

運用報告書 (全体版)

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類 信託期間	追加型投信／内外／資産複合 2007年1月26日から無期限です。
運用方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。 マネックス資産設計 ファンド<隔月分配型> 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 外国株式パッシブ・ ファンド・マザーファンド 国内債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド 外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド
主要投資対象	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。 海外の株式を主要投資対象とします。 わが国の公社債を主要投資対象とします。 海外の公社債を主要投資対象とします。 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。
運用方法	世界の6資産（国内外の株式・債券・リート）に分散投資を行います。基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。また、分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。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	決算日（原則として奇数月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に経費控除後の子、配当等収入および売買益（評価益を含みます。）等の中から、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、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。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

第74期 <決算日 2019年7月11日>
第75期 <決算日 2019年9月11日>
第76期 <決算日 2019年11月11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、「マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>」は、2019年11月11日に第76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/>

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

■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	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	投資信託受益証券、債券組入比率	純資産総額
		(分配)円	税込み分配金円	期騰落率%							
第22作成期	62期(2017年 7 月11日)	10,146	15	0.7	49.2	1.2	35.8	—	—	11.8	百万円 481
	63期(2017年 9 月11日)	10,054	15	△0.8	49.3	1.0	36.6	—	—	12.0	470
	64期(2017年11月13日)	10,570	15	5.3	51.1	1.3	34.5	—	—	11.6	477
第23作成期	65期(2018年 1 月11日)	10,824	15	2.5	52.0	1.3	33.4	—	—	11.3	467
	66期(2018年 3 月12日)	10,374	15	△4.0	50.5	1.8	34.6	—	—	11.1	443
	67期(2018年 5 月11日)	10,565	15	2.0	49.5	1.1	36.0	—	—	12.7	448
第24作成期	68期(2018年 7 月11日)	10,529	15	△0.2	47.5	1.8	35.6	—	—	13.0	449
	69期(2018年 9 月11日)	10,503	15	△0.1	48.9	0.9	35.5	—	—	13.1	441
	70期(2018年11月12日)	10,434	15	△0.5	48.6	1.8	35.7	—	—	14.6	428
第25作成期	71期(2019年 1 月11日)	9,924	15	△4.7	46.9	1.6	37.9	—	—	14.7	404
	72期(2019年 3 月11日)	10,298	15	3.9	47.3	0.7	36.6	—	—	14.0	418
	73期(2019年 5 月13日)	10,361	15	0.8	47.7	1.0	37.8	—	—	12.4	411
第26作成期	74期(2019年 7 月11日)	10,582	15	2.3	47.8	1.3	36.9	—	—	12.8	430
	75期(2019年 9 月11日)	10,589	15	0.2	47.6	0.8	36.2	—	—	13.1	427
	76期(2019年11月11日)	10,940	15	3.5	49.0	1.3	36.2	—	—	13.1	430

(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」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注 3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注 4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注 5) 当ファンドは、国内外の株式、債券および不動産投資信託証券（リート）の 6 資産に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。各資産の基本資産配分比率については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づいて決定しますが、原則として年 1 回見直すこととします。

上記コンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数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 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率						
第74期	(期 首) 2019年 5 月 13 日	円 10,361	% —	% 47.7	% 1.0	% 37.8	% —	% —	% 12.4
	5 月 末	10,254	△1.0	46.7	1.1	37.6	—	—	12.6
	6 月 末	10,449	0.8	47.4	1.0	37.0	—	—	12.4
	(期 末) 2019年 7 月 11 日	10,597	2.3	47.8	1.3	36.9	—	—	12.8
第75期	(期 首) 2019年 7 月 11 日	10,582	—	47.8	1.3	36.9	—	—	12.8
	7 月 末	10,572	△0.1	48.2	0.7	37.0	—	—	12.8
	8 月 末	10,412	△1.6	46.4	1.1	37.7	—	—	13.0
	(期 末) 2019年 9 月 11 日	10,604	0.2	47.6	0.8	36.2	—	—	13.1
第76期	(期 首) 2019年 9 月 11 日	10,589	—	47.6	0.8	36.2	—	—	13.1
	9 月 末	10,655	0.6	47.4	1.4	37.3	—	—	13.5
	10 月 末	10,929	3.2	48.0	1.3	35.7	—	—	13.5
	(期 末) 2019年 11 月 11 日	10,955	3.5	49.0	1.3	36.2	—	—	13.1

(注 1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

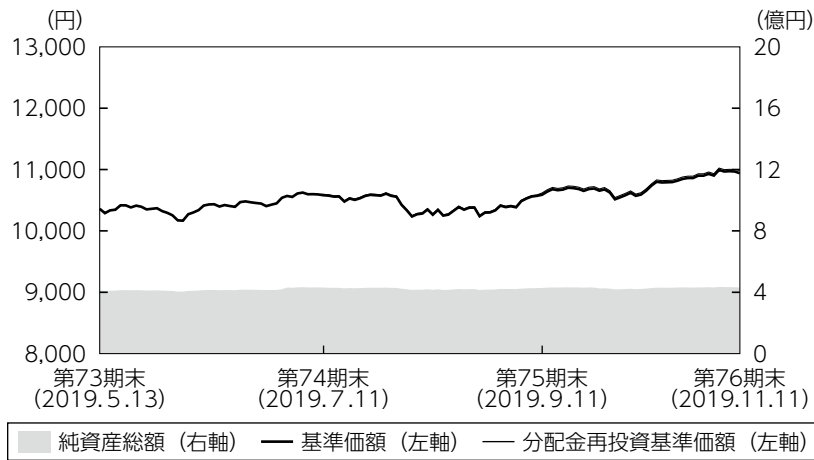
(注 2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注 3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注 4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第74期～第76期の運用経過（2019年5月14日から2019年11月11日まで）

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。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2) 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3) 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

米中摩擦の激化を背景とした景気先行き悪化懸念により多くの通貨に対して円高となったこと等がマイナスに寄与しました。一方、2019年10月に入り米中両政府が貿易協議で部分的な合意に達するとの期待から国内外の株式市場が上昇したこと、世界的な景気減速懸念が強まり多くの中央銀行がハト派姿勢を強めたこと等を背景に主要国の金利が低下（債券価格は上昇）したこと、金利の低下を好感し国内外のリート市場が上昇し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
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	11.9%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.9%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.5%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.9%
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	16.6%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.1%

投資環境

国内株式市場は、作成期初から2019年7月までは、米中貿易摩擦の状況などを材料に一進一退の展開となりました。しかし、8月上旬には米国による対中追加関税の発表などを受けて下落しました。その後、ほぼ横ばいの推移となっていました。9月に入ると米中関係の改善期待や円安進行などを要因として上昇に転じました。10月半ばに一時的に下落する場面もありましたが、作成期末にかけては米中関係の改善期待や企業業績の底打ち期待などをを受けて続伸し、前作成期末比で上昇しました。

外国株式市場は上昇しました。米国市場は、米国が中国への制裁関税引き上げを発表し、米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどから6月上旬にかけて弱含みました。その後は、米中通商協議の行方を睨み、方向感の定まらない展開となりましたが、作成期末にかけては米中通商協議の進展期待から上昇傾向となり、前作成期末比では上昇となりました。欧州市場もほぼ同様の動きとなり、各国市場は前作成期末比で上昇となりました。

国内債券市場は上昇（利回りは低下）しました。作成期初から8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念や、世界景気の先行き不透明感の高まり、米欧中央銀行の金融緩和観測などを背景に、10年国債利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から作成期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きなどから利回りは上昇し、低下幅は縮小しました。

外国債券市場では、米国債、ドイツ債の利回りは、ともに低下（価格は上昇）しました。米国では世界的な景気減速に加え、米中貿易摩擦の高まりやブレグジット（英国のEU離脱）等の不透明感があり、FRB（米連邦準備理事会）が政策金利の引き下げを実施したことなどから、米国債利回りは低下しました。欧州圏ではECB（欧州中央銀行）が追加金融緩和を決定したことなどから、ドイツ債の利回りは低下しました。

国内リート市場は、内需ディフェンシブ株の一角として株式投資家からの資金流入が支えになったこと、超低金利環境の継続に対するインカムゲイン期待の国内金融機関からの買い付けなどを背景に底堅い展開が続きました。さらに、世界的な株式指数への国内リート組入れの検討開始との報道も好材料となり、前作成期末比で大幅上昇となりました。

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は、米中通商協議を巡る警戒感などから下落する場面もありましたが、底堅い業績発表や長期金利の低下などを背景に堅調に推移しました。欧州リート市場は、低金利環境の長期化期待などを受け各市場で概ね上昇しました。豪州リート市場についても、長期金利の低下や豪州経済への期待などから堅調な推移となりました。

為替市場では多くの通貨に対して円高に振れました。ドル／円相場は、作成期初から米国の長期金利低下による日米金利差縮小を背景に円高ドル安基調で推移した後、9月に入り米中協議の進展期待が高まり米国の長期金利が反発に転じると円安ドル高の動きとなりましたが、前作成期末比では円高ドル安となりました。また、その他多くの通貨に対しても長期金利の低下に伴う内外金利差縮小を背景に円高現地通貨安となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

組入れる6資産の保有比率が概ね基本資産配分比率に維持されるように資産配分を行いました。
なお、時価変動による基本資産配分比率からの乖離分についてはリバランスを行いませんでした。

<基本資産配分比率>

日本株式：25% 外国株式：25% 日本債券：28% 外国債券：10% 日本リート：6% 外国リート：6%

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

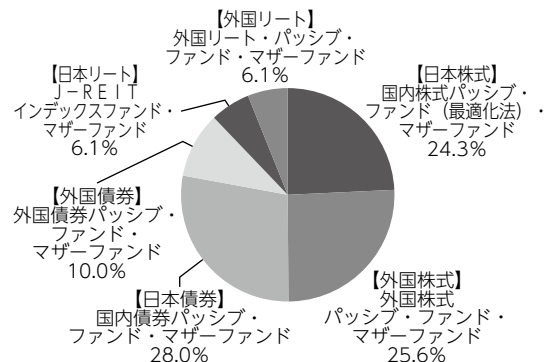
●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

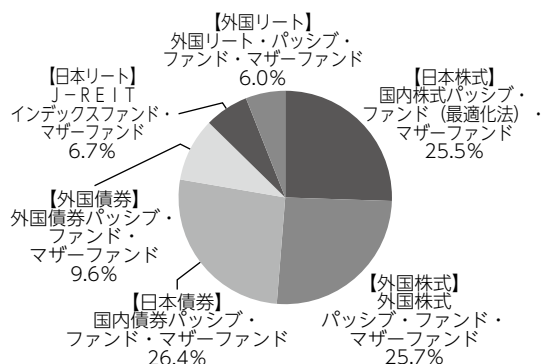
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

前作成期末



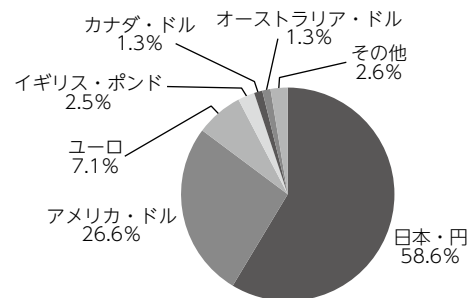
当作成期末



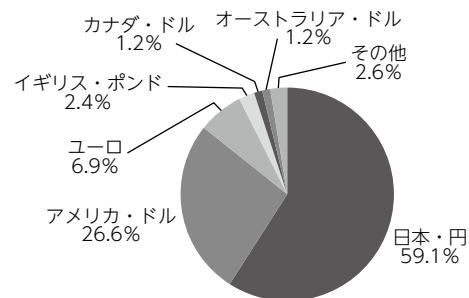
（注）組入比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

○通貨別構成比

前作成期末



当作成期末



（注1）組入比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券の評価額に対する割合です。

（注2）組入比率が1.0%未満の通貨については、合計してその他として表示しております。

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74期	第75期	第76期
	2019年5月14日 ～2019年7月11日	2019年7月12日 ～2019年9月11日	2019年9月12日 ～2019年11月11日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.14%	0.14%	0.14%
当期の収益	15円	15円	15円
当期の収益以外	－円	－円	－円
翌期繰越分配対象額	1,594円	1,597円	1,627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

マザーファンドの組入比率について、基本資産配分比率に基づき高位組入れを維持します。また、基本資産配分比率は原則として年１回見直します。なお、時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、年１回の基本資産配分比率の見直し時を除いては原則としてリバランスを行いません。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動した投資成果をめざします。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●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。

●J－REITインデックスファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を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	第74期～第76期		項目の概要
	(2019年5月14日 ～2019年11月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	28円	0.269%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,534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 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(15)	(0.140)	
(販売会社)	(11)	(0.108)	
(受託会社)	(2)	(0.021)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(d) その他費用	1	0.009	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(0)	(0.002)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(1)	(0.005)	
合計	30	0.282	

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

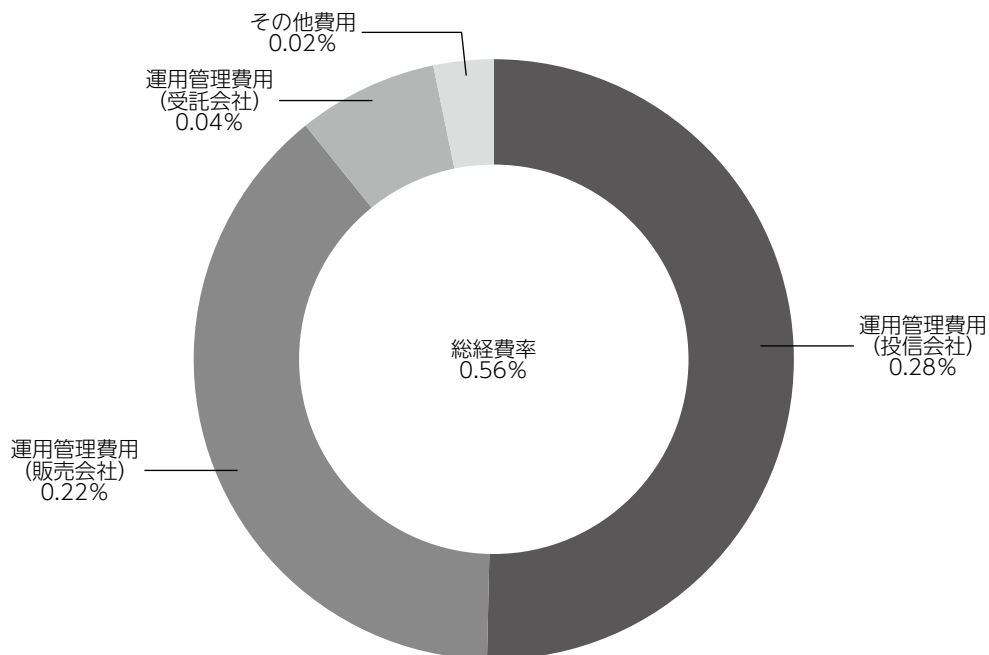
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.56%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年5月14日から2019年11月11日まで）

	第 74 期 ～ 第 76 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	1,028	2,551	1,460	3,680
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	701	2,573	1,037	3,786
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,277	3,016	3,310	4,412
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	572	1,063	829	1,555
JーR E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	305	651	421	1,007
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	483	627	679	918

■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 74 期 ～ 第 76 期		
	国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド	外 国 リ ー ト ・ パッシブ・ファンド・ マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	85,557,055千円	56,635,239千円	226千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	246,282,155千円	326,217,724千円	229千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.34	0.17	0.98

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年5月14日から2019年11月11日まで）
【マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>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 74 期 ～ 第 76 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	5千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.03千円
(B)／(A)	0.7%

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

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	第 74 期 ～ 第 76 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 32,692	百万円 24	% 0.1	百万円 52,864	百万円 376	% 0.7

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	第 74 期 ～ 第 76 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 307	百万円 481	百万円 2,532

(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 74 期 ～ 第 76 期
	買 付 額
株 式	百万円 98

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 74 期 ~			第 76 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
公 社 債	百万円 50,931	百万円 2,375	% 4.7	百万円 120,707	百万円 13,535	% 11.2

平均保有割合 0.0%

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

【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。

【J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 74 期 ~			第 76 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
投 資 証 券	百万円 34,184	百万円 316	% 0.9	百万円 23,150	百万円 －	% －

平均保有割合 0.1%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 74 期 ~ 第 76 期	
	買	付 額
投 資 証 券	百万円 1,670	

【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、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細
親投資信託残高

	第 25 作 成 期 末	第 26 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	40,885	40,453	108,952
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	28,967	28,630	109,887
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	86,634	85,601	112,805
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	22,209	21,951	41,117
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	11,988	11,872	28,426
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	19,026	18,830	25,639

■投資信託財産の構成

2019年11月11日現在

項 目	第 26 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	108,952	25.1
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	109,887	25.3
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	112,805	26.0
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	41,117	9.5
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	28,426	6.6
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	25,639	5.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,040	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	433,868	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2019年11月11日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは347,729,337千円、100.0％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは143,163,900千円、99.5％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは54,044,832千円、99.7％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年11月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝109.16円、1カナダ・ドル＝82.52円、1オーストラリア・ドル＝74.82円、1香港・ドル＝13.94円、1シンガポール・ドル＝80.25円、1ニュージーランド・ドル＝69.19円、1イギリス・ポンド＝139.65円、1イスラエル・シェケル＝31.23円、1スイス・フラン＝109.40円、1デンマーク・クローネ＝16.09円、1ノルウェー・クローネ＝11.93円、1スウェーデン・クローナ＝11.25円、1メキシコ・ペソ＝5.71円、100韓国・ウォン＝9.42円、1マレーシア・リングギット＝26.37円、1南アフリカ・ランド＝7.34円、1ポーランド・ズロチ＝28.19円、1ユーロ＝120.25円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年7月11日)、 (2019年9月11日)、 (2019年11月11日)現在

項 目	第 74 期 末	第 75 期 末	第 76 期 末
(A) 資 産	431,876,801円	428,860,906円	433,868,489円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,904,079	5,464,444	4,865,349
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	103,523,405	102,918,672	108,952,366
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	109,383,911	106,922,598	109,887,742
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	117,887,539	117,455,246	112,805,133
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	42,154,491	42,173,064	41,117,478
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	26,959,739	28,227,517	28,426,022
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	26,063,637	25,699,365	25,639,399
未 収 入 金	—	—	2,175,000
(B) 負 債	975,335	996,083	3,423,997
未 払 収 益 分 配 金	610,815	606,096	590,163
未 払 解 約 金	—	—	2,440,005
未 払 信 託 報 酬	361,797	387,071	390,880
そ の 他 未 払 費 用	2,723	2,916	2,949
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	430,901,466	427,864,823	430,444,492
元 本	407,210,561	404,064,320	393,442,139
次 期 繰 越 損 益 金	23,690,905	23,800,503	37,002,353
(D) 受 益 権 総 口 数	407,210,561口	404,064,320口	393,442,139口
1 万口当たり基準価額(C／D)	10,582円	10,589円	10,940円

(注) 第73期末における元本額は397,019,770円、当作成期間(第74期～第76期)中における追加設定元本額は13,077,272円、同解約元本額は16,654,903円です。

■損益の状況

[自 2019年5月14日
至 2019年7月11日]

[自 2019年7月12日
至 2019年9月11日]

[自 2019年9月12日
至 2019年11月11日]

項 目	第 74 期	第 75 期	第 76 期
(A) 配 当 等 収 益	△742円	660円	△362円
受 取 利 息	－	1	5
そ の 他 収 益 金	－	1,162	－
支 払 利 息	△742	△503	△367
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,787,639	1,301,327	14,783,602
売 買 益	9,787,532	2,993,325	16,311,244
売 買 損	107	△1,691,998	△1,527,642
(C) 信 託 報 酬 等	△364,520	△389,987	△393,829
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	9,422,377	912,000	14,389,411
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	33,095,092	41,507,928	40,524,388
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△18,215,749	△18,013,329	△17,321,283
(配 当 等 相 当 額)	(9,651,367)	(9,680,318)	(9,675,874)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△27,867,116)	(△27,693,647)	(△26,997,157)
(G) 合 計(D + E + F)	24,301,720	24,406,599	37,592,516
(H) 収 益 分 配 金	△610,815	△606,096	△590,163
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	23,690,905	23,800,503	37,002,353
追 加 信 託 差 損 益 金	△18,215,749	△18,013,329	△17,321,283
(配 当 等 相 当 額)	(9,656,094)	(9,680,702)	(9,678,403)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△27,871,843)	(△27,694,031)	(△26,999,686)
分 配 準 備 積 立 金	55,264,116	54,879,948	54,372,975
繰 越 損 益 金	△13,357,462	△13,066,116	△49,339

(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 74 期	第 75 期	第 76 期
(a) 経 費 控 除 後 の 配 当 等 収 益	1,243,843円	747,747円	1,775,564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	9,656,094	9,680,702	9,678,403
(d) 分 配 準 備 積 立 金	54,631,088	54,738,297	53,187,574
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	65,531,025	65,166,746	64,641,541
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,609.27	1,612.78	1,642.97
(g) 分 配 金	610,815	606,096	590,163
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	15	15	15

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 74 期	第 75 期	第 76 期
1 万口当たり分配金	15円	15円	15円

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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2019年2月7日）

（計算期間 2018年2月8日～2019年2月7日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年10月30日から無期限です。
運 用 方 針	主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主 要 投 資 対 象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	(配当込み) ベンチマーク	期 騰 落 率			
13期（2015年2月9日）	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
13期（2015年2月9日）	20,237	22.2	1,949.47	22.3	99.0	0.9	324,677
14期（2016年2月8日）	19,981	△1.3	1,925.17	△1.2	98.2	1.7	286,897
15期（2017年2月7日）	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
16期（2018年2月7日）	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
17期（2019年2月7日）	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

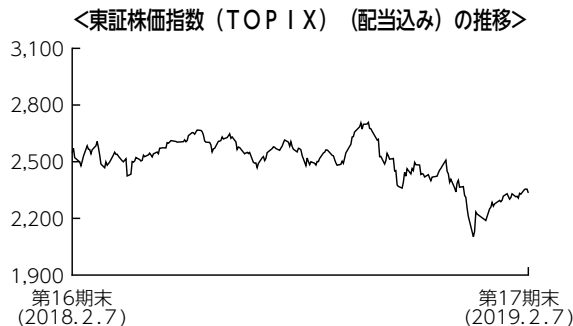
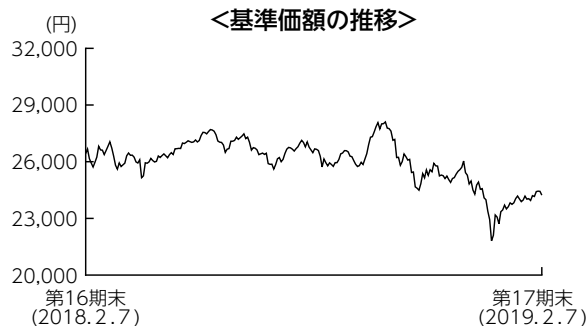
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月8日から2019年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は24,228円となり、前期末に比べ8.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種

