESTATE-RTS | - | - | 108.24 | 22 |
| | (108.24) | (-) | (-) | (-) |
| INVITATION HOMES INC | 69.605 | 1,557 | 57.488 | 1,262 |
| | (82.512) | (-) | (-) | (-) |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 8.96 | 101 | 3.207 | 34 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FOREST CITY REALTY TRUST INC | 97.419 | 2,269 | 59.084 | 1,326 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PARKWAY INC | 1.4 | 31 | 16.17 | 308 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| QTS REALTY TRUST INC | 14.765 | 680 | 9.839 | 460 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPIRIT MTA REIT | - | - | - | - |
| | (17.097) | (-) | (-) | (-) |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 40.914 | 768 | 27.422 | 508 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 8.484 | 176 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 33.568 | 726 | 26.038 | 556 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 65.197 | 2,321 | 46.922 | 1,666 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 104.435 | 1,814 | 66.086 | 1,059 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

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

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|---------------------|---------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| COLONY NORTHSTAR INC | 171.797 (-) | 1,687 (-) | 150.141 (-) | 1,314 (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | 21.793 (-) | 653 (-) | 15.449 (-) | 454 (-) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 24.262 (-) | 877 (-) | 17.065 (-) | 612 (-) |
| MORGUARD REAL ESTATE INV TR | 8.498 (-) | 117 (-) | 7.302 (-) | 99 (-) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 46.171 (-) | 967 (-) | 33.815 (-) | 698 (-) |
| CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST | 10.604 (△13.699) | 492 (△642) | 8.995 (-) | 406 (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 50.951 (-) | 1,220 (-) | 39.609 (-) | 943 (-) |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 17.319 (-) | 706 (-) | 11.791 (-) | 476 (-) |
| COMINAR REAL ESTATE INV TR | 29.698 (-) | 395 (-) | 21.082 (-) | 286 (-) |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | 14.289 (-) | 306 (-) | 18.536 (-) | 405 (-) |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 5.882 (-) | 138 (-) | 3.836 (-) | 90 (-) |
| ONEREIT | 7.232 (-) | 26 (-) | 17.06 (-) | 71 (-) |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 7.884 (-) | 342 (-) | 6.02 (-) | 260 (-) |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 17.993 (-) | 244 (-) | 13.972 (-) | 190 (-) |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 10.548 (-) | 142 (-) | 6.579 (-) | 86 (-) |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 13 (-) | 124 (-) | 6.586 (-) | 65 (-) |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST | 35.323 (-) | 247 (-) | 80.153 (-) | 641 (-) |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES | - (-) | - (-) | 4.63 (-) | 150 (-) |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 14.546 (-) | 161 (-) | 8.249 (-) | 91 (-) |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 4.016 (-) | 57 (-) | 2.69 (-) | 37 (-) |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28.834 (-) | 357 (-) | 15.739 (-) | 203 (-) |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 12.677 (-) | 120 (-) | 7.559 (-) | 75 (-) |
| AGELLAN COMMERCIAL REIT | 2.13 (-) | 25 (-) | - (-) | - (-) |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 17.406 (-) | 134 (-) | - (-) | - (-) |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7.45 (-) | 377 (-) | 5.313 (-) | 265 (-) |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 50.105 (28.72) | 602 (266) | 36.799 (-) | 433 (-) |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7.046 (-) | 97 (-) | 5.599 (-) | 75 (-) |
| PLAZA RETAIL REIT | - (-) | - (-) | 19.36 (-) | 82 (-) |
| SLATE RETAIL REIT | 4.87 (-) | 60 (-) | 5.021 (-) | 61 (-) |

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

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

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

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---|-----------|------------|---------|------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| DERWENT LONDON PLC | 34.42 | 1,000 | 25.713 | 738 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 43.129 | 361 | 31.544 | 262 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HAMMERSON PLC | 247.617 | 1,297 | 184.754 | 938 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 243.79 | 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□ | 千イスラエル・シケル | 千□ | 千イスラエル・シケル |
| REIT 1 LTD | 42.547 | 618 | 28.26 | 411 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (アイルランド) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GREEN REIT PLC | 225.198 | 345 | 164.209 | 249 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