期首（前期末）

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



期末

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

○組入上位10銘柄

期首（前期末）

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



期末

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で8.3%下落しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額 (25,984円) で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については 8 ページ (1 万口当たりの費用明細) をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2018年 2 月 8 日から 2019 年 2 月 7 日まで)

(1) 株 式

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

(注 1) 金額は受渡代金です。
(注 2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 100,959	百万円 98,142	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	81,677,032千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	281,533,266千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.29

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2018年2月8日から2019年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 55

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
水産・農林業 (0.1%)				北野建設				昭和産業			
極洋	5	5.4	15,206	植木組	27	2.9	9,193	鳥越製粉	10.4	11.4	33,812
日本水産	143	166.5	122,710	三井ホーム	1.6	1.8	4,060	中部飼料	10.1	11.1	8,746
マルハニチロ	24.1	24.1	87,121	矢作建設工業	16	—	—	フィード・ワン	13.9	15	16,920
カネコ種苗	4.4	4.6	6,035	ビーエス三菱	17.3	18.8	13,742	東洋精糖	76.6	83	14,442
サカタのタネ	18.8	20.2	73,023	日本ハウスホールディングス	15.1	14.5	8,352	日本甜菜製糖	2	2.1	2,179
ホクト	12.9	14	27,412	大東建設	24.3	26.2	11,397	三井製糖	6.5	7	12,341
ホクリヨウ	1.6	2.3	1,405	新日本建設	46	49	745,780	塩水港精糖	9	9.7	27,994
鉱業 (0.3%)				N I P P O	15.1	16.4	17,941	日新製糖	13.7	14.4	3,182
住石ホールディングス	33.7	35.9	3,590	東亜道路工業	29.4	36.4	76,076	森永製菓	5.4	5.8	11,814
日鉄鉱業	3.5	3.9	18,271	前田道路	2.6	2.6	8,008	山崎製パン	26.7	31	140,895
三井鉱山ホールディングス	6.5	6.9	9,694	日本道路	40	43.1	93,096	第一屋製パン	2.9	3	12,780
国際石油開発帝石	617.8	668.6	678,629	東亜建設工業	3.4	3.8	24,206	モロゾフ	31.8	36.9	205,164
日本海洋掘削	4.4	—	—	若築建設	10.3	12.1	17,327	名糖産業	5.5	5.9	8,419
石油資源開発	20.1	24	49,728	東洋建設	6.9	6.9	10,094	井村屋グループ	4.5	5.2	12,698
K&Oエナジーグループ	7.5	8	11,664	五洋建設	39.9	50.3	20,723	不二家	7.3	6.9	15,635
建設業 (2.9%)				世紀東急工業	151.1	163.3	102,552	山崎製パン	93.1	100.8	216,115
ヒノキヤグループ	—	3.5	7,122	福田組	17.2	20.1	12,341	第一屋製パン	2	2.1	2,137
ジョーボンドホールディングス	12	11.9	93,415	住友林業	4.1	4.5	19,530	モロゾフ	1.9	2	9,800
ミライト・ホールディングス	39.1	46.9	75,978	日本基礎技術	81.2	97.5	136,890	亀田製菓	7.1	7.6	39,140
タマホーム	9.6	10.3	12,174	日成ビルド工業	14.2	14.4	4,867	寿スベリッツ	11	13	55,445
サンヨーホームズ	2.3	2.5	2,092	ヤマダ・エスバイエルホン	18.8	—	—	カルビー	51.8	56.1	175,873
日本アーク	—	4.1	1,767	マダコ・ポレーション	58	—	—	森永乳業	22.8	24.6	77,490
ファーストコーポレーション	4.3	4.6	3,491	大和ハウス工業	15.9	17.1	6,805	六甲バター	5.7	9	17,874
ベステラ	1.8	3.2	4,272	積水ハウス	375.3	380.8	1,287,484	ヤクルト本社	68.1	91.3	648,230
T A T E R U	11.2	20.2	5,959	日特建設	24.5	26.4	35,904	明治ホールディングス	75.3	87.2	721,144
スペースビューホールディングス	—	20.3	19,325	北陸電気工事	413.3	420.8	679,381	雪印メグミルク	27.4	29.6	77,788
ガイセキ環境ソリューション	3	3.2	2,051	ユアテック	10.9	11.8	7,363	プリマハム	80	17.3	34,669
第一カッター興業	1.3	1.9	3,562	西部電気工業	7.1	6.7	6,036	日本ハム	98	53.2	230,888
安藤・間	97.8	106.4	80,757	四電工	20	22.1	19,934	林業産業	4.1	4.3	2,494
東急建設	48.9	48.8	47,775	中電工	2.1	—	—	丸大食品	61	13.3	24,312
コムシスホールディングス	44.7	59.1	165,361	関電工	1.9	2	5,334	S Foods	8	11.1	43,734
ミサワホーム	10.6	13.1	9,589	きんでん	16.4	17.6	40,180	伊藤ハム&久ホールディングス	73.3	79.3	49,959
ビーアールホールディングス	12.6	13.8	4,899	東京エネシス	50.6	62.6	62,224	サッポロホールディングス	41.6	45.1	111,938
島松コンストラクショングループ	8.2	10.3	28,644	トーエネック	84.5	91.5	161,314	アサヒグループホールディングス	238.4	257.9	1,220,382
東建コーポレーション	4.7	5.1	32,895	日本電設工業	14.4	14.2	14,498	キリンホールディングス	547	557.2	1,474,980
ソネット	1.6	1.8	1,258	協和エクシオ	3.6	3.8	12,331	宝ホールディングス	85.2	92.2	111,746
ヤマウラ	6	6.5	6,305	新日本空調	10.1	9.5	17,052	オエノホールディングス	32.5	35.2	12,672
大成建設	126.5	136.8	663,480	N D S	19.5	23.5	53,298	養命酒製造	3.5	3.9	8,034
大林組	381	412.3	419,309	九電工	45.6	53.8	145,582	コト・コト トラースジャパンホールディングス	79.9	94.3	322,977
清水建設	388.6	420.5	388,962	三機工業	9.8	11.7	21,258	サントリー食品インターナショナル	87	82.4	401,700
飛島建設	115.9	11.8	17,133	日揮	2	—	—	ダイドールグループホールディングス	5.8	6.9	36,432
長谷工コーポレーション	148.3	171.9	206,623	中外火工業	25.1	27	106,245	伊藤園	37.7	37.4	188,496
松井建設	14	15.2	11,020	ヤマト	26.9	31.6	35,676	キーコーヒー	11.2	12.2	24,668
銭高組	1.8	1.8	9,594	高砂熱学工業	109.4	118.4	191,808	ユニカフェ	3.5	3.9	3,900
鹿島建設	558	322.2	494,899	三晃金属工業	3.9	3.9	8,162	ジャパンフーズ	1.6	1.8	2,181
不動産テトラ	96.5	9.4	15,820	朝日工業社	10.5	12.4	5,753	日清オイリオグループ	13.4	15.9	50,562
大末建設	4.1	4.9	4,630	明星工業	8.6	9.3	22,905	不二製油グループ本社	30.8	30.1	108,661
鉄建建設	7.7	8.3	22,119	ダイダ	35	34.6	58,197	かどや製油	1.2	1.3	6,526
西松建設	29.3	29.6	75,835	日比谷総合設備	1.4	1.5	4,378	Jーオイルミルズ	5.9	6.4	25,696
三井住友建設	91.6	99.1	68,379	東芝プラントシステム	2.6	2.7	8,262	キッコーマン	88.9	81.3	418,695
大豊建設	46	9.3	32,689	OS J Bホールディングス	23	24.9	16,932	味の素	261.7	271.9	449,314
前田建設工業	90.6	98.1	106,732	東洋エンジニアリング	16.8	18.8	53,486	キューピー	63.4	68.6	170,608
佐田建設	8.4	8.8	3,361	千代田化工建設	8.5	9.2	22,650	ハウス食品グループ本社	43.4	47	187,295
ナカノフードー建設	9.7	10.5	5,481	新興ブランテック	14.2	13.1	23,855	カゴメ	45.6	49.4	139,406
奥村組	20.9	22.6	77,066	日本製粉	27.5	29.7	58,509	焼津水産化学工業	5.5	6.1	6,581
東鉄工業	15.3	16.5	48,691	日清製粉グループ本社	56.3	60.8	18,118	アリアケジャパン	10.4	11.3	79,213
イチケン	2.3	2.6	5,166	大冷	15	16.2	12,295	ビエトロ	1.5	1.6	2,616
富士ビー・エス	—	4.3	2,214	青木あすなろ建設	82.5	99.1	33,297	エバラ食品工業	2.5	2.6	5,675
浅沼組	45	4.9	14,523		24.5	24.7	31,023	ニチレイ	54.2	64	171,008
戸田建設	148	159.8	112,499					東洋水産	62.4	63.3	258,264
熊谷組	19.9	19.6	67,424					イトーアランド	3.2	4.3	7,030
青木あすなろ建設	8.3	6.8	6,779					大冷	1.3	1.5	2,605
								ヨシムラ・フード・ホールディングス	1.7	3.3	2,178

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

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
有沢製作所	19	19.3	16,076	コスモエネルギーホールディングス	32.8	35.5	84,632	愛知製鋼	6.3	6.8	23,358
日東電工	85.6	92.7	561,298	ゴム製品 (0.8%)				日立金属	120.8	130.8	143,487
レック	6.7	13.1	22,152	横浜ゴム	65.6	71.2	163,332	日本金属	2.8	2.8	3,318
三光合成	—	9.5	3,486	TOYO TIRE	67.2	63	94,248	大平洋金属	6.9	8.1	23,984
きもと	19.4	20.9	4,012	ブリヂストン	400.8	377.1	1,573,261	新日本電工	67.2	72.6	16,552
藤森工業	9.5	11	31,801	住友ゴム工業	116.7	110.2	166,622	栗本鐵工所	5.7	6.2	8,804
前澤化成工業	7.8	8.6	9,116	藤倉ゴム工業	9.9	10.9	4,959	虹 技	1.7	1.8	2,444
未来工業	—	6.6	15,503	オカモト	39	8.6	49,278	日本鉄管	12	1.3	1,224
ウェーブロックホールディングス	—	2.6	2,022	フコク	5	5.5	4,735	三菱製鋼	8.3	9.1	14,469
J S P	6.6	7.1	17,586	ニッタ	11.7	13.9	52,125	日亜鋼業	16.5	17.2	5,005
エフピコ	9.3	10.1	61,509	住友理工	22	23.9	24,306	日本精線	1.8	1.8	6,075
天馬	8.8	8.6	15,514	三ツ星ベルト	28	16.2	33,647	エンビロ・ホールディングス	—	2.5	1,252
信越ポリマー	23.3	22.1	17,967	パンドー化学	21.6	23.5	26,602	シンニッタン	8.7	19	6,175
東リ	28.2	30.7	7,705	ガラス・セラミックス (0.9%)				新家工業	2.6	2.7	4,336
ニフコ	20.8	49.1	133,404	日東紡績	16.9	18.3	35,227	非鉄金属 (0.8%)			
パルカー	9.2	9.9	22,275	AGC	115.9	121.4	469,211	大紀アルミニウム工業所	18.5	19.9	11,800
ユニ・チャーム	240.4	260.2	906,016	日本板硝子	57.3	58.6	54,732	日本軽金属ホールディングス	327.4	330.6	79,013
医薬品 (5.4%)				石塚硝子	1.5	1.6	2,924	三井金属鉱業	30.3	32.8	84,624
協和発酵キリン	142.1	153.7	331,684	日本山硝子	47	5.2	7,779	東邦亜鉛	6.2	6.7	23,919
武田薬品工業	417.7	777.5	3,465,317	日本電気硝子	49	53.1	152,662	三菱マテリアル	74.1	80.1	243,504
アステラス製薬	1,165.4	1,131.4	1,879,255	オハラ	4.5	4.8	7,915	住友金属鉱山	143.3	166.1	527,367
わかもと製薬	84.1	91	235,963	住友大阪セメント	220	24.7	118,807	DOWAホールディングス	28.4	28.4	97,696
塩野義製薬	162.2	160.6	1,064,938	太平洋セメント	71.6	77.4	288,702	古河機械金属	18.5	20	26,920
田辺三菱製薬	138.4	128.3	206,691	日本ヒューム	11.4	12.4	9,734	エス・サイエンス	53.4	53.7	3,436
わかもと製薬	14	14.3	3,875	日本コンクリート工業	24.5	26.6	7,288	大板チタニウムテクノロジーズ	11.7	14.1	23,462
あすか製薬	12.9	15.1	18,527	三谷セキサン	5.9	5.7	14,962	東邦チタニウム	20.1	21.8	20,819
日本新薬	29.7	32.1	231,120	アジアパイルホールディングス	14.7	17.3	11,158	UAC J	17	18.5	40,330
ピオフェルミン製薬	1.9	2	4,780	東海カーボン	103	111.4	164,537	CKサンエツ	—	2.3	5,568
中外製薬	118.2	127.9	883,789	日本カーボン	5.8	5.8	24,302	古河電気工業	37.3	35	120,225
科研製薬	20.5	22.2	119,880	東洋炭素	7.4	7.2	17,200	住友電気工業	419.2	453.6	689,472
エーザイ	135.7	146.8	1,264,094	リナタカンパニーリミテド	6.7	7.3	37,449	フジクラ	135.4	146.4	71,443
ロート製薬	62.3	62.9	185,932	TOTO	87.2	94.4	409,224	昭和電線ホールディングス	14.1	14.1	9,602
小野薬品工業	267.8	289.9	656,333	日本硝子	138.4	149.7	242,064	東京特殊電線	1.4	1.6	3,144
久光製薬	33.5	36.2	197,652	日本特殊陶業	97.3	103.5	229,977	タツタ電線	22.3	24.1	12,050
持田製薬	7.9	9.3	92,814	ダントーホールディングス	9	9.4	1,109	カナレ電機	1.9	2	3,658
参天製薬	214.7	232.6	345,876	MA RUWA	3.9	4.3	25,499	平河ヒューテック	5.6	5	7,425
扶桑薬品工業	4	4.2	10,613	品川リフラクトリーズ	3	3.2	11,696	リョービー	13.8	14.9	42,599
日本ケミファ	1.5	1.6	4,832	黒崎播磨	2.2	2.5	13,600	アーレスティ	13.8	14.9	9,595
ツムラ	40.5	38.1	122,872	ヨータイ	6.8	10.7	7,490	アサヒホールディングス	18.8	22.9	48,296
日医工	29.9	30.1	48,972	インソライト工業	5.8	6.3	4,032	金属製品 (0.6%)			
キッセイ薬品工業	21	21.8	62,740	東京窯業	14.5	15.7	5,981	稲葉製作所	6.3	6.9	8,459
生化学工業	22	23.8	30,368	ニッカトー	3.9	5.5	5,214	宮地エンジニアリンググループ	3.2	3.8	7,634
栄研化学	9.2	21.6	53,157	フジミンコーポレート	10.1	11	25,311	トーカロ	7.8	31.3	29,077
日水製薬	4.8	5.2	6,073	クニミネ工業	—	4.2	3,414	アルファ	4	4.3	5,516
鳥居薬品	7.1	6.6	14,223	エーアンドエーマテリアル	2.5	2.6	2,636	SUMCO	103.3	134.1	210,671
J C R ファーマ	8	8.7	50,460	ニチアス	62	33.6	66,897	川田テクノロジーズ	2.3	2.7	18,387
東和薬品	5.4	5.8	44,950	ニチハ	17.1	17	52,020	RS Technologies	1.6	2.5	7,485
富士製薬工業	3.9	8.3	15,097	鉄鋼 (1.0%)				東亜製鋼グループホールディングス	76.6	77.2	189,603
沢井製薬	22.8	25.1	137,046	新日鐵住金	501.8	563.9	1,148,946	ホクサンホールディングス	28	6.2	10,744
ゼリア新薬工業	24.3	24.3	46,315	神戸製鋼所	205.3	222	194,250	コロナ	6.2	6.8	6,956
第一三共	324.5	351.1	1,265,364	中山製鋼所	15.5	16.8	7,896	横河ブリッジホールディングス	20.9	22.6	43,437
キョーリン製薬ホールディングス	31.7	27	60,723	合同製鐵	6.1	5.8	10,126	駒井ハルテック	2.5	2.4	4,538
大幸薬品	6	5.4	9,417	ジェイ エフ イー ホールディングス	302.8	327.7	628,856	高田機工	1	1	2,756
ダイト	6.6	7.1	19,951	日新製鋼	30.9	—	—	三和ホールディングス	107.5	125.3	163,140
大塚ホールディングス	235.7	233.7	1,033,888	東京製鐵	60.1	64.9	58,994	文化シャッター	33	35.8	28,425
大正製薬ホールディングス	25.4	27.4	299,208	共英製鋼	12.6	13.7	21,961	三協立山	15.5	16.8	23,116
ペプチドリーム	50.8	61.2	290,394	大和工業	23.8	25.8	75,516	アルインコ	8.2	9.7	9,467
石油・石炭製品 (0.7%)				東京鐵鋼	4.6	5	5,925	東洋シヤッター	2.9	3	2,103
日本コークス工業	96.1	104.2	10,420	大阪製鐵	7.4	8	15,296	LI X I L グループ	165.3	179.1	287,992
昭和シェル石油	106.1	113.5	178,535	淀川製鋼所	16.4	16.4	35,522	日本フィルコン	8.7	9.4	4,869
ニチレキ	14.5	15.8	16,590	東洋鋼板	28.4	—	—	ノーリツ	25	27	41,607
ユシロ化学工業	6.4	6.4	7,865	丸一鋼管	39.7	43	148,995	長府製作所	12.6	12.4	25,469
ビービー・カストロール	4.9	4.4	5,900	モリ工業	3.7	3.7	8,894	リンナイ	20	21.7	157,976
富士石油	27.6	29.7	8,939	大同特殊鋼	19.9	19.8	86,625	ダイニチ工業	6	6.4	4,588
MORESCO	4.1	4.5	7,294	日本高周波工業	4.2	4.6	2,507	日東精工	15.5	16.7	8,867
出光興産	95.2	95.1	352,345	日本冶金工業	92.8	100.3	24,272	三洋工業	1.4	1.5	2,877
JXTGホールディングス	1,809.7	2,063.9	1,178,486	山陽特殊製鋼	12.9	15.2	35,765	岡部	22.7	24.6	21,156

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
ジーテクト	千株	千株	千円	日精樹脂工業	千株	千株	千円	T P R	千株	千株	千円
中国工業	12.4	13.5	21,073	オカダアイオン	9.4	10.2	9,618	ツバキ・ナカシマ	12.7	16.5	38,065
東プレ	1.7	1.9	1,081	ワイエイシホールディングス	3.3	4.2	6,211	ホシザキ	11.4	18.5	31,468
高周波熱錬	20.9	22.6	53,810	小松製作所	3.8	4.9	3,248	大豊工業	35.7	35.8	275,660
東京製綱	21.6	23.5	21,056	住友重機械工業	547.5	555.5	1,485,684	日本精工	9.2	10	10,290
サンコール	8.1	7.4	7,237	日立建機	64.9	70.2	260,793	N T N	232.9	252	268,884
モリテックスチール	6.3	6.9	4,395	日工	53	49.1	136,154	ジェイテクト	262.4	263.7	90,449
パイオラックス	6.6	9.5	3,961	巴工業	3.1	3.4	7,775	不二越	120.8	117.7	160,542
エイチワン	16.6	19.4	42,815	井関農機	4.8	5.2	13,000	日本トムソン	105	11.4	49,077
日本発条	8.3	12	13,260	T O W A	11.3	12.3	20,393	TH K	36.3	36.4	20,966
中央発條	111.7	120.9	124,527	丸山製作所	8.8	10.4	6,999	ユーシン精機	70.7	76.5	206,014
アドパネクス	1.3	1.4	4,048	北川鉄工所	2.5	2.6	3,546	前澤給装工業	5	9.5	8,597
立川ブラインド工業	1.8	1.6	2,468	ローツエ	5.4	5.5	12,507	イーグル工業	4.4	4.8	8,707
三益半導体工業	5	5.4	5,313	タカキタ	5.6	5.3	8,904	前澤工業	14	15.1	19,871
機械 (4.9%)	8.7	9.5	13,642	クボタ	3.6	4.4	2,657	日本ビラー工業	7.8	9.1	3,221
日本ドライケミカル	1.5	3.4	3,954	荏原実業	608.2	658.2	1,119,927	キッツ	11.5	12.4	16,603
日本製鋼所	36.6	36.7	74,794	三菱化工機	3.3	3.5	7,245	マキタ	50.5	49.7	45,028
三浦工業	48.5	52.6	125,766	月島機械	3.9	4.3	6,617	日立造船	147.9	149.3	582,270
タクマ	38	44.2	61,482	帝国電機製作所	22.5	24.3	33,631	三菱重工業	89.9	97.1	35,247
ツガミ	30	27.1	19,268	東京機械製作所	7.9	8.6	10,294	I H I	190	205.6	872,566
オークマ	13.1	15.4	89,782	新東工業	4.5	4.7	1,800	スター精密	87.1	94.3	321,091
東芝機械	63	13.7	29,961	澁谷工業	26.9	29.1	27,965	電気機器 (13.0%)	18.2	21.1	33,464
アマダホールディングス	173	187.2	201,427	アイコーポレーション	9.9	10.7	40,446	日清紡ホールディングス	69.3	68.1	63,128
アイデンジニアリング	28.5	33.7	26,656	小森コーポレーション	19.6	21.2	14,903	イビデン	69.4	75.1	109,120
滝澤鉄工所	3.5	3.9	6,555	鶴見製作所	28.5	33.2	37,682	コニカミノルタ	265.4	268.1	286,598
F U J I	33.6	36.3	52,308	住友精密工業	9.5	9.6	17,222	ブラザー工業	138.5	159.9	324,916
牧野フライス製作所	56	14.2	60,634	酒井重工業	19	2	5,836	ミネベアミツミ	210.5	227.8	418,924
オーエスジー	51.7	59.7	135,399	荏原製作所	2.1	2.3	5,428	日立製作所	2,723	552.4	1,935,057
ダイジェット工業	1.4	1.4	2,244	石井鐵工所	46.6	54.4	166,192	三菱電機	1,133.9	1,227	1,706,143
旭ダイヤモンド工業	33.3	31.8	23,436	西島製作所	1.8	1.9	3,467	富士電機	342	79.6	258,700
DMG森精機	62.1	76.7	114,743	北越工業	11.6	12.6	11,881	東洋電機製造	4.5	4.8	6,254
ソディック	24.4	26.4	21,648	ダイキン工業	12.8	12.7	15,240	安川電機	131.4	142.2	443,664
ディスコ	15.2	16.4	271,748	オルガン	154.8	167.5	1,968,962	シフニアテクノロジー	73	17	23,239
日東工器	6.9	6.6	14,869	トーヨーカネツ	4.1	4.5	12,546	明電舎	96	24.3	39,293
日進工具	3	3.7	9,113	栗田工業	4.8	4.6	10,842	オリジン電気	3.3	3.3	6,263
パンチ工業	9.4	8.5	4,496	椿本チエイン	61.4	66.4	186,052	山洋電気	5.5	5.9	23,511
富士ダイス	4.3	5.4	3,504	大同工業	67	16	65,360	デンヨー	10.5	11.3	16,012
豊和工業	6.2	6.7	5,715	木村化工機	4.3	5.8	5,144	東芝テック	81	15.3	41,264
OK K	4.3	5	4,235	アネスト岩田	9.6	10.2	3,886	芝浦メカトロニクス	17	2.2	7,854
石川製作所	2.9	2.9	3,433	ダイフク	19.1	19.1	18,202	マブチモーター	31.6	33.9	131,362
東洋機械金属	8.8	8.8	5,139	サムコ	57.7	67.4	376,092	日本電産	136.5	147.7	1,941,516
津田駒工業	27	2.6	4,872	加藤製作所	3.1	3.4	3,352	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4.1	6.6	11,259
エンシュウ	29	3.2	3,564	油研工業	5.4	6.3	17,173	トレックス・セミコンダクター	—	4.2	5,363
島精機製作所	14.2	16.7	59,619	タダノ	2.2	2.2	4,331	東光高岳	5.7	6.2	8,909
オプトラン	8.2	11.9	22,848	フジテック	54.7	59.2	70,566	ダブル・スコープ	16.5	17.8	20,559
NCホールディングス	3.6	3.8	1,835	C K D	36.3	44.6	52,494	宮越ホールディングス	4.3	4.6	4,540
フリユー	8	9.7	9,952	キトー	31.5	34.1	36,964	ダイヘン	62	13.5	37,125
ヤマシンフィルタ	15.3	21.1	13,567	平和	8.6	9.3	15,763	田淵電機	15.8	16.5	2,029
日阪製作所	16.1	15	12,840	理想科学工業	35.1	34.2	77,292	ヤーマン	16.4	17.7	24,355
やまびこ	21.7	23.6	26,078	S A N K Y O	11.2	10.9	18,813	J V Cケンウッド	83.3	89.9	24,452
平田機工	3.1	5.7	37,107	日本金銭機械	28.4	30.7	126,177	ミキエンジニアリング	10.2	11	8,910
ベガサスマシン製造	10.5	11.4	7,364	マースグループホールディングス	10.5	13.6	13,205	第一精工	5.3	5.1	6,257
マルマエ	—	3.3	2,392	福島工業	7.2	7.7	16,362	日新電機	26.6	28.8	28,137
タツモ	—	3.9	3,525	オーイズミ	7	7.5	28,987	大崎電気工業	24.3	24.4	17,470
ナプテスコ	61.7	66.7	189,294	ダイコク電機	4.8	5	1,750	オムロン	120.5	130.3	630,000
三井海洋開発	11.9	12.9	40,377	竹内製作所	5.2	5.6	8,159	日東工業	18.2	19.6	42,708
レオン自動機	10	12	16,740	アモノ	19	20.5	40,754	I D E C	14	16.4	33,718
S M C	35.6	35.9	1,386,458	J U K I	35.1	35.1	82,941	不二電機工業	1.3	1.3	1,684
新川	9.2	9.2	3,634	サンデンホールディングス	16.8	17	19,635	ジー・エス・コア コーポレーション	204	44.1	99,798
ホソカワミクロン	4.2	4.3	19,522	蛇の目ミシン工業	13.8	14.9	12,054	サクサホールディングス	2.9	3	5,367
ユニオンツール	5.1	5.2	15,990	マックス	10.3	11.2	5,275	メルコホールディングス	5.5	5.1	20,298
オイレス工業	14.5	16.9	32,160	グローリー	17.4	18.9	27,178	テクノメディアカ	2.7	2.8	5,810
日精イー・エス・ビー機械	3.8	3.5	13,597	新晃工業	33.8	34	86,156	日本電気	146.7	158.8	594,706
サトーホールディングス	14.8	14.6	37,960	大和冷機工業	11.5	11.4	17,293	富士通	1,166	118.3	894,702
技研製作所	5.7	8.5	27,115	セガサミーホールディングス	18.2	17.6	20,416	沖電気工業	46	53.2	66,287
日本エアテック	3.9	3.8	2,150	日本ビストンリング	112.5	121.8	157,974	岩崎通信機	5	5.8	4,657
カワタ	—	2.5	3,192	リケン	4.1	4.5	8,046	電気興業	6.4	6.4	17,158

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
サンケン電気	千株	千株	千円	澤藤電機	千株	千株	千円	いすゞ自動車	千株	千株	千円
ナカヨ	66	14.3	31,274	原田工業	1.2	1.5	2,512	トヨタ自動車	328.6	387.9	596,978
アイホン	2.2	2.3	3,254	コーセル	—	3.8	3,469	日野自動車	1,378.5	1,367.5	8,991,312
ルネサエレクトロニクス	6.4	7	11,886	イリソ電子工業	15.7	17	19,720	三菱自動車工業	161.8	153.2	158,715
セイコーエプソン	58.7	127	82,423	新日本無線	9.5	11.2	54,320	エフテック	419.7	454.2	297,046
ワコム	168.8	152.2	251,130	オプテックスグループ	6.9	—	—	レシップホールディングス	7.3	8.7	7,856
アルパック	88	88.9	42,583	千代田インテグレ	9.2	21.6	43,329	GMB	4.1	4.5	3,172
アクセル	26.1	24.5	88,567	アイ・オー・データ機器	5.5	5.1	9,679	日信工業	1.9	2.5	2,335
E I Z O	4.7	5	2,580	レーザーテック	4.7	5.1	6,390	トビー工業	2	2.1	1,621
ジャパンディスプレイ	10.4	11.3	52,488	スタンレー電気	23.2	25.1	108,557	武蔵精密工業	12.1	28.9	41,818
日本信号	233	290.1	21,177	岩崎電気	86.7	86.9	278,949	日産車体	44.3	24	23,736
京三製作所	31.3	31.2	30,139	ウシオ電機	4.4	4.8	6,518	新明和工業	49.3	57.1	84,508
能美防災	27	26.3	10,967	岡谷電機産業	68.8	74.5	92,752	極東開発工業	21.1	24.4	37,771
ホーチキ	15	16.2	29,824	ハリオス テクノ ホールディング	6.1	8.8	3,440	日信工業	23	22.4	34,563
星和電機	8.2	7.7	8,547	エノモト	9.7	11.3	7,864	トビー工業	9.3	10.1	24,017
エレコム	—	4.1	1,881	日本セラミック	—	2.6	2,202	曙ブレーキ工業	4.1	4.5	10,318
パナソニック	9.8	11.1	35,742	遠藤照明	11.5	12.5	32,637	タチエス	52.7	67.3	11,306
シャープ	1,295.4	1,401.8	1,445,956	古河電池	5.8	6.3	4,548	NOK	19.2	20.8	31,304
アンリツ	79	121.8	148,596	双信電機	8.1	8.8	6,441	フタバ産業	60.9	65.9	119,015
富士通ゼネラル	82.7	79	173,879	図研	5	5.9	2,041	大同メタル工業	34.7	34.1	20,494
ソニー	34.6	37.4	55,426	日本電子	8.2	8.9	11,676	プレス工業	11.8	12.8	38,156
T D K	757.5	822.6	3,876,913	カシオ計算機	7.4	7.9	13,003	ミクニ	14.3	19.9	15,701
帝国通信工業	59.3	64.2	551,478	ファナック	41	24.2	46,439	太平洋工業	60.2	60.8	37,817
タムラ製作所	5	5.4	6,474	日本シイエムケイ	91.2	108.5	162,424	ケービン	14.4	15.5	7,440
アルプスアルパイン	43.7	47.2	29,736	エンプラス	107.8	116.6	2,191,497	河西工業	23.7	25.7	43,355
池上通信機	97.7	127.7	294,731	大真空	20	31.2	22,027	アシシン精機	26	28.2	55,159
パイオニア	36	3.9	4,875	ローム	5.1	5.5	16,373	マツダ	13.9	15	13,440
日本電波工業	189	204.5	13,292	浜松ホトニクス	4.2	4.5	4,320	今仙電機製作所	93.4	101.1	423,103
鈴木	10.3	11.2	4,121	三井ハイテック	50.9	59.3	472,028	SU B A R U	355.9	385.1	500,630
日本トリム	4.5	6.1	3,922	新光電気工業	82.6	88.1	347,554	スズキ	10.5	11.4	11,662
ローランド ディー・ジー	2.4	2.4	13,008	京セラ	15	13.6	12,988	豊田合成	1,020.4	1,035.2	3,107,670
フォスター電機	5.8	6.3	14,143	太陽誘電	42.8	41.1	31,112	愛三工業	224.7	224.5	1,201,299
クラリオン	13.3	14.4	23,184	村田製作所	186.1	187.1	1,118,858	盟和産業	352	381	1,027,747
S M K	60	10.7	26,717	ユーション	50.9	54.6	111,984	日本プラス	5.5	5.9	8,165
ヨコオ	29	3.4	8,870	双葉電子工業	119	128.8	2,239,832	ヨロス	160.1	173.2	405,288
ティアック	7.4	8.8	13,252	北陸電気工業	17.1	19.4	19,089	エフ・シー・シー	29.4	29	44,399
ホシデン	84	8.6	1,788	ニチコン	18.5	20	34,920	エフ・シー・シー	13.5	14.8	5,964
ヒロセ電機	28.6	36.1	29,024	日本ケミコン	4.6	4.6	4,471	エフ・シー・シー	13.7	16.6	44,986
日本航空電子工業	18.3	17.5	208,775	K O A	35.7	38.6	33,968	エフ・シー・シー	41.2	39.7	93,771
T O A	29	28.2	40,861	市光工業	9.2	8.8	18,576	エフ・シー・シー	19.9	19.2	13,996
マクセルホールディングス	12.2	13.3	14,350	小糸製作所	15.7	18.6	29,536	エフ・シー・シー	1.7	1.9	2,014
古野電気	22.5	26.4	42,873	ミツバ	17	18.4	11,095	エフ・シー・シー	4.6	9.6	7,228
ユニデンホールディングス	13.5	15.8	14,804	SCREENホールディングス	67.9	73.6	461,472	エフ・シー・シー	11.5	11.5	17,549
アルパイン	31	3.7	7,958	キャノン電子	20.9	22.6	14,870	エフ・シー・シー	18.5	22.1	54,940
スミダコーポレーション	27	—	—	キャノン	21.5	21.3	106,500	エフ・シー・シー	45.7	49.5	766,755
アイコム	11.6	10.4	12,916	リコー	10.4	11.3	20,611	エフ・シー・シー	26.3	28.5	93,907
リオン	6.3	6.8	14,803	象印マホービン	610.4	660.6	2,104,011	エフ・シー・シー	5.7	6.2	16,733
本多通信工業	4.8	5.6	9,895	MUTOHホールディングス	340.9	369	426,195	精密機器 (2.0%)			
船井電機	8.8	10.5	5,754	東京エレクトロン	—	22.9	27,182	テルモ	173.8	173.6	1,064,168
横河電機	11.5	12.5	7,375	トヨタ紡織	1.6	1.6	2,982	クリエートメディック	3.8	4.2	4,032
新電元工業	113.5	122.8	252,476	トヨタ紡織	75.6	81.9	1,298,934	日機装	39.2	39.7	38,112
アズビル	4	4.4	19,162	トヨタ紡織	33	42.9	75,847	島津製作所	135.5	157.9	431,698
東亜ディーケーケー	34	79.2	191,822	芦森工業	2.4	2.6	3,868	J M S	10.5	11.1	6,604
日本光電工業	5.6	6.1	4,855	ユニプレス	21.9	23.8	49,789	グロテック	2.5	2.6	988
チノール	47.4	54.1	178,259	豊田自動織機	91.8	99.3	545,157	長野計器	8.9	9.6	8,121
共和電業	3.9	4.3	5,538	モリタホールディングス	18.2	21.4	37,385	バイ・テクノロジー	2.7	2.9	46,661
日本電子材料	13	13	4,771	三機工業	14.4	15.5	8,990	東京計器	7.2	7.7	7,168
堀場製作所	4.5	4.7	3,600	デンソー	251.6	270.2	1,256,159	愛知時計電機	1.5	1.6	6,040
アドバンテスト	22.5	24.3	136,323	東海理化電機製作所	29.8	32.3	61,757	インターアクション	4.4	6.5	14,306
小野測器	63.2	83.6	211,173	三井E&Sホールディングス	41	44.3	56,571	オーバル	11.2	11.7	2,819
エスベック	4.8	5.7	3,442	川崎重工工業	88.2	95.5	270,074	東京精密	20.5	22.2	71,262
キーエンス	10.1	10.9	21,898	名村造船所	34	36.8	15,787	マニー	13.8	14.9	71,296
日置電機	55.7	60.2	3,748,052	ナガサホールディングス	13.8	16.3	2,917	ニコン	197.6	213.8	393,819
シスメックス	5.9	6.4	28,672	日本車輛製造	41	4.5	11,209	トプコン	60.9	65.8	97,976
日本マイクロニクス	88.2	95.6	590,425	三菱ロジスネクスト	13.5	14.6	20,162	オリンパス	168.9	182.8	848,192
メガチップス	19.7	19.8	17,740	近畿車輛	1.7	1.9	3,762	理研計器	10.8	10.9	22,127
OBARA GROUP	8.9	9.7	20,321	日産自動車	1,337.3	1,447.3	1,343,239	タムロン	9.1	10.9	19,140
	6.6	7.1	25,666					H O Y A	230.9	247.1	1,628,389

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
シード	千株	千株	千円	電気・ガス業 (2.0%)	千株	千株	千円	S Gホールディングス	千株	千株	千円
ノーリツ鋼機	1.2	5.2	6,744	東京電力ホールディングス	905.1	979.5	658,224	海運業 (0.2%)	76.1	109.8	327,423
エー・アンド・デイ	11.5	9.7	18,274	中部電力	346.9	375.4	627,481	日本郵船	89.8	97.1	175,945
朝日インテック	10.4	11.2	7,873	関西電力	462.7	500.7	792,107	商船三井	67.9	69	182,712
シチズン時計	—	52	254,280	中国電力	156.7	169.6	249,481	川崎汽船	49.6	35.8	55,704
リズム時計工業	135.3	134.2	77,567	北陸電力	111.1	120.1	105,808	N Sユナイテッド海運	5.1	6.4	16,832
大研医器	4.3	4.1	7,080	東北電力	265.5	287.4	408,108	明治海運	11.4	12.1	4,271
メニコン	10.1	16.8	45,578	四国電力	102.1	110.5	157,020	飯野海運	54.7	55	21,835
シンシア	—	1.9	934	九州電力	250.4	252.9	334,839	共栄タンカー	0.8	0.8	1,216
松風	5.6	6.2	7,526	北海道電力	113.7	114.8	89,544	乾汽船	8.3	10.4	7,415
セイコーホールディングス	17.5	19	44,384	沖縄電力	18.3	22.7	46,716	空運業 (0.6%)			
ニプロ	78.5	84.9	118,605	電源開発	90.2	97.7	269,358	日本航空	199.2	212.8	856,732
その他製品 (2.0%)				エフオン	5.7	7.3	6,635	ANAホールディングス	210.5	212.5	862,112
中本パックス	1.1	3.4	5,531	イーレックス	17.8	21.3	14,079	パスコ	10	2.3	1,948
スノーピーク	3.5	4.5	5,598	レノバ	—	12.7	13,881	倉庫・運搬業 (0.2%)			
パラマウントベッドホールディングス	12	14.1	65,071	東京瓦斯	241.9	240.7	699,835	トランコム	3	3.3	21,912
トランザクション	5.1	6.7	4,817	大阪瓦斯	220	238	514,318	日新	9.3	10	19,050
S H O - B I	3.9	3.5	1,221	東邦瓦斯	56.2	60.7	279,220	三菱倉庫	37.1	40.2	106,610
ニホンフラッシュ	5.3	5.2	10,618	北海道瓦斯	31	6.6	9,490	三井倉庫ホールディングス	61	14.3	28,585
前田工織	11.4	13.6	37,848	広島ガス	23.4	25.5	8,746	住友倉庫	74	43.7	63,496
永大産業	15	16.4	7,314	西部瓦斯	13.8	13.9	34,597	澁澤倉庫	5.9	6.5	10,192
アートネイチャー	12.1	13.1	8,017	静岡ガス	32.2	37.7	33,628	東陽倉庫	19.5	20.5	6,088
バウティムコホールディングス	117.2	126.8	571,234	メタウォーター	6.4	5.9	18,349	日本トランスシティ	26	25.7	11,256
アイフィスジャパン	2.4	2.7	1,657	陸運業 (4.7%)				ケイヒン	2.1	2.2	2,824
共立印刷	18.9	20.8	4,846	S B Sホールディングス	11.2	12.2	20,081	中央倉庫	6.6	6.9	6,906
S H O E I	5.1	5.8	22,823	東武鉄道	121.2	129.4	390,141	川西倉庫	2.2	2.3	2,716
フランスベッドホールディングス	13.4	17.4	15,068	相鉄ホールディングス	36.3	42.2	135,884	安田倉庫	9.7	9.7	8,516
パイロットコーポレーション	19.8	21.4	113,848	東京急行電鉄	308	333.3	609,272	東洋埠頭	3.2	3.3	4,719
萩原工業	6.3	6.8	11,240	京浜急行電鉄	155.3	168.1	300,562	宇徳	9.4	10.1	5,514
トッパン・フォームズ	24.3	26.3	23,538	小田急電鉄	168.6	196.6	476,165	上組	67.6	71.8	174,545
フジテレビインターナショナル	25.4	27.4	110,148	京王電鉄	63.4	68.6	420,518	サンリツ	2.8	2.9	2,012
タカラトミー	47.5	51.4	61,731	京成電鉄	78.9	92	324,760	キムラユニティ	2.9	3.2	3,484
廣済堂	10.6	11.4	8,835	富士急行	15.5	16.7	59,118	キューソー流通システム	3.1	3	6,171
エステールホールディングス	3.4	3.5	2,310	新京成電鉄	2.9	3.1	6,441	近鉄エクスプレス	20.3	22	36,630
アーク	47.9	46.7	4,529	東日本旅客鉄道	203.7	218.2	2,216,912	東海運	6.1	6.3	1,764
タカノ	5	4.9	4,135	西日本旅客鉄道	102.3	110	864,490	エーアイティ	7.7	7.5	7,627
プロネクサス	10.6	10.5	12,201	東海旅客鉄道	101.5	109.9	2,596,387	内外トランスライン	3.8	3.8	5,449
ホクシン	8.2	7.7	1,054	西武ホールディングス	144.5	156.3	302,284	日本コンセプト	2.1	3.2	3,206
ウッドワン	3.8	4	4,148	鴻池運輸	16	19.6	32,594	情報・通信業 (8.4%)			
大建工業	8.8	9.3	17,688	西日本鉄道	31.4	34	91,358	NECネットエスアイ	12.3	13.4	33,567
凸版印刷	320	173.2	309,335	ハマキョウレックス	8	9.4	35,720	システナ	8.9	43	46,784
大日本印刷	148.4	172.9	435,362	サカイ引越センター	6	6.5	40,365	デジタルアーツ	5.5	6.5	52,195
図書印刷	7.6	11.5	11,097	近鉄グループホールディングス	107.4	116.1	553,797	新日鉄住金ソリューションズ	17.5	18	52,776
共同印刷	3.5	3.9	9,126	阪急阪神ホールディングス	143.2	155	599,850	キューブシステム	6.5	6.4	5,331
N I S S H A	23.3	25.1	36,545	南海電気鉄道	50.9	51.9	151,288	エイジア	1.7	2.4	2,786
光村印刷	1	1	1,964	京阪ホールディングス	47.8	51.8	232,582	コア	4.7	5.1	6,732
宝印刷	5.9	6.4	10,208	神戸電鉄	2.6	3	11,685	ソリトンシステムズ	3.7	6.8	5,691
アシックス	112.6	121.9	200,891	名古屋鉄道	83.3	93.1	269,338	ソフトクリエイティブホールディングス	5.4	5.2	7,753
ツツミ	3.5	3.9	7,569	山陽電気鉄道	8.3	9	18,972	T I S	37.1	40.1	199,898
小松ウォール工業	3.8	3.8	7,087	日本通運	42.2	45.6	298,680	ネオス	3.4	4.1	4,239
ヤマハ	76.4	73	382,520	ヤマトホールディングス	188.3	203.7	572,600	電算システム	3.9	4.6	11,012
河合楽器製作所	3.8	3.8	12,711	丸九	27.6	32.3	166,345	グリー	59.6	83.1	38,059
クリナップ	10.5	11.5	7,130	丸運	6	6.2	1,847	コーエーテックモホールディングス	18.9	24.6	44,722
ピジョン	68.5	74.2	325,738	全昭和運輸	38	9.4	25,774	三菱総合研究所	4.8	4.7	15,345
兼松サステック	0.9	0.8	1,240	セコーグループホールディングス	64.6	64.1	54,933	ボルテージ	2.1	2.4	1,360
キングジム	9.4	10.2	8,047	トナミホールディングス	2.6	2.8	16,576	電算	1.3	1.3	2,797
リンテック	26.9	29.2	71,335	ニッコンホールディングス	40.8	44.2	120,003	A G S	6.3	6.8	4,549
イトーキ	23.9	22.6	12,723	日本石油輸送	1.3	1.4	3,977	ファインデックス	9.3	10.1	6,787
任天堂	69.8	75.5	2,213,282	福山通運	15.7	14.9	63,325	ヒト・コミュニケーションズ	2.5	2.8	4,390
三菱鉛筆	18.7	20.2	46,460	セイノーホールディングス	80.4	87	130,761	ブレインパッド	2.4	2.6	13,390
タカラスタンダード	23.4	25.4	43,357	エスライン	—	3.1	3,468	K L a b	21.6	21.4	18,254
コクヨ	54.4	58.9	94,416	神奈川中央交通	2.7	2.9	10,686	オムロン・ビートルホールディングス	8.1	16	13,872
ナカバヤシ	11.1	12.3	6,678	日立物流	23.6	25.6	77,440	イー・ブイ・エス・エー・ティ・エー・ジャパン	1.8	2	3,054
グローブライド	5.1	5.9	15,027	丸和運輸機関	5.7	6.1	20,831	ネクソン	124	306.6	512,022
オカムラ	39.6	42.9	54,483	C&Fロジホールディングス	11.8	11.9	14,053	アイスタイル	27.9	30.6	25,214
美津濃	11.2	12.2	31,280	九州旅客鉄道	90.1	97.6	348,920	エムアップ	3.7	4.2	7,492