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

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 当 | | | 期 | | |
|---------|-----------|--------------------|-------|-----------|--------------------|-------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 区 分 | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 金 銭 信 託 | 172 | 172 | 100.0 | 172 | 172 | 100.0 |

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

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

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

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

| 銘柄 | 株 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|----------------------------|-----------|--------------------|-------|------------|------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (ユーロ…フランス) | | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| ALTEAREA | | 0.902 | 1,518 | 303 | 303 | 38,781 | 0.1 |
| KLEPIERRE | | 70.45 | 87,317 | 2,861 | 2,861 | 365,512 | 0.7 |
| COVIVIO | | 18.09 | 22,663 | 2,010 | 2,010 | 256,783 | 0.5 |
| MERCIALYS | | 19.06 | 22,547 | 337 | 337 | 43,058 | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | | 33.91 | — | — | — | — | — |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 171,552 7銘柄<4.5%> | 173,241 | 9,958 6銘柄<2.4%> | — | 1,272,143 | 2.4 |
| (ユーロ…ドイツ) | | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| HAMBORNER REIT AG | | 27.89 | 33,143 | 302 | 302 | 38,653 | 0.1 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | | 34.83 | 61,358 | 789 | 789 | 100,873 | 0.2 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 62.72 2銘柄<0.2%> | 94,501 | 1,092 2銘柄<0.3%> | — | 139,526 | 0.3 |
| (ユーロ…スペイン) | | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | | — | 136.98 | 1,292 | 1,292 | 165,091 | 0.3 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | | 30 | 39,724 | 373 | 373 | 47,698 | 0.1 |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS S | | 37.214 | 46,179 | 815 | 815 | 104,233 | 0.2 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 159.33 | 140,114 | 1,742 | 1,742 | 222,563 | 0.4 |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | | 22.2 | — | — | — | — | — |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 248,744 4銘柄<0.8%> | 362,997 | 4,224 4銘柄<1.0%> | — | 539,588 | 1.0 |
| (ユーロ…イタリア) | | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| BENI STABILI SPA | | 343.798 | 437.76 | 327 | 327 | 41,827 | 0.1 |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | | 112.11 | 20.03 | 138 | 138 | 17,662 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 455,908 2銘柄<0.1%> | 457.79 | 465 2銘柄<0.1%> | — | 59,489 | 0.1 |
| 合計 | 口数・金額 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 | | 期末 |
|---------------|------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 | 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・シケル=30.37円、1ユーロ=127.74円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年6月22日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 先進REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ) | 245,527,822円 |
| 先進REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ) | 91,474,091円 |
| MITO ラップ型ファンド (安定型) | 5,130,167円 |
| MITO ラップ型ファンド (中立型) | 21,023,866円 |
| MITO ラップ型ファンド (積極型) | 39,112,610円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 32,207,993円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 46,451,021円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 40,574,657円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 2,249,741,895円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> | 527,252,879円 |
| たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> | 136,977,197円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 72,728,227円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 431,494円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 8,548,879円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 35,028,585円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 3,112,712円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 16,632,656円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 13,804,156円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 41,020,013円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 81,563円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 935,693円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 1,071,075円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 3,601,721円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 23,851,883円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 605,308,573円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 64,548,816円 |
| 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グローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 11,580,328円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 11,102,663,617円 |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 2,154,006,440円 |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドⅡ (適格機関投資家限定) | 1,669,544,120円 |
| P-Oneマルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 3,647,231,593円 |
| DIAM海外リートインデックスファンド (適格機関投資家限定) | 559,435,038円 |
| 期末元本合計 | 44,369,434,317円 |

■損益の状況

当期 自2017年6月23日 至2018年6月22日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(平成30年3月1日)