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
エイチーム	千株	千株	千円	シンクロ・フード	千株	千株	千円	USEN-NEXT HOLDINGS	千株	千株	千円
テクノスジャパン	7.6	7.5	13,560	オークネット	0.9	5.1	3,366	ワイヤレスゲート	2.9	4.6	4,259
enish	10.1	10.1	7,787	AOI TYO HOLDINGS	3.5	6.3	6,016	コネクシオ	5.2	5.3	2,803
コロプラ	3.3	4.2	2,041	マクロミル	9.1	13.1	10,807	クロップス	7.9	8.6	12,160
モバイルクリエイト	36.1	34.3	24,215	ビーグリー	10.4	21.3	32,887	日本通信	100.8	102.6	13,030
オルトプラス	8.6	—	—	オロ	—	2.3	2,070	KDDI	2.4	2.3	1,559
プロードリーフ	5.4	7.3	2,328	ソルクシーズ	—	1.1	5,203	日本電信電話	798.5	823.5	3,817,746
クロス・マーケティンググループ	27.6	59.7	33,790	フェイス	4.3	5.1	3,391	ソフトバンク	1,001.9	1,061.1	2,820,934
デジタルハーツホールディングス	—	3.3	1,188	ハイマックス	3.9	4.2	3,616	光通信	—	957.3	1,250,233
メディアドゥホールディングス	5.9	5.4	7,630	野村総合研究所	1.5	1.5	2,688	N T T ドコモ	13.4	14.2	251,766
じげん	3.6	3.5	8,102	サイバネットシステム	74.4	76.5	318,622	エムティーアイ	823.7	864.6	2,208,620
ブイキューブ	—	12.8	7,347	C E ホールディングス	9.2	9.9	6,336	GMO インターネット	15	14.1	8,586
サイバーリンクス	6.9	6.3	2,305	日本システム技術	3.2	3.2	2,272	カドカワ	40.5	43.8	68,809
ディー・エル・イー	1.8	1.9	1,941	インテージホールディングス	1.4	2	3,012	学研ホールディングス	1.8	2.5	1,245
フィックスターズ	5.1	7.5	1,110	ソースネクスト	12.8	15.4	13,582	ゼンリン	32.4	35.1	41,733
CARTA HOLDINGS	1.9	11.5	16,157	インフォコム	3.8	3.7	3,367	昭文社	3.7	4.1	16,810
オプティム	5.7	6.4	6,752	F I G	15.7	46.4	26,030	インプレスホールディングス	13.5	24	67,248
セレス	1.9	2.7	12,312	アルテリア・ネットワークス	—	4.9	19,110	アイネット	5.1	5.4	2,430
ベリサープ	3.4	4	6,040	フォーカスシステムズ	—	10.6	3,572	松竹	9.5	9.7	1,455
ディー・ガイア	1.4	1.1	7,348	クレスコ	6.3	8	12,285	東宝	6.3	6.8	9,200
セック	11.1	12.1	24,030	フジ・メディア・ホールディングス	2.5	3.7	13,061	エヌ・ティ・ティ・データ	7.4	7.9	86,110
日本アジアグループ	1.1	2	7,440	オービック	116.5	124.9	199,715	ピー・シー・エー	73.2	79.2	312,048
豆蔵ホールディングス	11.7	12.8	4,595	ジャストシステム	35.1	41.8	427,196	NTT ドコモ	4.2	5.1	71,298
テクノマトリックス	8.3	8.1	8,424	TDC ソフト	18.1	17.1	39,723	エヌ・ティ・ティ・データ	345.6	320.7	379,708
プロシッパ	6.1	8.6	16,847	ヤフー	4.9	10.5	9,166	ピー・シー・エー	1.7	1.6	3,211
カンホー・オンライン・エンターテイメント	1.6	3.6	4,716	トレンドマイクロ	802.3	785.1	244,166	ビジネスプレイン太田昭昭	1.9	2.1	4,111
GMO ペイメントゲートウェイ	301.7	290.2	91,413	インフォメーション・ディベロプメント	54.3	64.2	362,730	D T S	11.6	13.5	56,362
ザッパラス	7.8	19.8	110,682	日本オラクル	3.5	3.4	5,052	スウェプト・エンコックス・ホールディングス	51.7	56	186,760
システムリサーチ	5.5	5.9	2,194	アルファシステムズ	18	24.4	196,908	シーイーシー	6.6	12.9	27,412
インターネットニシアティブ	1.1	1.6	4,880	フューチャー	3.7	4	10,408	カプコン	23.8	51.6	117,028
ざくらインターネット	18.1	19.6	52,645	CAC Holdings	15.1	16.3	28,655	アイ・エス・ビー	2.2	2.4	4,576
ヴィンクス	13.3	4.1	5,174	ソフトバンク・テクノロジー	8.4	9.1	8,745	ジャステック	6.5	7	6,531
GMO クラウド	—	2.7	9,504	トーセ	4.7	5.1	10,883	S C S K	25.7	31.8	147,075
S R A ホールディングス	2.5	6.4	16,742	オービックビジネスコンサルタント	3	3.3	2,719	日本システムウェア	3.7	4	8,020
MINOR I ソリューションズ	5.9	2.4	3,960	伊藤忠テクノソリューションズ	5.7	12.4	49,662	アイネス	14.1	15.2	19,866
システムインテグレータ	2.2	3.4	2,570	アイティフォー	25.3	54.9	138,073	T K C	10.4	10.1	39,491
朝日ネット	1.6	10.1	5,191	東計電算	13.6	14.6	12,059	富士ソフト	15.4	18	80,730
e B A S E	10.2	3.7	6,378	サイボウズ	2	1.8	5,436	N S D	18.3	19.7	47,063
アバント	2.2	3.2	4,265	ソフトブレイン	1.8	2.3	1,945	コナミホールディングス	45.5	49.3	217,413
アドソル日進	—	4.3	7,271	電通国際情報サービス	65.1	65.1	262,027	日本システムウェア	3.2	4	7,256
フリービット	4.3	7.9	7,394	デジタルガレージ	14.9	14.1	8,939	J B C ホールディングス	8.8	9.5	16,216
コムチュア	5.7	6.7	19,892	イーエムシステムズ	8.9	9.5	4,854	ソフトバンクグループ	9.8	12	30,672
サイバーコム	2	2.2	5,152	ウェザーニューズ	6.9	7.4	23,680	卸売業 (5.1%)	503.7	503.2	5,012,878
アステリア	—	5.9	4,979	C I J	20	23.5	66,881	ホウスイ	0.9	0.9	784
マークラインズ	—	4.2	6,102	東洋ビジネスエン지니어リング	3.9	9.7	10,912	高千穂交易	4.3	4.7	4,667
メディカル・データ・ビジョン	—	10.6	10,250	日本エンタープライズ	3.8	4.1	11,955	伊藤忠食品	2.7	2.9	13,862
gumi	4.2	12.8	8,896	WOWOW	8.8	9.5	7,666	エレマテック	5.2	5.6	10,242
ショーケース・ティービー	2.2	2.6	1,781	スカラ	1.1	1.1	2,106	J A L U X	3.2	3.4	8,466
モバイルファクトリー	2.1	3.3	3,388	IMAGICA GROUP	11.7	12.7	2,298	あらた	5.5	6.7	29,111
テラスカイ	—	0.7	2,863	ネットワンシステムズ	5.3	5.7	16,455	トーマンデバイス	1.7	1.9	4,542
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1.7	5.3	6,927	システムソフト	7.8	9.7	7,207	東京エレクトロニクス	4	4.4	8,078
P C I ホールディングス	—	2.2	5,123	アルゴグラフィックス	9.4	10.2	5,344	フィールズ	8.5	10.5	6,709
パイプHD	1.8	2	1,780	マーベラス	45.4	42.7	107,219	双日	660.7	667.4	274,968
アイビシー	1.2	2	2,574	エイベックス	26.5	29.1	2,880	アルフレッサ ホールディングス	124.1	134.3	398,736
ネオジャパン	—	2.3	2,201	日本ユニシス	5.1	5.1	23,740	横浜冷凍	27	31.7	29,544
P R T I M E S	—	0.7	1,625	兼松エレクトロニクス	18.9	18.4	16,964	神楽	1.5	1.6	1,209
ランドコンピュータ	—	1.4	1,433	東京放送ホールディングス	20.6	20.7	30,429	ラサ商事	5	6.5	5,479
ダブルスタンダード	—	0.7	2,597	日本テレビホールディングス	30.9	37.6	109,077	ラクーンホールディングス	6.6	7.1	4,721
オープンドア	4.4	5.9	16,702	スカパー・J S A T ホールディングス	7.1	6.5	20,767	アルコニクス	6.6	11.8	14,515
マイネット	2.2	3.9	6,665	テレビ東京ホールディングス	67	79.8	151,061	神戶物産	7.2	18.3	64,141
アカツキ	2.2	4.3	25,456	朝日放送グループホールディングス	102.2	110.5	188,181	あい ホールディングス	17.9	17.2	33,918
ベネフィットジャパン	—	0.6	507	テレビ朝日ホールディングス	11	12.1	8,578	ディー・ビー・エックス	4	4.2	4,683
Ubicommホールディングス	—	2.2	2,831	スカー・J S A T ホールディングス	30.5	33.1	64,776	ダイワホールディングス	9.5	11	65,890
L I N E	33.6	36.6	148,230	テレビ東京ホールディングス	84.9	92	43,516	マクニカ・富士エレクトロニクス	20.7	33.5	51,556
カナミックネットワーク	—	1.9	3,471	日本 B S 放送	9.1	9.9	26,007	ラクト・ジャパン	1.6	2.7	22,869
ノムラシステムコーポレーション	—	0.9	673	ビジョン	3.8	4.2	4,431	バタケ・エスケー・ホールディングス	21	22.9	24,869
チェンジ	—	1.5	6,255		2.9	3.8	16,131	八洲電機	8.7	9.5	7,847

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
千株	千株	千株	千円	千株	千株	千株	千円	千株	千株	千株	千円
メディアホールディングス	1.8	6.7	4,549	三井物産	948.7	995.7	1,737,496	加藤産業	17.4	18.9	61,708
U K Cホールディングス	7.2	7.7	15,423	日本紙パルプ商事	5.8	6.9	28,566	北恵	—	2.3	2,168
ジュテックホールディングス	2.6	2.7	2,716	日立ハイテクノロジーズ	38.8	36.7	155,791	イノテック	9.7	8.3	8,573
大光	2.6	3	1,818	カメイ	14.5	15.8	18,391	イエローハット	10.5	11.4	31,156
OCH Iホールディングス	3.2	3.4	3,872	東都水産	1.7	1.8	4,467	J Kホールディングス	11.2	11.1	6,282
TOKAIホールディングス	59	63.9	56,679	OUGホールディングス	1.8	2.1	5,115	日伝	9.3	10	15,630
黒谷	—	2	980	スターゼン	4.4	4.5	18,090	北沢産業	9.5	9.2	2,668
C o m i n i x	1.7	1.9	1,565	山善	43.6	47.2	51,967	杉本商事	6	6.6	11,424
三洋貿易	6.1	6.1	10,980	椿本興業	2.5	2.7	9,895	因幡電機産業	14.7	17.1	78,660
ビューティガレージ	1.5	1.8	2,853	住友商事	704.4	714.7	1,159,600	バイテックホールディングス	5.1	5.4	10,989
ワイン・パートナーズ	8.1	7.8	8,447	内田洋行	5.1	5.5	12,303	東テク	3.7	4.1	9,343
ミタチ産業	2.6	2.9	2,114	三菱商事	783.7	848	2,676,288	ミスミグループ本社	129.6	151.3	394,439
シッパヘルスケアホールディングス	23.3	25.1	103,286	第一実業	5.1	5.5	19,112	アルテック	9.6	8.7	1,931
明治電機工業	3.8	3.9	6,961	キャンマークetingジャパン	31.9	34.5	70,207	タキヒヨー	3.7	3.8	6,809
デリカフーズホールディングス	2.2	2.2	2,981	西華産業	6.9	6.8	10,329	蔵王産業	1.8	2.1	2,679
スターティアホールディングス	2.5	2.4	1,430	佐藤商事	10	10.9	9,690	スズケン	50.9	55.1	307,458
コメダホールディングス	20.6	27.7	58,391	菱洋エレクトロ	10.4	12.3	18,474	ジェコス	7.7	8.5	8,882
富士興産	4.1	4.6	2,953	東京産業	11.1	12.1	6,449	ルネサスイーストン	10.2	11.2	4,816
協栄産業	1.4	1.4	2,114	ユアサ商事	10.6	12.4	41,044	小売業 (4.9%)			
小野建	9.7	10.6	17,797	神鋼商事	2.5	2.7	6,814	ローソン	28.3	30.6	204,102
南陽	—	2.5	5,597	小林産業	7.6	7	1,953	サンエー	8.4	9.2	40,296
佐島電機	8.2	9	8,379	阪和興業	20.9	21	61,551	カワチ薬品	8.7	9.4	19,270
エコートレーディング	2.5	2.6	1,565	正栄食品工業	6.2	6.4	18,137	エービーシー・マート	20.3	18.9	118,125
伯東	6.8	8.3	9,835	カナデン	10.7	11.7	14,601	ハードオフコーポレーション	4.9	4.8	3,926
コンドーテック	8.9	9.4	9,099	菱電商事	8	9.6	13,324	アスクル	9.7	12.7	26,847
中山福	6.4	6.6	3,445	フルサト工業	6.1	6.7	10,880	ゲオホールディングス	20.4	18.4	29,697
ナガイレーベン	14.8	17.4	38,367	岩谷産業	24.8	26.7	98,256	アダストリア	17.2	16.7	31,963
三菱食品	12.3	13.4	39,114	すてきナイスグループ	4.8	5	4,315	ジーフット	6.7	7.4	4,972
松田産業	8.1	8.9	12,807	昭光通商	40	4.4	2,802	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1.5	1.5	1,132
第一興商	16.6	18	93,960	ニチモウ	1.7	1.9	3,629	くらコーポレーション	6.6	7.1	39,334
メディアホールディングス	111.9	130.5	329,121	極東貿易	16	3.8	6,156	キャンドウ	5.3	5.7	8,778
S P K	2.4	2.5	5,690	イワキ	16	14.5	5,727	バルブルホールディングス	5.7	6.2	18,817
萩原電気ホールディングス	3.8	4.5	12,586	三菱石油	30	32.4	30,067	エディオン	43.4	51.1	50,078
アズワン	8.7	8.7	68,730	稲畑産業	26.8	29	45,037	サウコーポレーション	19.2	24.5	13,989
スズデン	3.9	4.3	6,798	G S Iクレオス	3	3.2	3,872	ワッツ	4.5	4.1	2,984
尾家産業	3.3	3.4	3,940	明和産業	10.4	11.4	4,753	ハローズ	4.2	4.6	10,483
シモジマ	6.8	7.4	8,443	ワキタ	23.8	25.8	29,695	あみやき亭	2.4	2.7	9,612
ドウシシャ	11.8	11.4	18,559	東邦ホールディングス	33.1	35.8	93,080	ひらまつ	15.4	24.1	8,194
小津産業	2.5	2.6	4,836	サンゲツ	37.7	36.5	74,679	大黒天物産	2.7	2.8	11,172
高速	6.6	7.3	7,738	ミツロギグループホールディングス	16.2	17.5	14,000	ハニースホールディングス	10.8	11.8	11,174
たけびし	3.9	4.3	5,981	シナネホールディングス	5.3	5	11,035	ファーマライズホールディングス	2.6	2.7	1,514
リックス	2.5	2.7	4,106	伊藤忠エネクス	24.7	26.6	24,259	アルペン	8.6	9.3	15,345
丸文	9.9	10.7	7,564	サンリオ	31.4	37.3	82,507	ハブ	2.1	3.9	3,673
ハピネット	7.6	10.1	15,846	サンワ テクノス	6.6	7.3	6,891	クオールホールディングス	12.3	17.7	25,257
橋本総業ホールディングス	2.3	2.4	3,410	リョーサン	14	13.4	41,071	ジンス	7.6	8.1	42,444
日本ライフライン	31.8	37.9	58,972	新光商事	12.3	11.4	21,181	ビックカメラ	64.7	64.5	79,722
タカショー	—	6.1	2,641	トーホー	5	5.5	11,297	DCMホールディングス	60.2	65.1	72,521
エクセル	4.5	4.5	9,553	三信電気	10.3	10	18,090	ペッパーフードサービス	6	9.5	24,434
マルカカイ	3.6	4	7,836	東陽テクニカ	12.9	14	12,166	M o n o t a r o	39.7	76.3	182,662
I D O M	33.9	40.7	16,402	モスフードサービス	14.6	15.9	43,263	東京一番フーズ	2.4	2.5	1,487
日本エム・ディ・エム	7.5	7	7,476	加賀電子	10.1	12.1	24,611	DDホールディングス	2.5	2.7	5,548
進和	6.6	7.1	14,966	ソーダニッカ	11.6	12.7	6,896	きちりホールディングス	3.1	3.1	2,157
エスケイジャパン	2.4	2.9	1,844	立花エレクトック	7.6	9	13,986	アークランドサービスホールディングス	9.3	8.9	18,245
ダイトロン	5.1	5.5	7,694	フォーバル	4.9	5.3	4,478	J. フロント リテイリング	133.4	154.5	186,945
シークス	7.1	15.3	23,454	P A L T A C	15.7	21.8	115,758	ドット・日レスホールディングス	19.6	21.2	44,583
田中商事	3.5	3.7	2,205	三谷産業	12.1	14.4	3,916	マドモトキヨシホールディングス	46.2	50	167,250
オーハシテクニカ	6.3	6.8	9,520	太平洋興発	4.7	4.9	3,572	ブロンコビリー	5.8	6.3	16,317
白銅	4	4	6,724	西井 i s m e t t i c ホールディングス	2.3	2.8	13,258	Z O Z O	109.7	130.6	234,427
伊藤忠商事	819.6	845.4	1,716,584	ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	0.9	1,215	トレジャー・ファクトリー	3.3	3.7	2,889
丸紅	917.8	1,191.9	991,660	国際紙パルプ商事	—	21.2	5,702	物語コーポレーション	3.2	3.4	32,164
高島	1.9	2	3,604	ヤマタネ	5.6	6.1	10,339	ココカラファイン	11.7	13.6	65,824
長瀬産業	67.3	68	112,132	丸紅建材リース	11	1.1	2,084	三和伊勢丹ホールディングス	208.8	225.9	241,261
蝶理	7.1	7.7	11,719	日鉄住金物産	8.7	8.7	40,194	H a m e e	2.8	3.1	2,523
豊田通商	124.6	134.9	450,566	泉州電業	3.7	4.1	10,475	ウエルシアホールディングス	29.5	32	130,240
三共生興	18.9	20.7	8,507	トラスコ中山	23.2	25.1	79,316	クリエイトSDホールディングス	16.5	17.7	48,816
兼松	47.6	48.3	61,292	オートバックスセブン	44.4	48	89,088	丸善CH Iホールディングス	13	14.5	4,683
ツカモトコーポレーション	2	2.2	2,206	モリト	8.9	8.9	6,425	ミサワ	1.8	2.4	972

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
ディーライフ	千株	千株	千円	VTホールディングス	千株	千株	千円	愛眼	千株	千株	千円
エー・ピーカンパニー	1.5	1.6	1,427	魚力	37.8	41	17,015	ケーユーホールディングス	9.1	9.7	2,919
チムニー	2.2	2.3	1,053	ボプラ	3.1	3.4	4,851	吉野家ホールディングス	5.8	6.2	4,848
シュッピン	3.4	3.8	9,591	フジ・コーポレーション	3	3.1	1,819	松屋フーズホールディングス	36.7	42.3	74,659
ネクステージ	6.8	8.1	5,904	ユニテッドアローズ	1.9	2.5	5,120	関西スーパーマーケット	5.4	5.8	20,590
ジョイフル本田	11.4	18.6	17,279	ハイデイド高	13.8	13.9	52,333	王将フードサービス	14.9	16.2	21,448
扇貴族	16.4	35.4	48,568	京都きもの友禅	12.2	15.9	34,757	プレナス	8.4	9.2	9,089
ギン堂ホールディングス	4.1	4	7,024	コロワイド	7.3	7.7	3,226	ミニストップ	8.2	8.9	63,813
ホットランド	3.9	4.8	6,897	ピーシーデポコーポレーション	37.1	40.2	94,952	アークス	12.5	13.6	24,792
すかいらーくホールディングス	6.5	6.3	7,938	トッパカルチャー	16.7	16	6,960	パローホールディングス	8.3	9	17,379
綿半ホールディングス	69.3	112.6	204,256	P L A N T	7.9	8.6	39,259	藤久	20.9	22.7	55,319
ヨシックス	4.2	4.5	9,103	スギホールディングス	4.1	4.6	1,329	ベルク	26	26.1	70,835
コナカド・スーパーマーケット・ホールディングス	1.8	2	6,060	ヴィア・ホールディングス	2.6	2.9	2,917	大 庄	0.9	0.9	674
ブックオフコーポレーション	37.1	35.2	41,360	スクロール	24.5	26.5	121,502	ファーストリテイリング	5	5.9	28,674
ゴルフダイジェスト・オンライン	6.4	—	—	コンドンホールディングス	9.8	14.8	9,723	サンドラッグ	6	6.5	9,925
B E E N O S	4.5	4.9	3,332	ユニー・ファミリーマートホールディングス	17.4	18.6	7,235	サックススーパーホールディングス	18.7	16.2	777,924
あさひ	1.5	2.8	3,029	木曾路	11.4	13.5	29,038	ヤマザワ	47.3	45.4	157,084
日本調剤	8.3	10	15,080	S R Sホールディングス	35.7	33.8	425,880	やまや	10.5	10.2	11,046
コスモス薬品	3.9	4.3	16,813	千趣会	13.7	14.8	36,570	ペルーナ	2.3	2.4	4,260
トーエール	5.6	5.3	109,816	タカキュー	13.2	14.3	14,271	銀行業 (6.4%)	2.3	2.1	4,741
一六堂	5.5	5.8	4,007	ケーユー	20.2	21.9	5,037	島根銀行	27.4	29.6	25,633
オンリー	2.5	—	—	上新電機	9	9.2	1,692	じもとホールディングス	—	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	1.7	2.2	2,217	日本瓦斯	20.7	22.4	11,760	めざけフィナンシャルグループ	2.4	2.7	1,871
薬王堂	468.1	506.6	2,415,468	ロイヤルホールディングス	13.2	14.3	33,161	東宝ホールディングス	75.7	82.1	9,852
クワイエット・レストラン・ホールディングス	4.9	5.2	13,119	東天紅	19.5	19.6	81,046	九州フィナンシャルグループ	581.1	628.6	184,808
ツルハホールディングス	30	32.6	40,424	島忠	20.8	21.4	56,538	ゆうちょ銀行	15.1	16.3	25,313
サンマルクホールディングス	24.2	26.2	259,380	チヨダ	0.8	0.8	1,038	富士第一銀行	183.4	198.5	87,538
フェリシモ	8	9.5	23,674	ライフコーポレーション	12.4	13.6	18,890	三井住友銀行	31.6	34.3	430,247
トリドールホールディングス	2.9	2.7	2,926	リンガーハット	27	27.3	83,811	富山銀行	28.5	29.2	11,008
TOKYO BASE	13.8	14.9	29,338	さがみグループホールディングス	13.2	12.7	23,583	三井住友フィナンシャルグループ	680	770.7	339,878
ウィルプラスホールディングス	2.2	10.7	9,223	Mr Ma x HD	8.5	9.2	22,512	西日本フィナンシャルホールディングス	75.8	77.4	74,304
ジャパネット	—	4.6	7,787	テアライド	13.8	14.9	34,985	関西びらけフィナンシャルグループ	—	56.8	45,326
サツドラホールディングス	1.5	2	3,666	AOKIホールディングス	10	—	—	三十三フィナンシャルグループ	—	10.4	16,650
デファクトスタンダード	—	0.7	277	オークワ	14	16.6	8,316	新日本フィナンシャルグループ	—	21	62,958
ダイエー・リタックホールディングス	5.2	6.5	6,376	コメリ	10.6	11.5	4,531	新生銀行	96.8	88.8	128,582
パロックスジャパンリミテッド	8.9	9.7	8,778	青山商事	22.3	24.2	30,371	あおぞら銀行	66.6	67.5	210,600
クワトロのアークホールディングス	8.9	12	86,520	しまむら	16	17.2	17,905	三井住友フィナンシャル・グループ	7,901.7	8,428.8	4,872,689
カノ源ホールディングス	—	3.4	2,652	はせがわ	17.2	18.7	51,574	りそなホールディングス	1,227.4	1,328	687,505
スズローグループホールディングス	10.7	13.3	86,450	高島屋	21.4	21.1	57,265	三井住友トラスト・ホールディングス	219.9	237.9	971,107
L I X I L ビバ	10.6	10.2	14,983	近鉄百貨店	13	14.1	133,950	第三住友フィナンシャルグループ	846.5	853	3,350,584
メディカルシステムネットワーク	12.7	12.9	5,830	パルコ	5.9	6.1	2,403	第四銀行	13.7	—	—
総合メディカル	4.9	—	—	丸井グループ	175	94.7	135,610	北越銀行	11.2	—	—
はるやまホールディングス	5.2	5.5	4,526	アクシアル リテイリング	22.5	24.3	25,636	千葉銀行	401	428.7	288,943
ノジマ	19.6	21.6	42,098	ヤオコー	52.9	62.1	95,261	群馬銀行	227.1	242	112,046
カッパ・クリエイト	13.9	16.9	23,085	セイオホールディングス	4.3	4.7	15,933	武蔵野銀行	17.8	18	43,182
ライトオン	9.4	10.2	8,282	イズミ	10.7	11.7	12,343	千葉興業銀行	30.8	33.3	11,322
ジーンズメイト	3.4	3.7	1,439	東武ストア	107	102.3	206,134	筑波銀行	46.6	50.4	10,735
良品計画	14.8	17.1	458,622	平和堂	9.3	10	34,350	七十七銀行	35.1	37.9	68,182
三城ホールディングス	13.8	15.1	6,160	ヤオコー	6.3	6.4	1,267	青森銀行	8.7	9.4	24,947
アドヴァン	11.4	18.6	18,432	セイオホールディングス	429.7	465.1	1,040,196	秋田銀行	7.2	7.7	16,285
アルビス	2.5	4.6	10,925	ケーズホールディングス	20.2	24.5	130,830	山形銀行	12.6	13.7	26,098
コナカ	14.3	15.7	6,923	Olympicグループ	1.3	—	—	岩手銀行	7.8	8.5	27,497
ハウス オブ ローゼ	1.4	1.5	2,755	日産東京販売ホールディングス	22.7	24.5	61,127	東邦銀行	99.9	108.2	32,676
G-7ホールディングス	3.3	3.5	8,011	Genky DrugStores	13.1	14.6	26,980	東北銀行	5.8	6.3	6,659
イオン北海道	11.2	12.3	9,692	総合メディカルホールディングス	12.7	13.8	80,454	みちのく銀行	7.2	7.7	12,435
コジマ	19.3	17.7	10,389	ブックオフグループホールディングス	15.2	14.6	18,746	ふくおかフィナンシャルグループ	454	98.3	229,235
ヒマラヤ	3.1	3.9	3,900	アインホールディングス	47.3	125.5	122,864	静岡銀行	295	304.5	263,088
コーナン商事	15.9	15.9	43,375	元気寿司	6.6	7.1	4,671	十六銀行	15	16.2	36,693
エコス	4.5	4.5	7,533	ヤマダ電機	16.4	18.2	5,733	スルガ銀行	114.4	123.7	56,407
ワタミ	13.2	15.9	22,371	アークランドサカモト	4.4	4.7	12,464	八十二銀行	202.4	218.9	98,286
マルシェ	3	3.3	2,557	ニトリホールディングス	—	10.5	20,065	山梨中央銀行	69	15	19,980
パンパシフィック・インターナショナルホールディングス	72.4	72.5	475,600	グルメ軒屋	—	6.4	4,876	大垣共立銀行	17.7	19.1	42,764
西松屋チェーン	24.5	26.5	23,691	VTホールディングス	15	16.2	125,712	福岡銀行	9.6	10.3	15,851
セシオンホールディングス	57.9	57	133,608	VTホールディングス	2.8	3.4	12,920	北國銀行	12.7	12.9	42,183
幸楽苑ホールディングス	7.1	7.6	17,145	VTホールディングス	374.3	368	193,568	清水銀行	3.8	5	8,075
ハークスレイ	2.7	2.7	3,015	VTホールディングス	18.9	20.5	29,048	富山銀行	2.2	2.3	7,003
サイゼリヤ	16.6	19.9	40,755	VTホールディングス	44.3	52.4	739,364	滋賀銀行	105	24.2	59,532
					8	8.8	9,970	南都銀行	13.1	14.2	31,012

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
百五銀行	107.3	108.8	40,256	保険業 (2.3%)				シーアールイー	1.8	4	3,612
京都銀行	42.7	43.4	194,649	かんぽ生命保険	42.2	45.7	113,244	プロバティエーゼント	—	1.1	1,300
紀陽銀行	42	42.9	65,250	SOMP Oホールディングス	219.3	213.3	853,839	ケイアイスター不動産	4	3.2	6,092
三重銀行	5	—	—	ANICOM ホールディングス	7.6	9.4	27,664	アグレ都市デザイン	—	1.5	915
ほくほくフィナンシャルグループ	74.4	80.6	97,284	MS&ADインフラストラクチャーホールディングス	292.4	316.5	1,019,763	グッドコムアセット	—	2.2	3,399
広島銀行	165.1	178.5	107,635	ソニーフィナンシャルホールディングス	91.9	99.4	208,143	ジェイ・エス・ビー	—	0.4	1,570
山陰合同銀行	66.3	71.8	54,137	第一生命ホールディングス	632.7	684.7	1,195,143	パーク24	62	70.6	184,124
中国銀行	77.3	78.1	78,334	東京海上ホールディングス	421.3	438.8	2,343,630	バラク	3.6	3.1	5,266
鳥取銀行	3.6	4.3	5,779	T&Dホールディングス	345.9	374.2	506,105	三井不動産	558.5	642.2	1,702,793
伊予銀行	159.6	160.3	95,218	アドバンスクリエイト	2.6	2.8	4,958	三菱地所	832.5	847.9	1,617,793
百十四銀行	119	12.9	31,243	その他金融業 (1.2%)				平和不動産	19.8	23	47,564
四国銀行	17.1	17.3	17,697	全国保証	31.5	34.1	133,331	東京建物	122.2	132.2	176,883
阿波銀行	90	19.4	58,976	ジェイリース	—	2.6	949	ダイビル	28.8	35.6	38,092
大分銀行	6.4	7.4	24,198	イントラスト	—	3.4	1,485	京阪神ビルディング	18.6	21.7	19,356
宮崎銀行	7.4	8	21,120	日本モーゲージサービス	—	1.6	2,118	住友不動産	268	272	1,120,640
佐賀銀行	6.8	7.3	12,577	C A S A	—	4.1	4,739	大京	17.8	—	—
十八銀行	69	7.4	19,158	アルヒ	9.6	11	25,300	テオーシー	38.6	27.7	22,935
沖縄銀行	10.9	11.1	34,798	プレミアグループ	—	2.5	7,975	東京楽天地	1.8	1.9	8,787
琉球銀行	21.7	27.9	29,685	クレディセゾン	84.9	84.7	118,749	レオパレス 2 1	133.5	149.3	76,889
セブン銀行	419.5	408.8	139,400	アクロシティ	6.3	—	—	スターツコーポレーション	15.2	16.4	40,508
みずほフィナンシャルグループ	15,195.2	16,445.7	2,851,684	芙蓉総合リース	12.8	13.9	75,338	フジ住宅	14.3	15.4	13,167
高知銀行	4.1	4.5	3,312	興銀リース	21	22.7	57,113	空港施設	11.7	14.4	7,804
山口フィナンシャルグループ	105	151.1	165,152	東京センチュリー	22.5	24.4	122,976	明和地所	6.2	6.7	4,087
長野銀行	3.7	4.1	6,154	日本証券金融	45.8	53.3	32,353	ゴールドクレスト	8.8	9.5	15,333
名古屋銀行	9	9.8	31,556	アイフル	187.8	184.4	51,263	日本エスリード	4.4	4.7	7,440
北洋銀行	168.6	182.3	51,773	リコリース	8.8	9.5	32,347	日神不動産	14.9	17.8	7,938
愛知銀行	3.8	4.4	14,960	イオンフィナンシャルサービス	79.4	77.2	162,274	日本エスコ	20.1	21.9	17,979
第三銀行	6.3	—	—	アコム	224.9	243.2	88,768	タカラレーベン	52.4	56.6	19,753
中京銀行	4.6	5	10,660	ジャックス	13.6	13.4	25,285	サンヨーハウジング名古屋	5.8	6.8	6,276
大光銀行	3.8	4	6,564	オリエントコーポレーション	242.1	327.1	39,906	イオンモール	72.1	60.6	111,988
愛媛銀行	15.6	16.9	17,491	日立キャピタル	30.8	28.6	70,070	ファースト住建	4.2	4.6	5,345
トマト銀行	4.3	4.8	5,020	アプラスフィナンシャル	54.4	58.7	4,813	ランド	241.4	492.6	4,433
みなと銀行	10.1	—	—	オリックス	746	807.5	1,328,337	カチタス	11.4	13.5	47,452
京葉銀行	99	53.4	34,977	三菱UFJリース	283.9	273.1	153,209	トーセイ	13.6	16.6	17,944
関西アーバン銀行	15.6	—	—	九州リースサービス	4.8	5.9	4,082	穴吹興産	1.2	1.3	3,602
栃木銀行	57.9	62.7	14,295	日本取引所グループ	328.6	326.8	615,691	エヌ・ティ・ティ都市開発	69.5	—	—
北日本銀行	3.5	3.9	7,959	イー・ギャランティ	3	11.3	12,068	サンフロンティア不動産	12.6	16.7	20,958
東和銀行	19.6	21.2	14,416	アサックス	1.6	4.9	2,631	エフ・ジェー・ネクスト	8.6	10.5	9,114
福島銀行	10.6	10.5	4,021	NECキャピタルソリューション	4.6	5	8,020	インテリクス	3.2	3.5	2,271
大東銀行	5.4	5.8	3,520	不動産業 (2.5%)				ランドビジネス	6.9	6.2	4,817
トモニホールディングス	92.2	93.5	36,839	いちご	159.8	153.9	57,712	グランディハウス	9.9	10.6	4,526
フィデアホールディングス	108.6	117.8	15,903	日本駐車場開発	135.1	145.8	23,328	日本空港ビルデング	32.7	38.6	165,015
池田泉州ホールディングス	118.6	128.5	38,164	ヒューリック	233.5	252.6	252,600	サービス業 (4.8%)			
証券・商品先物取引業 (0.8%)				三栄建築設計	4.5	4.9	8,202	日本工営	7.3	7.8	19,624
F P G	39.1	38.7	39,938	スター・マイカ	4.1	5.5	8,019	L I F U L L	37.7	40.7	27,798
マセキアイニベストメント	2.3	4.7	3,431	野村不動産ホールディングス	74.4	80.6	172,967	ジェイエイシークルメント	8.7	9.4	21,291
S B Iホールディングス	126.5	144.2	317,384	三井交通グループホールディングス	22.7	24.6	15,055	日本M&Aセンター	37.5	87.3	247,320
日本アジア投資	10.1	10.5	2,089	サムティ	9.5	16.7	24,949	メンバーズ	2.7	4	5,588
ジャフコ	16.1	19.8	74,646	ディア・ライフ	11.3	15.4	6,945	中広	1.2	1.1	612
大和証券グループ本社	957	971.1	541,776	コーセーアールイー	1.9	3.7	2,793	タケエイ	11.3	12.2	9,064
野村ホールディングス	1,924	2,129.4	925,224	エー・ディー・ワークス	150	171.5	5,831	E・Jホールディングス	—	1.5	1,570
岡三証券グループ	95	103.1	48,766	日本商業開発	6.3	7.5	11,392	トラスト・テック	4.9	5.6	18,452
丸三証券	35.6	35.9	28,684	フルサンスコーポレーション	15.3	19.1	29,261	コジダホールディングス	5.7	31.3	50,048
東洋証券	40	43.4	7,030	ユニゾホールディングス	13.1	18.3	39,820	アルトナー	—	2.2	1,975
東光証券フィナンシャル・ホールディングス	123.8	144.3	67,676	T H E グローバル社	5.3	5.5	2,695	パソナグループ	10.3	14.3	19,919
光世証券	2.7	2.9	2,108	日本管理センター	7.4	7.9	6,809	C D S	3	2.9	3,262
水戸証券	34.7	35.1	9,126	サンセイラントック	3.3	3.2	2,512	リンクアンドモチベーション	19.9	21.6	19,548
いちよし証券	23.5	25.4	21,793	エストラスト	1.6	1.6	1,228	G C A	12.4	12	9,408
松井証券	54.7	59.3	68,788	フジヤースホールディングス	27.2	27	18,144	エス・エム・エス	21.4	43.1	79,691
だいこう証券ビジネス	5.5	5	1,995	オープンハウス	18.2	19.7	89,438	パソナホールディングス	100	117.3	228,148
マネックスグループ	118.7	113	42,488	東急不動産ホールディングス	270.8	325.4	197,192	リニカル	7	6.6	9,292
カブドットコム証券	71.6	90.4	47,460	飯田グループホールディングス	93.3	101	202,808	クックパッド	34.1	36.7	11,010
極東証券	15	16.2	18,500	イーランド	—	1.8	1,225	エスクリ	3.8	3.2	1,913
岩井コスモホールディングス	11.4	12.4	14,892	ムゲンエステート	6.9	8.5	5,015	アイ・ケー・ケー	6.4	5.8	4,170
藍澤證券	20.9	22.7	14,800	ピーロット	—	2	2,554	学情	5	4.7	6,152
マネーパートナーズグループ	14.3	14.2	4,146	ファーストブラザーズ	3.1	3.3	3,521	スタジオアリス	5.4	5.8	13,885
小林洋行	3.3	3.4	887	ハウスドゥ	1.8	4.5	7,551	シミックホールディングス	6	6.5	10,036

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
N J S	千株	千株	千円	東京個別指導学院	千株	千株	千円	東祥	千株	千株	千円
総合警備保障	2.7	2.6	3,900	サイバーエージェント	3.8	4.2	5,590	エイチ・アイ・エス	6.7	7.2	24,048
カカコム	43.1	46.6	222,748	楽天	71.2	72.3	226,660	ラクランド	16.9	20.9	88,616
アイロムグループ	83.3	88.3	177,306	クリーク・アンド・リバー社	555.6	546.6	442,199	共立メンテナンス	2.1	2.3	4,462
セントレア・ホールディング	3.7	4.5	6,984	ター・オー・ダブリュー	5.6	6.8	7,786	イチメンホールディングス	19.3	17.8	88,377
サイネックス	4.6	6.4	3,545	セントラルスポーツ	9.7	11.2	8,142	建設技術研究所	12.1	12.3	15,153
ルネサンス	1.6	1.8	1,314	フルキャストホールディングス	4	4.4	14,850	スバル興業	7.5	8	11,192
ディップ	5.3	6.5	12,707	エン・ジャパン	9.5	11.8	23,163	東京テアトル	7	7.6	9,477
オプトホールディング	15.3	18.9	37,308	リゾルホールディングス	—	12.8	54,848	ダナベ経営	2.1	2.3	2,948
新日本科学	7.6	7.1	11,381	テクノプロ・ホールディングス	1.2	1.3	5,434	ナガワ	2.2	3.3	3,755
ツクイ	13.2	15.9	11,495	アトラ	19.3	23.6	142,072	よみうりランド	2.6	2.6	6,492
キャリアデザインセンター	25.5	27.6	22,024	インターワークス	1.9	2.3	931	東京都競馬	0.8	0.7	3,885
ベネフィット・ワン	2.5	3	3,594	アイ・アールジャパンホールディングス	2.4	2.3	1,720	常盤興産	4.5	4.6	5,805
エムスリー	—	16.2	61,803	Keep'er 技研	—	3.8	4,841	カナモト	2.1	2.3	2,948
ツカガ・グローバルホールディング	114	246.9	382,695	ファーストロジック	3.5	3.9	3,681	東京ドーム	2.1	3.3	18,018
プラス	8.7	7.5	4,612	三機サービス	1.7	2.3	1,591	西尾レントオール	2.4	2.6	10,530
アウトソーシング	0.6	0.8	468	Gunosy	1.2	1.9	2,696	アゴラ・ホスピタリティ・グループ	8.1	7.6	23,218
ウェルネット	32.3	61.8	81,205	デザインワン・ジャパン	4.9	7.2	18,194	トランス・コスモス	4.4	4.8	7,603
ワールドホールディングス	11	11.9	12,387	イー・ガーディアン	2.1	2.3	729	乃村工務社	16.5	17.4	51,591
ディー・エヌ・エー	3.6	3.2	8,755	リブセンス	5.5	5.5	12,012	KNT-CTホールディングス	43.9	43.8	42,310
博報堂D Yホールディングス	58.4	63.2	109,209	ジャパンマテリアル	7.1	6.3	1,814	西尾レントオール	9.5	12	39,300
ぐるなび	150.6	163	267,809	ベクトル	9.9	32.1	42,660	白洋舎	62	63	1,827
エスアールジータカミヤ	17.2	16.6	11,387	ウチヤマホールディングス	13	14.3	19,934	セコム	12	13	27,079
ジャパネットホスピタリティシステム	12.8	12.2	8,381	ライクキッズネクスト	5.4	5.9	2,708	白洋舎	25.3	27.3	81,627
ファンコミュニケーションズ	13.5	9.3	11,522	I B J	1.1	2.5	2,170	藤田観光	4.3	4.7	12,657
ライク	30.2	32.2	18,450	アサンテ	3.1	4.3	1,522	日本管財	6.7	6.3	7,673
ビジネス・ブレイクスルー	4.3	4.6	4,604	N・フィールド	8.6	7.8	6,466	トーカイ	11.6	12.6	24,028
WDBホールディングス	5.2	4.9	1,631	パリュウHR	3.9	4.7	10,283	白洋舎	10.5	11.3	31,425
ティア	5	5.3	13,901	M&Aキャピタルパートナーズ	6.1	7.5	6,720	セコム	1.2	1.3	3,590
CDG	5.7	5.4	3,348	ライドオンエクスプレスホールディングス	2.5	2.5	4,560	セントラル警備保障	115	124.4	1,124,824
パリュウコマース	1	1	1,324	ER Iホールディングス	2.2	3	17,070	丹青社	5.2	5.6	23,968
インフォマート	9.7	7.8	15,038	アビスト	4.4	4.8	6,158	メイテック	22.2	22.2	25,885
J Pホールディングス	54.8	64.3	76,517	シグマクシス	3.1	3.3	2,517	応用地質	12.7	14.8	71,114
Eコナックホールディングス	34.1	33.5	9,916	ウィルグループ	1.5	1.9	5,956	船井総研ホールディングス	12.2	12.6	14,905
E P Sホールディングス	21.7	22.2	2,686	エスグロー・エージェンシー・ジャパン	4.3	5.5	4,515	進学会ホールディングス	22.5	24.3	55,209
レックス	16.3	17.6	30,606	日本郵便	4.7	7.5	6,982	オオバ	5	5.2	3,078
プレステージ・インターナショナル	2.7	2.9	2,784	リクルートホールディングス	14.9	16.1	4,025	イオンディライト	8.6	9.3	5,635
アミューズ	22.5	22	28,974	エラン	2.4	3.8	4,195	ニチエ学館	2.2	2.3	2,267
ドリームインキュベータ	7.2	7.1	17,984	土本管理総合試験所	835.9	839.9	2,449,148	ダイセキ	3	4	5,500
クイック	3.6	3.5	5,155	日本郵政	2.7	8	10,168	ステップ	39.7	43	125,732
TAC	6.7	6.8	1,591	鎌倉新書	614.8	961.1	1,270,574	ナック	13.4	14.4	58,248
ケネディクス	143.5	103	61,491	一蔵	18.2	19.6	27,871	ニチエ学館	7.3	7.4	7,718
電通	132	142.9	718,787	L I T A L I C O	1.5	8.6	13,295	ダイセキ	20.6	16.7	21,693
ティクアンドギヴ・ニーズ	5.1	4.5	8,883	グローバブルアジア	1.4	1.5	933	ステッ	18.2	19.6	50,509
ぴあ	3.6	3.3	12,952	エポラブルアジア	1.9	2.7	5,470	株数・金額	4	4.4	6,261
イオンファンタジー	3.5	3.8	9,975	アラエ	1.2	1.4	1,332	銘柄数<比率>	千株	千株	千円
シーティーエス	11.1	13.3	8,684	ストライク	—	2.3	7,652	合計	137,421.8	142,571.8	275,040,369
ネクシースグループ	4.3	3.7	6,278	セラク	1	3	6,429	銘柄数<比率>	2,049銘柄	2,113銘柄	<98.5%>
みらかホールディングス	32.3	32.9	94,686	インソース	6.5	28.5	30,922	(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。			
アルプス技研	9.5	10.2	18,492	ベイクレント・コンサルティング	1.9	2.6	1,549	(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。			
サンックス	17.4	20.5	4,223	アイモバイル	1.3	3.9	8,572	(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。			
ダイオーズ	2.2	2.8	3,628	キャリアインテックス	—	6.2	19,313				
日本空調サービス	11.4	13.4	8,656	MS - J a p a n	—	4.7	8,460				
オリエンタルランド	128	138.6	1,608,453	船場	1.1	4	5,116				
ダスキン	29.1	31.6	79,537	グレイステクノロジー	0.8	2.1	1,801				
明光ネットワークジャパン	13.7	14.8	13,571	ジャロエレベーターサービスホールディングス	—	3.2	7,120				
ファルコホールディングス	5.6	6.5	9,321	フルテック	—	6.9	11,964				
秀英予備校	2.4	2.5	1,215	グリーンズ	—	1.3	1,433				
田谷	2	2.1	1,316	ツナグ・ソリューションズ	—	2.6	3,751				
ラウンドワン	33.6	36.3	46,972	日総工業	—	1	648				
リゾートトラスト	45.9	49.6	77,921	キュービーネットホールディングス	—	2.9	6,162				
ビー・エム・エル	13.9	15.1	46,885	スプリックス	—	5.9	11,522				
ワタベエディン	1.8	1.9	1,265	アドバンテッジリスクマネジメント	—	3.3	7,850				
りらいあコミュニケーションズ	17.1	21.2	19,398	リロググループ	2.7	4.6	4,508				
リソー教育	18.4	59.5	27,608		59.3	64.1	186,338				
早稲田アカデミー	1.6	1.6	2,892								
ユー・エス・エス	132.3	143.3	276,425								

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		末
		買建額	売建額	額
国内	T O P I X	百万円 4,121		百万円 －

■投資信託財産の構成

2019年2月7日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	
株式	千円 275,040,369	% 98.4	
コール・ローン等、その他	4,522,857	1.6	
投資信託財産総額	279,563,227	100.0	

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月7日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	281,168,547,397円
コ	株	4,125,464,360
株	式(評価額)	275,040,369,410
未	収 入	89,044,788
差	入 委 託 配 証 当 拠	424,228,839
(B) 負	債	1,489,440,000
未	払 証 拠 金 代 用 約 価 証 金	1,984,233,000
差	入 委 託 証 拠 金 代 用 有 価 証 金	376,733,000
(C) 純	資 産 総 額(A-B)	1,607,500,000
元	次 期 繰 越 損 益 金	279,184,314,397
(D) 受	1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	115,232,523,115
		163,951,791,282
		115,232,523,115円
		24,228円

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2018年2月8日 至2019年2月7日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収	益
	受	取	配	当	金
	そ	の	他	収	益
	支	払	利	息	
(B)	有	価	証	券	売
	売			買	損
	売			買	益
(C)	先	物	取	引	等
	取			取	引
	取			引	損
(D)	そ	の	他	費	用
(E)	当	期	損	益	金(A + B + C + D)
(F)	前	期	繰	越	損 益 金
(G)	解	約	差	損 益 金	
(H)	追	加	信 託	差 損 益 金	
(I)	合	次	期	繰 越 損 益 金(I)	

(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)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2019年2月15日）

（計算期間 2018年2月16日～2019年2月15日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年9月2日から無期限です。
運 用 方 針	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 投 資 対 象	海外の株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	純 資 産 総 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
13期(2015年2月16日)	28,826	27.1	920,295.73	27.4	94.1	3.4	319,197
14期(2016年2月15日)	23,909	△17.1	764,772.48	△16.9	96.1	1.2	242,694
15期(2017年2月15日)	30,270	26.6	971,437.64	27.0	95.6	1.7	278,963
16期(2018年2月15日)	33,302	10.0	1,070,930.74	10.2	95.7	2.2	284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

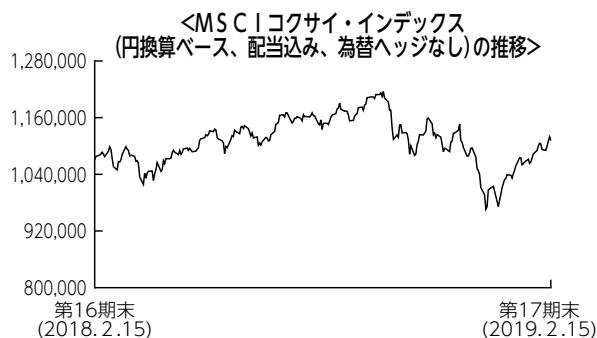
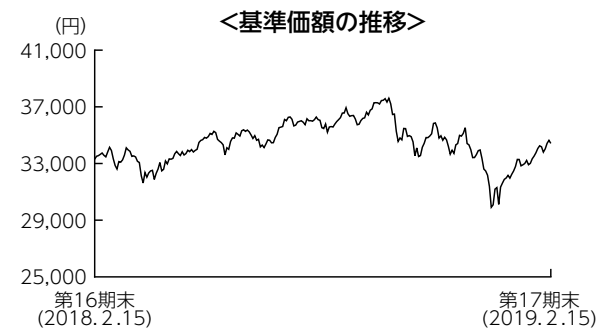
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月16日から2019年2月15日まで）



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

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



期末

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

（注1）比率は純資産総額に対する割合です。

（注2）業種は各決算日時点のGICS（世界産業分類基準）によるものです。

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■1万口当たりの費用明細

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

（注）金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（34,450円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2018年2月16日から2019年2月15日まで)

(1) 株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

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

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

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア SCENTRE GROUP	千口 93.268 (-)	千オーストラリア・ドル 360 (-)	千口 - (-)	千オーストラリア・ドル - (-)
香港 LINK REIT	千口 22 (-)	千香港・ドル 1,735 (-)	千口 - (-)	千香港・ドル - (-)
シンガポール ASCENDAS REAL ESTATE INVT CAPITALAND COMMERCIAL TRUST SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	千口 - (-) 384.8 (-) - (-)	千シンガポール・ドル - (△2) 673 (-) - (△2)	千口 - (-) 178.5 (-) - (-)	千シンガポール・ドル - (-) 305 (-) - (-)
イギリス LAND SECURITIES GROUP PLC SEGRO PLC	千口 33.384 (-) 42.887 (-)	千イギリス・ポンド 311 (-) 247 (-)	千口 12.296 (-) 21.086 (-)	千イギリス・ポンド 114 (-) 138 (-)
ユーロ (オランダ) UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	千口 3.332 (10.338)	千ユーロ 493 (-)	千口 1.609 (-)	千ユーロ 244 (-)
ユーロ (フランス) COVIVIO UNIBAIL-RODAMCO SE	千口 2.332 (-) 3.117 (△10.338)	千ユーロ 196 (-) 602 (-)	千口 - (-) - (-)	千ユーロ - (-) - (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 109,193	百万円 108,526	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	92,002,372千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	299,138,263千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.30

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

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

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
H&R BLOCK INC	161.14	161.14	389	43,067	各種消費者サービス
BOEING CO	395.46	476.45	19,525	2,156,437	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	81.58	108.27	717	79,253	専門サービス
BORGWARNER INC	146.48	215.54	878	96,978	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	975.41	1,198.2	4,783	528,258	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	98.94	117.55	1,066	117,748	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	72.33	101.53	947	104,594	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	18.38	21.42	1,419	156,819	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,166.34	1,426.27	7,249	800,660	医薬品
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	37.88	52.15	549	60,721	資本市場
INGREDION INC	53.05	53.05	494	54,569	食品
ONEOK INC	261.77	374.02	2,493	275,433	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	44.18	59	570	62,983	保険
UNITED RENTALS INC	63.32	76.93	1,013	111,894	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	169.12	230.49	2,628	290,317	総合公益事業
FEDEX CORP	181.03	215.25	3,958	437,218	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	63.21	96.48	1,689	186,584	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	214.9	252.01	2,297	253,688	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	136.12	235.58	1,133	125,195	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,270.92	1,532.41	907	100,189	メディア
CSX CORP	639.92	710.27	5,087	561,881	陸運・鉄道
CABOT OIL & GAS CORP	322.61	382.55	945	104,439	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	140.5	140.5	484	53,455	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	206.13	243.37	1,113	123,019	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	122.4	145.53	2,531	279,594	飲料
CARDINAL HEALTH INC	221.25	269.19	1,494	164,997	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	249.16	354.48	2,024	223,539	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	422.78	521.82	6,920	764,286	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.32	112.32	1,340	148,011	ソフトウェア
CELGENE CORP	547.31	608.71	5,519	609,604	バイオテクノロジー
CITRIX SYSTEMS INC	108.96	125.26	1,330	146,914	ソフトウェア
CENTURYLINK INC	636.8	804.24	1,027	113,512	各種電気通信サービス
CERNER CORP	208.09	264.14	1,500	165,694	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,489.45	2,927.32	29,981	3,311,169	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	188.22	222.43	1,431	158,076	家庭用品
CIGNA CORP	175.95	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	109.82	142.86	1,199	132,514	保険
CINTAS CORP	62.82	79.44	1,600	176,704	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	3,545.12	4,106.72	19,876	2,195,163	通信機器
CLOROX COMPANY	93.31	108.85	1,701	187,954	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	2,862.56	3,520.46	16,049	1,772,537	飲料
COPART INC	—	189.44	1,021	112,831	商業サービス・用品
COGNEX CORP	115.08	152.91	747	82,528	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	598.19	710	4,646	513,209	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	224.36	263.13	3,121	344,710	ホテル・レストラン・レジャー
COMERICA INC	120.68	149.31	1,249	137,953	銀行
NRG ENERGY, INC.	—	256.31	1,092	120,615	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
COMCAST CORP-CL A	3,332.55	3,943.84	14,694	1,622,887	メディア
CA INC	227.32	—	—	—	ソフトウェア
CONAGRA BRANDS INC	283.23	405.73	962	106,286	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	217.5	267.33	2,086	230,404	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	192.91	236.16	1,239	136,927	総合公益事業
COOPER COS INC	37.94	44.84	1,237	136,683	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BREWING CO	138.55	162	969	107,061	飲料
CORNING INC	656.41	686.91	2,316	255,883	電子装置・機器・部品
WR GRACE & CO	33.14	—	—	—	化学
SEALED AIR CORP	138.7	138.7	583	64,488	容器・包装

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額	期末	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円	
CUMMINS INC	112.39	131.93	1,997	220,580	機械
DR HORTON INC	244.98	321.52	1,279	141,324	家庭用耐久財
DANAHER CORP	445.24	552.86	6,101	673,834	ヘルスケア機器・用品
MOODY'S CORP	118.22	154.93	2,536	280,149	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	415.89	503.31	3,680	406,441	情報技術サービス
TARGET CORP	374.86	436.5	3,150	347,958	複合小売り
DEERE & CO	193.64	262.37	4,261	470,630	機械
MORGAN STANLEY	962.61	1,132.17	4,610	509,150	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	173.75	198.91	1,522	168,162	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	22.78	29.94	1,220	134,835	専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,087.74	1,280.37	14,168	1,564,777	娯楽
DOLLAR TREE INC	174.93	200.78	1,978	218,481	複合小売り
DOVER CORP	107.36	126.35	1,138	125,684	機械
OMNICOM GROUP	169.93	193.25	1,435	158,532	メディア
DTE ENERGY CO	131.22	160.34	1,911	211,096	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	492.92	611.77	5,372	593,345	電力
FLOWERVE CORP	84.06	131.39	608	67,242	機械
DARDEN RESTAURANTS INC	94.36	109.9	1,229	135,817	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	707.31	832.27	3,022	333,838	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	7,087.28	8,277.12	23,498	2,595,201	銀行
CITIGROUP INC	1,934.5	2,166.9	13,525	1,493,788	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	101.93	130.09	1,063	117,465	化学
E*TRADE FINANCIAL CORP	187.4	216.24	1,006	111,192	資本市場
EATON CORP PLC	322.34	384.09	2,965	327,473	電気設備
EATON VANCE CORP	91.84	91.84	368	40,662	資本市場
CADENCE DESIGN SYS INC	208.77	249.22	1,287	142,188	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	161.5	217.62	646	71,380	メディア
ECOLAB INC	190.09	221.92	3,586	396,087	化学
ELECTRONIC ARTS INC	217.66	272.14	2,864	316,330	娯楽
SALESFORCE.COM INC	482.4	624.35	9,956	1,099,596	ソフトウェア
EMERSON ELECTRIC CO	456.25	543.24	3,611	398,849	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	82.21	102.2	980	108,309	ガス
ENTERGY CORP	121.99	162.59	1,458	161,051	電力
EOG RESOURCES INC	399.63	507.26	4,918	543,187	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	84.95	102.31	1,114	123,081	専門サービス
EQT CORP	171.49	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	161.34	194.24	2,979	329,028	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	125.5	147.92	1,094	120,823	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	389.11	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	2,987.36	3,696.52	28,193	3,113,674	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	89.7	126.34	1,060	117,163	化学
NEXTERA ENERGY INC	335.13	412.34	7,529	831,584	電力
ASSURANT INC	40.89	40.89	397	43,862	保険
FASTENAL CO	216.54	254.18	1,585	175,082	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	521.73	600.5	1,592	175,878	銀行
M&T BANK CORP	97.99	124.94	2,113	233,385	銀行
FISERV INC	140.95	357.37	3,014	332,912	情報技術サービス
FLIR SYSTEMS INC	116.23	116.23	598	66,081	電子装置・機器・部品
MACY'S INC	192.66	247.41	621	68,692	複合小売り
FORD MOTOR CO	2,618.95	3,243.91	2,731	301,652	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	223.14	285.48	904	99,850	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	968.12	1,172.69	1,425	157,486	金属・鉱業
FLEX LTD	359.13	676.69	692	76,452	電子装置・機器・部品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	121.76	164.78	1,299	143,548	保険
GAP INC/THE	182.95	182.95	455	50,350	専門小売り
DENTSPLY SIRONA INC	174.77	174.77	763	84,309	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	179.42	221.43	3,810	420,865	航空宇宙・防衛

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株		千アメリカ・ドル	千円	
TELEFLEX INC	32.03	39.05		1,099	121,410	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	638.53	805.53		1,391	153,727	医薬品
ANDEAVOR	115	—		—	—	石油・ガス・消耗燃料
TEXAS INSTRUMENTS INC	696.26	846.28		9,052	999,775	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	190.76	221.99		1,198	132,389	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	280.65	353.36		8,697	960,563	ライフサイエンス・ツール／サービス
TIFFANY & CO	87.33	87.33		788	87,120	専門小売り
TOLL BROTHERS INC	95.26	—		—	—	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	76.99	106.61		872	96,346	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	112.79	143.84		1,324	146,307	情報技術サービス
DAVITA INC	108.78	108.78		631	69,787	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	92.76	110.88		1,062	117,288	専門小売り
TRIMBLE INC	200.73	200.73		779	86,036	電子装置・機器・部品
TYSON FOODS INC	216.21	246.07		1,505	166,262	食品
UGI CORP	120.68	147.25		780	86,238	ガス
MARATHON OIL CORP	587.47	718.46		1,214	134,175	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	566.17	638.7		10,834	1,196,536	陸運・鉄道
UNITED TECHNOLOGIES CORP	536.9	709.43		8,806	972,551	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	683.78	839.99		22,287	2,461,426	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	63.51	77.43		1,035	114,357	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	68.48	84.38		1,111	122,795	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	243.09	300.57		2,584	285,376	繊維・アパレル・贅沢品
CBS CORP	237.81	307.11		1,507	166,533	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	177.42	223.69		4,154	458,808	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	89.64	121.42		1,368	151,113	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	632.86	719.45		5,187	572,957	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,061.26	1,270.54		12,517	1,382,417	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	322.16	369.86		3,655	403,735	商業サービス・用品
WATERS CORP	59.63	69.53		1,609	177,766	ライフサイエンス・ツール／サービス
ALLERGAN PLC	233.13	296.2		4,107	453,621	医薬品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	76.71	104.59		1,062	117,288	食品
VAIL RESORTS INC	25.98	37.73		781	86,325	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	205.16	260.76		1,251	138,174	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	54.97	75.3		542	59,917	機械
WHIRLPOOL CORP	55.53	55.53		763	84,368	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	135.29	162.96		1,362	150,529	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	62.79	92.4		1,140	125,956	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	91.32	91.32		795	87,904	資本市場
CME GROUP INC	242.03	304.37		5,399	596,323	資本市場
WILLIAMS COS INC	610.81	1,061.74		2,851	314,956	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	229.48	266.9		706	77,994	販売
ALLIANT ENERGY CORP	163.83	199.1		893	98,684	電力
WEC ENERGY GROUP INC	231.17	280.63		2,084	230,183	総合公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	186.31	256.64		1,424	157,305	資本市場
CARMAX INC	135.13	159.79		977	107,930	専門小売り
XEROX CORP	174.55	174.55		520	57,504	コンピュータ・周辺機器
XILINX INC	168.37	210.93		2,478	273,764	半導体・半導体製造装置
CIMAREX ENERGY CO	70.03	92.53		692	76,509	石油・ガス・消耗燃料
TJX COMPANIES INC	439.99	1,073.99		5,316	587,126	専門小売り
ZIONS BANCORP NA	165.84	165.84		811	89,617	銀行
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	—	274		243	26,931	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	764	764		545	60,244	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	157	157		1,109	122,587	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	171		667	73,746	コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	60.51	81.92		680	75,119	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	41.71	41.71		554	61,251	銀行
CBRE GROUP INC	209.76	294.99		1,459	161,199	不動産管理・開発

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

銘	柄	期 首(前期末)	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC		18.26	—	—	—	家庭用品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE		1,339.61	1,769.14	3,340	368,884	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC		128.73	151.11	1,095	120,958	機械
ALKERMES PLC		120.53	120.53	391	43,261	バイオテクノロジー
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV		230.62	289.87	2,502	276,338	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC		34.79	34.79	746	82,407	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC		106.74	122.4	1,646	181,855	ソフトウェア
HCA HEALTHCARE INC		201.73	241.78	3,438	379,758	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC		100.53	134.05	1,660	183,338	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		39.87	54.74	686	75,762	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		65.44	74.43	1,641	181,252	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA		106.68	136.76	1,361	150,342	銀行
CIT GROUP INC		92.87	92.87	465	51,395	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV		226.52	306	2,807	310,065	半導体・半導体製造装置
TARGA RESOURCES CORP		164.45	178.11	803	88,713	石油・ガス・消耗燃料
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST		4,056	—	—	—	運送インフラ
LEAR CORP		51.32	61.72	960	106,076	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC		70.4	100.84	934	103,171	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC		106.33	170	957	105,777	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP		193.55	222.91	2,641	291,774	複合小売り
FORTINET INC		113.99	113.99	948	104,728	ソフトウェア
AON PLC		184.87	209.42	3,552	392,302	保険
TESLA INC		93.57	109.91	3,338	368,730	自動車
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV		113.92	—	—	—	電気設備
GENERAL MOTORS CO		911.38	1,100.5	4,279	472,666	自動車
WORLDPAY INC		104.48	265.92	2,319	256,120	情報技術サービス
XPO LOGISTICS INC		—	128.25	763	84,346	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC		92.63	92.63	535	59,088	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALLY FINANCIAL INC		314.09	398.19	1,058	116,932	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD		99.58	121.38	544	60,175	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC		135.25	135.25	656	72,549	各種金融サービス
APTIV PLC		190.69	225.71	1,797	198,546	自動車部品
PHILLIPS 66		309.76	381.15	3,645	402,631	石油・ガス・消耗燃料
FACEBOOK INC		1,675.84	2,102.8	34,475	3,807,463	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC		100.51	134.26	1,894	209,262	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		70.54	131.09	1,361	150,320	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC		122.06	150.71	3,527	389,529	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC		62.15	79.35	1,786	197,317	ソフトウェア
TESARO INC		26.46	—	—	—	バイオテクノロジー
WORKDAY INC		91.87	123.76	2,333	257,697	ソフトウェア
ABBVIE INC		1,122.99	1,319.76	10,626	1,173,613	バイオテクノロジー
ZOETIS INC		344.25	422.09	3,936	434,737	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD		122.24	198.21	1,034	114,245	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC		314.4	385.41	427	47,161	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A		302.63	302.63	378	41,778	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC		128.91	128.91	560	61,887	商社・流通業
CDW CORP		108.24	130.4	1,223	135,156	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP		638.82	638.82	394	43,600	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		101.99	101.99	368	40,673	旅客航空輸送業
ARCONIC INC		275.13	367.61	642	71,007	航空宇宙・防衛
ENVISION HEALTHCARE CORP		86.92	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		131.75	178.52	555	61,335	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A		50.06	50.06	201	22,308	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C		133.68	179.31	723	79,924	メディア
XL GROUP LTD		171.66	—	—	—	保険
BROADCOM LTD		287.37	—	—	—	半導体・半導体製造装置
DELL TECHNOLOGIES INC		150.74	—	—	—	ソフトウェア

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
GOLDCORP INC	510.66	819.02	1,174	97,469	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	250.52	379.42	1,015	84,293	保険
POWER FINANCIAL CORP	174.84	277.73	776	64,444	保険
ROYAL BANK OF CANADA	1,039.45	1,255.49	12,639	1,048,912	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	131.34	131.34	441	36,612	建設・土木
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	106.07	128.84	3,454	286,728	陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	275.48	357.48	960	79,686	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,168.95	1,424.03	6,157	511,011	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	352.68	718.05	435	36,171	金属・鉱業
ENCANA CORP	692.57	1,275.17	1,108	91,963	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	410.16	1,173	97,352	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	204.69	192.18	1,345	111,643	専門サービス
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,311.89	1,574.19	11,745	974,720	銀行
TRANSCANADA CORP	628.95	805.43	4,539	376,725	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	56.96	56.96	410	34,087	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	31.05	82.39	796	66,084	食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	107.85	127.16	1,386	115,027	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	339.43	424.47	1,195	99,198	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	14.94	17.29	1,958	162,526	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	127.87	168.87	1,674	138,982	金属・鉱業
CI FINANCIAL CORP	206.95	206.95	387	32,151	資本市場
TOURMALINE OIL CORP	157.79	274.1	547	45,404	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	137.28	232.06	653	54,251	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	125.38	239.44	366	30,382	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	308.5	437.84	2,109	175,104	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	75.04	282.95	997	82,750	複合小売り
STARS GROUP INC	—	185.29	394	32,753	ホテル・レストラン・レジャー
CENOVUS ENERGY INC W/I	805.45	805.45	894	74,264	石油・ガス・消耗燃料
VERMILION ENERGY INC	82.91	129.23	416	34,587	石油・ガス・消耗燃料
ARC RESOURCES LTD	229.97	229.97	228	18,951	石油・ガス・消耗燃料
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	306.31	—	—	—	各種金融サービス
INTER PIPELINE LTD	240.83	386.09	832	69,049	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	453.51	542.24	3,877	321,753	化学
WSP GLOBAL INC	—	84	578	48,031	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	—	129.97	633	52,550	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	149.61	149.61	277	23,044	石油・ガス・消耗燃料
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	172.31	172.31	178	14,786	石油・ガス・消耗燃料
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	153.53	206.64	1,752	145,475	ホテル・レストラン・レジャー
AURORA CANNABIS INC	—	500	471	39,129	医薬品
SHOPIFY INC	50.21	76.71	1,798	149,216	情報技術サービス
CANOPY GROWTH CORP	—	186.34	1,141	94,765	医薬品
HYDRO ONE LTD	133.54	273.4	569	47,262	電力
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	28,933.66 86銘柄	36,595.21 88銘柄	155,446 —	12,900,481 <3.7%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	111.15	111.15	641	50,283	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	2,038.83	2,516.48	6,678	523,279	銀行
AMCOR LTD	807.41	1,101.42	1,614	126,510	容器・包装
WESTPAC BANKING CORPORATION	2,399.94	2,932.6	7,680	601,765	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	305.69	305.69	303	23,759	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,141.25	1,141.25	721	56,511	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	2,729.19	3,606.54	1,132	88,727	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	390.14	390.14	384	30,139	銀行
AMP LTD	2,004.98	3,024.14	680	53,311	各種金融サービス
ASX LTD	102.9	155.73	1,075	84,263	資本市場
BHP GROUP LTD	2,320.53	2,596.25	9,520	745,927	金属・鉱業
CALTEx AUSTRALIA LTD	209.46	209.46	582	45,606	石油・ガス・消耗燃料

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	評 価 額 邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	221.82	221.82	78	6,117	複合小売り
COMPUTERSHARE LT	380.4	380.4	710	55,644	情報技術サービス
CSL LIMITED	322.12	396.08	7,418	581,214	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	41.19	41.19	313	24,526	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	1,495.91	2,233.54	2,722	213,322	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	486.01	486.01	418	32,823	飲料
COCHLEAR LTD	39.92	53.74	1,058	82,947	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,217.21	1,630.57	1,213	95,049	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,212.08	1,535.19	10,836	849,071	銀行
BORAL LIMITED	861.01	861.01	419	32,853	建設資材
RIO TINTO LIMITED	268.22	325.62	2,992	234,458	金属・鉱業
APA GROUP	732.53	1,161.93	1,074	84,209	ガス
ARISTOCRAT LEISU	373.93	531.68	1,329	104,184	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,714.71	2,067.89	1,548	121,352	保険
TPG TELECOM LTD	287.19	287.19	198	15,525	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32.75	32.75	139	10,933	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	284.89	460.91	795	62,293	建設資材
ORICA LTD	253.08	253.08	457	35,830	化学
CIMIC GROUP LTD	87.09	87.09	424	33,278	建設・土木
BLUESCOPE STEEL LTD	369.41	369.41	449	35,195	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	851.3	851.3	590	46,289	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	216.27	282.5	3,543	277,669	資本市場
WORLEYPARSONS LTD	—	358.28	549	43,061	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	931.81	1,079.13	1,400	109,745	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,928.82	2,341.96	5,674	444,602	銀行
NEWCREST MINING LTD	515.33	696.38	1,739	136,294	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	937.15	1,388.06	1,113	87,221	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,364.26	1,364.26	454	35,594	化学
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	953.9	1,294.36	1,453	113,886	保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	457.07	457.07	338	26,536	各種金融サービス
SANTOS LTD	1,338.62	1,338.62	891	69,850	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	261.92	430.41	1,019	79,888	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	—	50	145	11,380	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	1,263.48	1,942.74	880	68,952	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	810.21	968.21	3,222	252,459	複合小売り
ALUMINA LIMITED	1,846.13	1,846.13	483	37,896	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM LTD	602.49	791.15	2,810	220,238	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	912.94	1,175.57	3,503	274,475	食品・生活必需品小売り
SEEK LTD	258.99	258.99	433	33,948	専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	45.81	45.81	212	16,643	ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	287	22,503	電力
AGL ENERGY LTD	463.15	606.49	1,322	103,637	総合公益事業
BRAMBLES LTD	1,152.55	1,440.62	1,623	127,207	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	398	31,230	ホテル・レストラン・レジャー
AURIZON HOLDINGS LTD	1,391.84	1,909.69	866	67,929	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	507.89	691.79	1,169	91,600	飲料
HEALTHSCOPE LTD	1,490.47	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MEDIBANK PVT LTD	1,771.76	2,734.24	754	59,126	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	3,670.57	4,431.6	1,684	131,942	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	—	968.21	1,210	94,824	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 銘 柄 数 < 金 額 数 < 比 率 >	53,166.94 59銘柄	65,230.79 61銘柄	105,393 —	8,257,557 < 2.4% >
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH	166	327	2,951	41,523	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	2,981	41,949	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	762.6	1,536.6	4,256	59,887	銀行
CLP HOLDINGS LTD	1,195	1,495	14,082	198,146	電力

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

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

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

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

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
		株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(スイス)		百株	百株	千円	千円	
JULIUS BAER GROUP LTD		152.27	178.49	706	77,530	資本市場
SWISS RE LTD		206.38	276.09	2,651	291,142	保険
UBS GROUP AG		2,606.39	3,364.64	4,288	470,848	資本市場
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	11,728.58 36銘柄	14,896.88 38銘柄	101,038 —	11,094,022 <3.2%>	
(デンマーク)		百株	百株	千円	千円	
CARLSBERG AS-B		73.3	96.44	7,665	128,083	飲料
A P MOLLER A/S		4.81	6.04	5,407	90,351	海運業
AP MOLLER MAERSK A		2.73	2.73	2,293	38,319	海運業
DANSKE BANK A/S		501.88	611.14	7,486	125,098	銀行
GENMAB A/S		38.99	56.22	5,655	94,507	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS		159.04	191.11	5,620	93,919	化学
NOVO NORDISK A/S-B		1,317.28	1,596.6	52,448	876,411	医薬品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		158.08	158.08	8,820	147,396	電気設備
TDC A/S		689.39	—	—	—	各種電気通信サービス
COLOPLAST-B		82.86	112.12	7,043	117,694	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S		130.4	171.23	8,965	149,815	陸運・鉄道
WILLIAM DEMANT		65.37	65.37	1,447	24,184	ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S		48.4	48.4	1,369	22,888	医薬品
TRYG A/S		111.07	111.07	1,913	31,978	保険
PANDORA A/S		82.51	82.51	2,777	46,408	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		77.08	77.08	5,042	84,261	化学
ISS A/S		111.25	162.4	3,087	51,587	商業サービス・用品
ORSTED A/S		116	172.49	8,253	137,918	電力
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	3,770.44 18銘柄	3,721.03 17銘柄	135,297 —	2,260,823 <0.6%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千円	千円	
MOWI ASA		248.16	330	6,482	82,721	食品
DNB ASA		704.26	797.83	12,833	163,750	銀行
NORSK HYDRO ASA		918.79	1,371.9	4,683	59,763	金属・鉱業
TELENO ASA		531.78	620.76	10,040	128,120	各種電気通信サービス
ORKLA ASA		614.21	848.09	5,665	72,288	食品
EQUINOR ASA		814.14	983.97	19,261	245,773	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA		112.79	160	5,432	69,312	化学
AKER BP ASA		—	85.52	2,473	31,558	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		166.83	166.83	2,507	31,995	保険
SCHIBSTED ASA		—	74.45	2,162	27,596	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	4,110.96 8銘柄	5,439.35 10銘柄	71,542 —	912,880 <0.3%>	
(スウェーデン)		百株	百株	千円	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS		483.77	571.91	13,960	165,848	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS		257.93	383.14	8,752	103,983	機械
ERICSSON LM-B SHS		2,217.48	2,717.83	23,465	278,773	通信機器
GETINGE AB-B SHS		131.53	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
LUNDBERGS B		36.91	73.82	2,087	24,801	各種金融サービス
SKF AB-B SHS		248.66	371.98	5,706	67,789	機械
SANDVIK AB		767.81	967.46	14,221	168,953	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		959.18	1,475.88	14,071	167,163	銀行
SKANSKA AB-B SHS		211.79	325.47	5,301	62,986	建設・土木
SWEDBANK AB		665.07	824.1	16,918	200,995	銀行
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		1,083.88	1,265.39	12,812	152,207	銀行
VOLVO AB-B SHS		1,136.72	1,416.08	18,819	223,578	機械
SWEDISH MATCH AB		114.81	164.88	7,444	88,438	タバコ
TELE2 AB-B SHS		269.76	448.76	5,387	64,001	無線通信サービス
NORDEA AB		2,186.2	—	—	—	銀行
INDUSTRIVARDEN C		114.03	114.03	2,100	24,953	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B		191.91	191.91	4,504	53,509	家庭用耐久財

銘柄	株数	当 株数	期 末 価 額		業 種 等
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SECURITAS AB-B SHS	240.98	240.98	3,432	40,781	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	334.12	376.57	15,364	182,524	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	664.48	777.79	10,766	127,902	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	686.13	883.27	16,442	195,331	建設関連製品
TELIA CO AB	1,849.27	2,318.55	9,144	108,635	各種電気通信サービス
LUNDIN PETROLEUM AB	167.9	167.9	4,993	59,320	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	218.55	218.55	5,093	60,508	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	174.11	233.43	4,649	55,241	機械
KINNEVIK AB-B	183.1	183.1	3,918	46,549	各種金融サービス
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	53.32	53.32	2,975	35,346	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	59.2	59.2	2,074	24,650	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	336.92	2,495	29,643	家庭用耐久財
HEXAGON AB	183.6	220.37	10,181	120,951	電子装置・機器・部品
EPIROC AB-A	—	633.58	5,726	68,028	機械
EPIROC AB-B	—	308.99	2,620	31,132	機械
ESSITY AB-B	397.97	525.22	13,435	159,609	家庭用品
NORDEA BANK ABP	—	2,678.38	22,404	266,167	銀行
小 計	株数・金 銘柄 数<比率>	株数・金 銘柄 数<比率>	291,271	3,460,306	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	589.56	713.94	1,909	238,112	建設資材
PADDY POWER BETFAIR PLC	62.46	62.46	441	55,057	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	115.76	138.65	1,270	158,434	食品
KINGSPAN GROUP PLC	—	147.56	561	69,985	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	—	173.97	469	58,564	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	732.87	1,063.63	566	70,616	銀行
AIB GROUP PLC	523.22	523.22	202	25,245	銀行
小 計	株数・金 銘柄 数<比率>	株数・金 銘柄 数<比率>	5,422	676,016	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	412.7	515.53	5,525	688,913	航空宇宙・防衛
BOSKALIS WESTMINSTER CT	75.63	—	—	—	建設・土木
RELX NV	708.26	—	—	—	専門サービス
KONINKLIJKE DSM NV	132.16	151.11	1,390	173,331	化学
ING GROEP NV-CVA	2,728.8	3,412.95	3,659	456,249	銀行
RANDSTAD NV	77.94	120.61	550	68,692	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	914.26	1,096.41	2,505	312,360	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	173.73	230.51	2,010	250,670	飲料
AKZO NOBEL	182.09	187.86	1,473	183,748	化学
ASML HOLDING NV	274.21	360.62	5,860	730,724	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,204.04	1,503.49	659	82,180	保険
UNILEVER NV-CVA	1,155.3	1,348.83	6,572	819,502	パーソナル用品
KONINKLIJKE PHILIPS NV	675.29	832.6	2,889	360,215	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	205.58	250.51	1,394	173,908	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	458.66	556.11	811	101,160	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	136.42	173.87	589	73,532	ライフサイエンス・ツール/サービス
VOPAK (KON.)	53.64	53.64	234	29,185	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV	2,289.67	2,910.29	791	98,696	各種電気通信サービス
HEINEKEN HOLDING NV-A	80.14	97.91	819	102,115	飲料
FERRARI NV	83.38	108.95	1,202	149,898	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	786.45	943.17	879	109,645	機械
NN GROUP NV	219.65	285.28	1,062	132,493	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	767.19	899.77	1,162	144,940	自動車
ABN AMRO GROUP NV	291.29	342.51	685	85,408	銀行
EXOR NV	77.26	77.26	425	53,038	各種金融サービス
ALTICE EUROPE NV	434.03	—	—	—	メディア
小 計	株数・金 銘柄 数<比率>	株数・金 銘柄 数<比率>	43,155	5,380,611	
			—	<1.5%>	

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

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

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

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

銘柄	株数	当 期		末 期		業 種 等
		株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NOKIA OYJ	4,172.48	4,959.75	2,745	342,336	通信機器	
ELISA OYJ	95.17	141.76	518	64,689	各種電気通信サービス	
METSO OYJ	85.85	85.85	245	30,666	機械	
NESTE OYJ	88.39	108.4	943	117,637	石油・ガス・消耗燃料	
KONE OYJ	237.17	291.24	1,282	159,844	機械	
ORION OYJ	80.51	80.51	237	29,612	医薬品	
小 計	株 数 金 額 銘柄 数 比 率	6,348.57 12銘柄	7,796.14 12銘柄	11,003 —	1,371,872 <0.4%>	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
OMV AG	97.66	128.17	585	73,029	石油・ガス・消耗燃料	
VERBUND AG	—	67.78	284	35,459	電力	
VOEST-ALPINE AG	98.75	98.75	247	30,854	金属・鉱業	
ERSTE GROUP BANK AG	207.54	251.17	766	95,576	銀行	
ANDRITZ AG	62.65	62.65	272	33,978	機械	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	96.41	96.41	212	26,456	銀行	
小 計	株 数 金 額 銘柄 数 比 率	563.01 5銘柄	704.93 6銘柄	2,368 —	295,355 <0.1%>	
合 計	株 数 金 額 銘柄 数 比 率	808,041.16 1,249銘柄	975,274.54 1,245銘柄	—	333,346,813 <95.3%>	

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

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

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	株数	当 期		末 期	
		口 数	口 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	比 率
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7.304	9.644	1,291	142,604	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	11.168	13.309	1,771	195,651	0.1
SL GREEN	5.382	7.097	645	71,301	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77.528	125.554	1,288	142,267	0.0
PROLOGIS INC	38.966	55.164	3,908	431,640	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	9.642	12.353	2,417	267,014	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	6.285	8.062	794	87,799	0.0
EQUINIX INC	5.448	6.964	2,928	323,477	0.1
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10.544	13.649	713	78,836	0.0
DUKE REALTY TRUST	24.47	32.954	978	108,054	0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28.166	35.534	4,219	466,019	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4.524	5.653	1,570	173,466	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	27.07	32.976	2,411	266,293	0.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4.144	6	805	88,939	0.0
GGP INC	43.463	—	—	—	—
HCP INC	34.13	39.277	1,215	134,210	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	8.169	10.277	1,892	209,054	0.1
WELLTOWER INC	26.516	33.309	2,580	284,984	0.1
KIMCO REALTY	32.98	32.98	583	64,396	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	11.649	11.649	553	61,083	0.0
IRON MOUNTAIN INC	19.265	23.977	845	93,395	0.0
THE MACERICH COMPANY	9.014	9.014	392	43,324	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	51.147	64.001	1,173	129,632	0.0
MID AMERICA	8.123	10.258	1,063	117,401	0.0
REALTY INCOME CORP	18.985	26.616	1,857	205,116	0.1
REGENCY CENTERS CORP	11.294	13.023	856	94,579	0.0
UDR INC	17.458	21.658	966	106,774	0.0

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

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%
ICADE	2.234	2.234	164	20,569	0.0
KLEPIERRE	17.042	17.042	507	63,233	0.0
COVIVIO	2.343	4.675	406	50,710	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE	7.221	—	—	—	—
小 計	口 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	口 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	金 額 1,541	金 額 192,214	比 率 —
	5銘柄<0.1%>	4銘柄<0.1%>	—	—	0.1
合 計	口 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	口 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	金 額 —	金 額 9,030,097	比 率 —
	65銘柄<2.2%>	64銘柄<2.6%>	—	—	2.6

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。
(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
S & P 5 0 0 E M I N I F U T	4,908	—
S & P / T S E 6 0 I X F U T	263	—
S P I 2 0 0 F U T U R E S	188	—
FTSE 100 INDEX FUTURE	445	—
D J E U R O S T O X X 5 0	1,174	—

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

■投資信託財産の構成

2019年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 333,346,813	% 94.0
投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券	9,030,097	2.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,119,648	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	354,496,559	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。
(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、349,667,585千円、98.6%です。
(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.44円、1カナダ・ドル=82.99円、1オーストラリア・ドル=78.35円、1香港・ドル=14.07円、1シンガポール・ドル=81.34円、1ニュージーランド・ドル=75.29円、1イギリス・ポンド=141.30円、1イスラエル・シェケル=30.36円、1スイス・フラン=109.80円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=12.76円、1スウェーデン・クローナ=11.88円、1ユーロ=124.68円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	354,641,793,311円
株 式 (評価額)	8,845,419,791
信 託 受 益 証 券 (評価額)	333,346,813,573
資 産 収 入 当 金 金 庫 証 拠	811,825,352
未 収 配 入 当 金 金 庫 証 拠	8,218,272,061
未 収 配 入 当 金 金 庫 証 拠	581,033,916
未 収 配 入 当 金 金 庫 証 拠	498,296,652
(B) 負 債	2,340,131,966
未 収 配 入 当 金 金 庫 証 拠	4,951,972,087
未 収 配 入 当 金 金 庫 証 拠	4,817,636,087
未 収 配 入 当 金 金 庫 証 拠	134,336,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	349,689,821,224
元 次 期 繰 越 損 益 本 金 数	101,602,311,525
(D) 受 取 万 益 当 権 総 損 益 口 額 (C / D)	248,087,509,699
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	101,602,311,525円
	34,418円

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

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

■損益の状況

当期 自2018年2月16日 至2019年2月15日

項 目					当 期
(A)	配当	受取	受取	受取	6,947,143,194円
				金	6,908,295,630
				息	10,909,289
				金	28,530,787
				息	△592,512
(B)	有価証券	買	売	買	5,056,491,180
				損	32,377,087,657
				益	△27,320,596,477
(C)	先物取引	等	取	引	217,753,623
				損	1,940,038,819
				益	△1,722,285,196
(D)	その他	費		用	△54,363,769
(E)	当期損益	金	(A + B + C + D)		12,167,024,228
(F)	前期繰越	損	益	金	199,033,935,190
(G)	解約差	損	益	金	△63,448,458,649
(H)	追加信託	差	損	益	100,335,008,930
(I)	合計	計	(E + F + G + H)		248,087,509,699
	次期繰越	損	益	金(I)	248,087,509,699

(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)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2019年2月14日）

（計算期間 2018年2月15日～2019年2月14日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年12月3日から無期限です。
運 用 方 針	NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主 要 投 資 対 象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合		債券組入 比 率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率	純 資 産 額
	円	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
12期 (2015年2月16日)	12,161	1.8	ポイント 359.95	1.8	98.5	—	—	百万円 422,496
13期 (2016年2月15日)	12,614	3.7	373.37	3.7	98.6	—	—	400,593
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	—	—	379,734
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

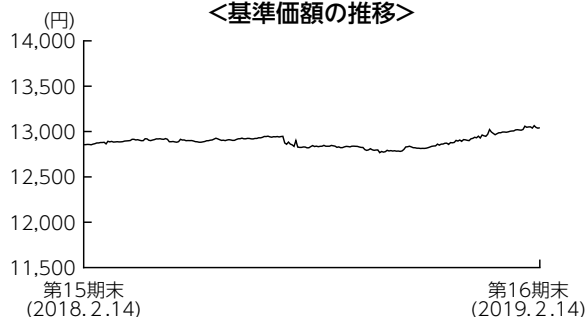
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入 比 率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2018 年 2 月 14 日	円	%	ポイント	%	%	%	%
	12,855	—	380.56	—	99.5	—	—
2 月 末	12,879	0.2	381.29	0.2	99.2	—	—
3 月 末	12,899	0.3	381.91	0.4	99.4	—	—
4 月 末	12,889	0.3	381.64	0.3	99.5	—	—
5 月 末	12,919	0.5	382.50	0.5	99.4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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月15日から2019年2月14日まで）

<基準価額の推移>



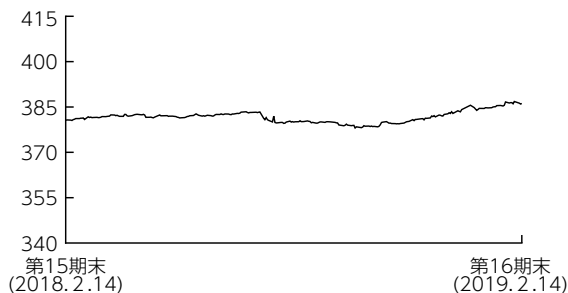
基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

<NOMURA-BPI総合の推移>



投資環境

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

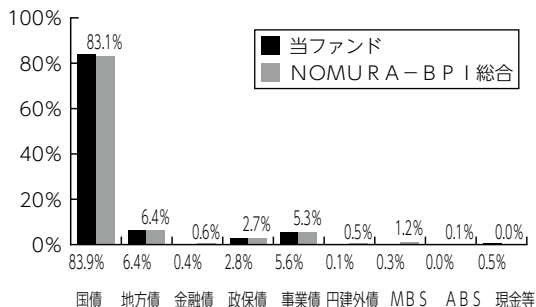
ポートフォリオについて

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

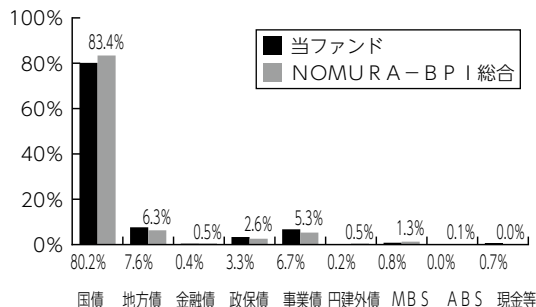
【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

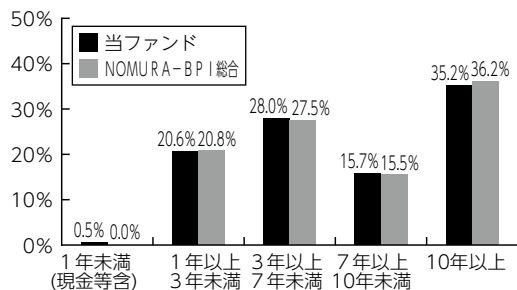


期末

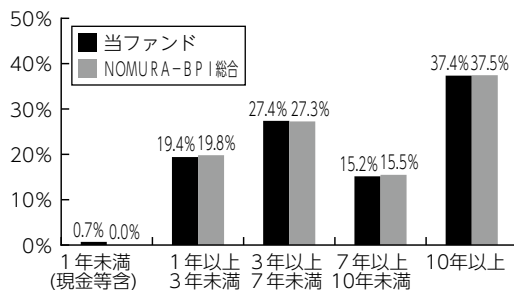


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークは、前期末比で1.5%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(12,890円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2018年2月15日から2019年2月14日まで)
公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。
(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

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

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
3 0 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.4000	1,500,000	1,525,800	2020/03/20
3 8 7 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,000,000	1,003,250	2020/04/15
3 8 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	800,000	802,792	2020/05/15
1 2 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,200,000	2,208,272	2020/06/20
3 0 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.3000	800,000	815,872	2020/06/20
3 0 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	1,000,000	1,017,150	2020/06/20
4 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	500,000	516,040	2020/06/22
3 9 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,200,000	1,204,620	2020/07/01
3 9 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	800,000	803,400	2020/09/01
1 2 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,000,000	3,013,170	2020/09/20
3 1 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,500,000	1,528,050	2020/09/20
3 1 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,020,000	1,035,810	2020/09/20
4 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	250,000	259,487	2020/09/21
3 9 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,000,000	1,004,480	2020/10/01
3 9 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	700,000	703,234	2020/11/01
1 2 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,500,000	2,512,700	2020/12/20
3 1 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.2000	2,200,000	2,255,726	2020/12/20
4 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.5000	500,000	524,725	2020/12/21
1 2 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,220,000	1,226,905	2021/03/20
3 1 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.3000	1,790,000	1,845,185	2021/03/20
3 1 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	800,000	821,312	2021/03/20
1 2 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,200,000	2,213,948	2021/06/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
3 1 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.2000	1,500,000	1,548,330	2021/06/20
3 1 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	500,000	514,930	2021/06/20
5 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	600,000	630,654	2021/06/21
1 2 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,420,000	2,437,012	2021/09/20
3 1 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	1,000,000	1,033,090	2021/09/20
3 1 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,600,000	1,648,784	2021/09/20
5 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	550,000	582,565	2021/09/21
1 3 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,100,000	1,108,481	2021/12/20
3 1 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	800,000	829,032	2021/12/20
3 2 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,500,000	1,550,145	2021/12/20
1 3 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,020,000	2,036,927	2022/03/20
3 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,600,000	1,658,144	2022/03/20
3 2 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.9000	1,000,000	1,033,240	2022/03/20
5 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	410,000	437,662	2022/03/21
1 3 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,000,000	2,018,140	2022/06/20
3 2 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.9000	750,000	776,970	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	850,000	877,710	2022/06/20
1 3 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,170,000	1,181,629	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,500,000	1,552,620	2022/09/20
5 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	600,000	644,916	2022/09/20
1 3 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	780,000	788,299	2022/12/20
3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.7000	500,000	516,830	2022/12/20

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

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

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

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

銘 柄		当 期 末		
		利 率	額面金額	評 価 額 償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円
1 0 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.9000	1,050,000	1,123,279
1 1 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.8000	480,000	496,252
小 計		—	212,600,000	234,177,067
(地方債証券)		%	千円	千円
6 8 0 回	東京都公募公債	1.3900	200,000	202,988
3 3 6 回	大阪府公募公債	1.4600	200,000	203,202
2 2 年 度 1 回	広島県公募公債	1.3700	200,000	203,454
6 8 5 回	東京都公募公債	1.1300	500,000	507,445
2 回	川崎市公募公債 1 5 年	1.6300	100,000	102,174
2 2 年 度 6 回	愛知県公募公債	1.1780	200,000	203,368
2 2 年 度 8 回	静岡県公募公債	1.0590	200,000	203,170
6 8 8 回	東京都公募公債	0.9400	200,000	202,928
2 2 年 度 3 回	横浜市公募公債	1.1680	200,000	203,654
2 2 年 度 5 回	横浜市公募公債	1.2650	200,000	204,536
3 4 5 回	大阪府公募公債	1.2600	300,000	306,858
9 4 回	共同発行市場公募地方債	1.2400	100,000	102,372
2 2 年 度 1 2 回	北海道公募公債	1.2900	200,000	204,918
2 3 年 度 1 回	千葉市公募公債	1.3700	200,000	205,886
2 3 年 度 2 回	埼玉県公募公債	1.1900	200,000	205,320
6 9 7 回	東京都公募公債	1.1100	500,000	512,750
9 9 回	共同発行市場公募地方債	1.1700	700,000	718,991
7 0 1 回	東京都公募公債	0.9900	700,000	717,570
2 3 年 度 4 回	横浜市公募公債	1.0450	450,000	462,640
2 3 年 度 9 回	静岡県公募公債	1.0450	200,000	205,690
3 5 6 回	大阪府公募公債	1.0600	200,000	205,900
1 0 6 回	共同発行市場公募地方債	0.9700	300,000	308,406
2 3 年 度 2 0 回	愛知県公募公債	1.0820	500,000	516,625
1 0 9 回	共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	516,505
7 0 8 回	東京都公募公債	0.8900	500,000	514,625
1 1 1 回	共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	720,545
3 6 4 回	大阪府公募公債	0.7900	300,000	308,292
1 9 4 回	神奈川県公募公債	0.7910	300,000	308,949
2 4 年 度 7 回	千葉県公募公債	0.7400	300,000	308,370
1 1 9 回	共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	515,795
1 2 1 回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	511,625
2 5 年 度 4 回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	310,809
7 2 0 回	東京都公募公債	0.8700	300,000	311,136
2 5 年 度 4 回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	206,816
2 5 年 度 2 回	横浜市公募公債	0.8880	400,000	415,416
3 7 4 回	大阪府公募公債	0.9380	300,000	312,198
2 5 年 度 5 回	千葉県公募公債	0.8400	200,000	207,496
1 2 6 回	共同発行市場公募地方債	0.8100	793,900	823,163
1 2 7 回	共同発行市場公募地方債	0.6800	500,000	515,710
1 2 8 回	共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	309,306

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)		%	千円	千円	
7 2 6 回	東京都公募公債	0.7300	400,000	413,948	2023/12/20
2 5 年 度 1 1 回	福岡県公募公債	0.6940	200,000	206,880	2024/02/26
2 0 8 回	神奈川県公募公債	0.5510	300,000	308,685	2024/06/20
1 回	兵庫県公募公債 (1 2 年)	1.1000	300,000	317,364	2024/06/26
2 6 年 度 5 回	埼玉県公募公債	0.6110	400,000	413,108	2024/07/29
1 3 7 回	共同発行市場公募地方債	0.5660	500,000	515,340	2024/08/23
4 8 8 回	名古屋市公募公債 1 0 年	0.5980	450,000	464,796	2024/09/20
1 3 9 回	共同発行市場公募地方債	0.5440	500,000	515,190	2024/10/25
2 6 年 度 1 1 回	京都府公募公債	0.4760	350,000	359,534	2024/12/19
1 4 2 回	共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	509,955	2025/01/24
2 6 年 度 1 7 回	兵庫県公募公債	0.4600	200,000	205,302	2025/02/26
5 回	東京都公募公債 2 0 年	2.1100	100,000	112,779	2025/03/19
1 4 4 回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	411,228	2025/03/25
1 4 6 回	共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	413,600	2025/05/23
1 4 8 回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	517,470	2025/07/25
1 回	静岡県公募公債 2 0 年	2.1800	100,000	114,298	2025/09/19
9 回	東京都公募公債 2 0 年	2.4400	200,000	235,646	2026/06/19
1 0 回	東京都公募公債 2 0 年	2.3300	300,000	352,782	2026/09/18
4 回	京都市公募公債 2 0 年	2.5100	100,000	118,960	2026/09/18
1 6 6 回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	505,355	2027/01/25
2 9 年 度 4 回	大阪市公募公債	0.1500	200,000	201,538	2027/09/21
3 0 年 度 7 回	神戸市公募公債 3 0 年	0.2540	300,000	303,813	2028/09/20
2 4 年 度 2 回	福岡県公募公債 (2 0 年)	1.6350	300,000	351,966	2032/08/16
1 4 回	埼玉県公募公債 2 0 年	1.5460	300,000	352,377	2034/05/08
小	計	—	21,443,900	22,249,515	—
(特殊債券)		%	千円	千円	
1 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.3000	500,000	507,220	2020/03/13
1 5 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.0000	200,000	203,126	2020/08/14
2 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.2000	300,000	307,218	2021/01/20
9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	100,000	104,106	2021/03/26
2 4 回	地方公共団体金融機構債券	1.2080	300,000	308,169	2021/05/28
1 8 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.2000	300,000	317,124	2021/08/30
1 4 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	400,000	411,680	2021/11/30
3 6 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	309,315	2022/05/20
9 6 回	高速道路機構債	0.7960	700,000	719,138	2022/09/20
1 8 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.7340	1,000,000	1,030,380	2022/12/28
4 4 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	413,924	2023/01/20
5 5 回	鉄道建設・運輸施設整備	0.8420	500,000	516,280	2023/03/20
1 8 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	512,435	2023/04/28
1 9 3 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	520,425	2023/06/30
5 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	521,265	2023/07/14
1 9 5 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	344,196	2023/07/31
1 1 6 回	高速道路機構債	0.7220	100,000	103,129	2023/09/20
5 6 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	563,474	2024/01/19

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

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

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
1 1 回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	312,486	2022/12/20
1 8 回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	105,410	2022/12/20
5 1 8 回 中部電力社債	0.1900	200,000	200,078	2023/01/25
1 4 回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	207,076	2023/03/20
1 0 回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	102,836	2023/03/20
4 7 回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	205,664	2023/03/20
3 0 1 回 北陸電力社債	1.1580	100,000	103,984	2023/03/24
2 3 回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	312,129	2023/06/09
2 7 回 N T T データ社債	0.9000	100,000	103,527	2023/06/20
2 5 3 回 四国電力社債	1.0000	200,000	207,264	2023/06/23
6 回 J X ホールディングス社債	1.1190	100,000	104,316	2023/07/19
3 7 7 回 中国電力社債	1.1210	400,000	416,868	2023/08/25
1 0 回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	327,003	2023/09/20
4 8 回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	103,512	2023/10/20
4 7 回 住友商事社債	0.8580	100,000	103,114	2023/10/23
4 2 4 回 九州電力社債	1.2330	200,000	209,670	2023/11/24
1 3 回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	218,732	2023/12/20
3 8 回 電源開発社債	0.9780	300,000	310,788	2023/12/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
4 7 1 回 東北電力社債	1.1680	400,000	418,232	2023/12/25
4 2 6 回 九州電力社債	1.0640	400,000	416,568	2024/02/23
1 6 回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	205,518	2024/03/19
1 4 回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	110,801	2024/03/19
7 2 回 三菱地所社債	2.2800	100,000	111,836	2024/09/20
1 0 回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	205,118	2024/10/28
6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債	0.8650	200,000	205,482	2024/11/28
3 2 1 回 北海道電力社債	0.8860	161,000	166,007	2024/12/25
3 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	337,086	2025/06/20
1 3 回 電源開発社債	2.0400	200,000	221,980	2025/06/20
4 2 回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	226,254	2025/09/19
4 回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	139,885	2026/06/19
3 0 7 回 北陸電力社債	1.0550	100,000	105,548	2026/06/25
3 4 回 政保西日本高速道路債券	0.3350	200,000	203,580	2027/02/16
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	301,323	2027/04/23
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	201,320	2028/06/06
小 計	-	14,381,000	14,908,641	-
合 計	-	266,048,767	290,077,840	-

■投資信託財産の構成

2019年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	290,077,840	92.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	22,099,018	7.1
投 資 信 託 財 産 総 額	312,176,859	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	312,176,859,148円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	21,292,428,667
公 社 債(評価額)	290,077,840,370
未 収 利 息	770,374,276
前 払 費 用	36,215,835
(B) 負 債	20,063,933,000
未 払 解 約 金	20,063,933,000
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	292,112,926,148
元 次 本 金	223,973,156,427
期 繰 越 損 益	68,139,769,721
(D) 受 益 権 総 口 数	223,973,156,427口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	13,042円

(注1) 期首元本額 276,633,033,886円
 追加設定元本額 113,380,695,236円
 一部解約元本額 166,040,572,695円

(注2) 期末における元本の内訳

D I AM国内債券パッシブ・ファンド	18,190,812,393円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	96,924,740円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	78,480,076円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	24,093,695円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	812,042,492円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	224,528,250円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	30,531,946円
たわらノーロード 国内債券	5,608,098,569円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	204,097,771円
たわらノーロード バランス (堅実型)	49,073,204円
たわらノーロード バランス (標準型)	91,339,770円
たわらノーロード バランス (積極型)	14,731,205円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	5,325,112円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	111,510,295円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	145,094,270円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	38,636,385円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	12,398,109円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,927,516円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,439,484円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,668,109円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	652,905円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	17,517円
D I AM国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,094,592,898円
D I AM/バランス・ファンド<DC年金>1安定型	5,970,708,997円
D I AM/バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	8,327,473,971円
D I AM/バランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,375,978,536円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	1,787,117,039円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	1,979,799,847円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	311,374,467円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	87,494,470円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,329,877,194円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	1,151,978円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	3,138,341,596円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	760,934,771円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	161,069,244円
投資のソムリエ	4,442,528,933円
クルーズコントロール	2,280,157,246円
投資のソムリエ<DC年金>	414,716,710円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	2,350,099,207円
D I AM DC バランス・F (成長型)	282,293,752円
クルーズコントロール<DC年金>	1,617,997円
D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	7,792,604円
D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	20,568,924円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	518,138,794円
ダイナミック・ナビゲーション	1,967,915円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	8,646,074,074円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	1,457,017円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	1,137,081円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	3,528,101円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	2,289,786円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	74,378,770円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,193,667,722円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	290,676円
D I AMエマージング債券ファンド	9,450,010円
D I AM国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	7,747,418,144円
D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	427,767,841円
One&収益追求型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,650,787,553円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA	260,471,994円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA	208,048,280円
D I AM国際分散バランスファンド30VA	65,779,975円
D I AM国際分散バランスファンド50VA	178,262,613円
D I AM国内重視バランスファンド30VA	78,434,274円
D I AM国内重視バランスファンド50VA	34,112,030円
D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	74,517,588円
D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	153,733,627円
D I AM/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	5,107,603,663円
D I AM/バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,727,549,689円
D I AM/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,036,022,852円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA	549,567,315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)	244,393,101円
D I AM アクサ グローバル バランスファンド30VA	3,133,418,256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)	651,756,777円
D I AMグローバル8私募ファンド (適格機関投資家向け)	188,050,355円
D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	43,906,910円
D I AM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	75,249,648円
D I 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)	44,304,010,853円
D I AM世界アセット(バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	300,469,968円
D I AM世界アセット(バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	6,766,577,431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)	25,810,172,316円
D I AM/バランス30VA (適格機関投資家限定)	73,681,229円
D I AM/バランス50VA (適格機関投資家限定)	1,372,928円
D I AM/バランス70VA (適格機関投資家限定)	6,828,815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)	28,718,365,712円
D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	406,399,314円
D I AM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	124,390,494円
D I AM/バランス20VA (適格機関投資家限定)	499,470,914円
D I AM/バランス40VA (適格機関投資家限定)	697,893円
D I AM/バランス60VA (適格機関投資家限定)	371,935円
期末元本合計	223,973,156,427円

■損益の状況

当期 自2018年2月15日 至2019年2月14日

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

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

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2019年2月21日）

（計算期間 2018年2月22日～2019年2月21日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年12月10日から無期限です。
運 用 方 針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「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）」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		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入率	債券先物率	純 資 産 額
	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
16期 (2019年2月21日)	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	—	197,670

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークは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）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) F T S E 世界国債インデックスは、F T S E F i x e d I n c o m e L L Cにより運営されている債券インデックスです。F T S E F i x e d I n c o m e L L Cは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、F T S E F i x e d I n c o m e L L Cは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はF T S E F i x e d I n c o m e L L Cに帰属します（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

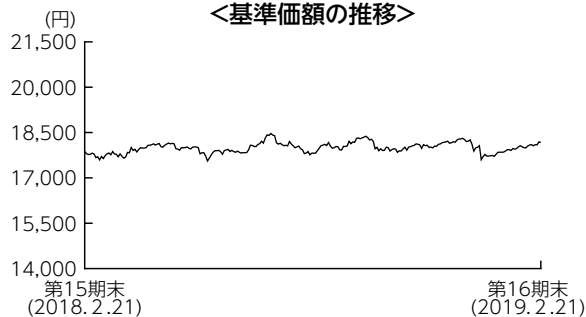
年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除 く 日 本 、 円 ベ ー ス 、 為 替 ヘ ッ ジ な し) (ベ ン チ マ ー ク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2018 年 2 月 21 日	円 17,876	% －	ポイント 111,885.82	% －	% 97.7	% －
2 月 末	17,790	△0.5	111,369.59	△0.5	98.1	－
3 月 末	17,907	0.2	112,110.56	0.2	96.6	－
4 月 末	18,127	1.4	113,447.49	1.4	101.8	－
5 月 末	17,660	△1.2	110,306.34	△1.4	97.4	－
6 月 末	17,925	0.3	112,167.37	0.3	97.3	－
7 月 末	18,060	1.0	113,026.89	1.0	97.4	－
8 月 末	18,047	1.0	112,887.86	0.9	97.0	－
9 月 末	18,348	2.6	115,005.76	2.8	97.2	－
10 月 末	18,016	0.8	112,853.40	0.9	97.9	－
11 月 末	18,179	1.7	113,725.26	1.6	97.5	－
12 月 末	18,064	1.1	112,822.19	0.8	97.6	－
2019 年 1 月 末	17,952	0.4	111,997.50	0.1	98.1	－
(期 末) 2019 年 2 月 21 日	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	－

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年2月22日から2019年2月21日まで）

＜基準価額の推移＞



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

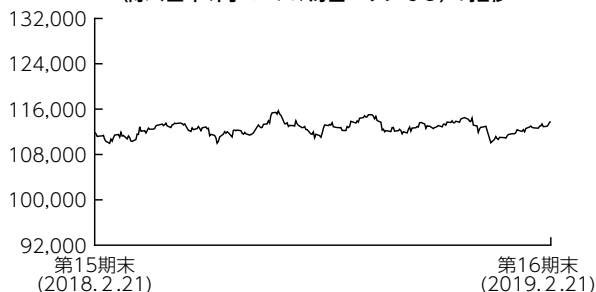
E C B（欧州中央銀行）が金融緩和政策を継続していることや、世界的に景気減速懸念が強まっていることを背景に、国債利回りが世界的に低下（価格は上昇）したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

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

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

＜FTSE世界国債インデックス （除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）の推移＞



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

ポートフォリオについて

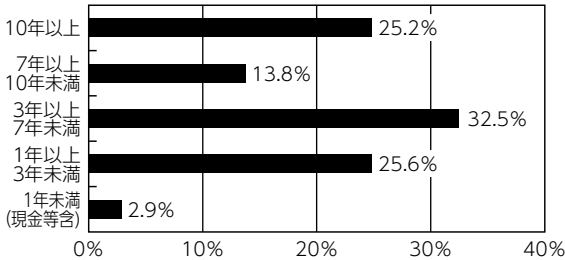
ベンチマークである F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

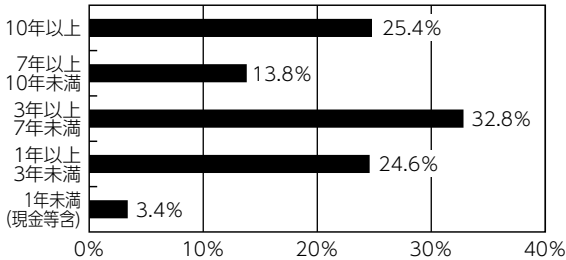
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国		当ファンド	世界国債インデックス	差
北米	米国	41.3%	41.9%	△0.6%
	カナダ	2.1%	2.2%	△0.1%
	計	43.4%	44.1%	△0.7%
中南米	メキシコ	0.8%	0.8%	△0.0%
	計	0.8%	0.8%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.6%	1.6%	△0.1%
	ベルギー	2.5%	2.7%	△0.1%
	フィンランド	0.6%	0.6%	△0.0%
	フランス	10.3%	10.5%	△0.2%
	ドイツ	7.1%	7.2%	△0.1%
	アイルランド	0.8%	0.9%	△0.1%
	イタリア	10.0%	10.2%	△0.2%
	オランダ	2.1%	2.1%	△0.1%
	スペイン	5.9%	6.1%	△0.1%
	ユーロ計	40.9%	41.9%	△1.0%
	デンマーク	0.6%	0.6%	△0.0%
	スウェーデン	0.5%	0.5%	△0.0%
	スイス	0.0%	0.2%	△0.2%
	英国	7.0%	7.3%	△0.2%
	ポーランド	0.7%	0.7%	△0.0%
	ノルウェー	0.3%	0.3%	△0.0%
	計	49.9%	51.4%	△1.5%
アジア・オセアニア	オーストラリア	2.2%	2.3%	△0.1%
	シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
	マレーシア	0.4%	0.5%	△0.1%
	計	2.9%	3.1%	△0.2%
アフリカ	南アフリカ	0.6%	0.6%	△0.0%
	計	0.6%	0.6%	△0.0%
現金など		2.3%	—	—
合計		100.0%	100.0%	—

期末

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

（注）世界国債インデックスとは F T S E 世界国債インデックス（除く日本）です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.01%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスになりました。
なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 費 用	2円	0.010%
（保 管 費 用）	(2)	(0.010)
（そ の 他）	(0)	(0.000)
合 計	2	0.010

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,996円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8 ページ（1 万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2018年2月22日から2019年2月21日まで）
公社債

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

（注）金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

■利害関係人との取引状況等（2018年2月22日から2019年2月21日まで）
期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 811,860	千アメリカ・ドル 813,428	千円 90,046,589	% 45.6	% －	% 18.6	% 17.2	% 9.7	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 42,320	千カナダ・ドル 45,974	千円 3,864,133	2.0	－	0.9	0.7	0.3	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 47,170	千オーストラリア・ドル 51,717	千円 4,118,815	2.1	－	1.4	0.6	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,770	千シンガポール・ドル 8,130	千円 666,012	0.3	－	0.2	0.1	－	
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 74,480	千イギリス・ポンド 91,989	千円 13,280,489	6.7	－	5.1	1.1	0.6	
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 44,900	千デンマーク・クローネ 58,974	千円 991,943	0.5	－	0.4	0.1	－	
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 29,640	千ノルウェー・クローネ 30,580	千円 393,883	0.2	－	0.1	0.1	－	
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデン・クローナ 48,610	千スウェーデン・クローナ 54,908	千円 652,318	0.3	－	0.2	0.1	－	
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 251,739	千メキシコ・ペソ 247,524	千円 1,425,739	0.7	－	0.5	0.3	－	
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 29,750	千マレーシア・リンギット 29,948	千円 814,899	0.4	－	0.3	0.1	0.0	
南 ア フ リ カ	千南アフリカ・ランド 151,470	千南アフリカ・ランド 136,165	千円 1,075,710	0.5	－	0.5	0.0	－	
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 36,520	千ポーランド・ズロチ 38,526	千円 1,116,887	0.6	－	0.2	0.3	0.0	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	11,360	12,568	1,577,178	0.8	－	0.5	0.1	0.1	
オ ラ ン ダ	26,590	31,424	3,943,507	2.0	－	1.2	0.7	0.1	
ベ ル ギ ー	32,330	38,532	4,835,485	2.4	－	1.8	0.5	0.1	
フ ラ ン ス	133,920	156,515	19,641,123	9.9	－	6.3	2.6	1.0	
ド イ ツ	88,160	104,329	13,092,260	6.6	－	3.7	2.0	0.9	
ス ペ イ ン	75,970	88,720	11,133,550	5.6	－	3.7	1.4	0.5	
イ タ リ ア	127,670	135,633	17,020,656	8.6	－	5.1	2.8	0.8	
フィンランド	9,470	10,384	1,303,175	0.7	－	0.4	0.2	0.1	
オーストリア	19,070	23,005	2,886,920	1.5	－	0.9	0.4	0.1	
合 計	－	－	千円 193,881,281	98.1	－	52.1	31.4	14.6	

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

銘 柄	当			期		末
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国 債 証 券	4.5000	1,500	1,909	152,041	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国 債 証 券	3.7500	1,200	1,430	113,934	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国 債 証 券	2.2500	2,570	2,602	207,294	2028/05/21
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国 債 証 券	5.7500	3,700	4,025	320,557	2021/05/15
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国 債 証 券	2.5000	830	860	68,539	2030/05/2
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国 債 証 券	3.2500	900	1,005	80,113	2039/06/2
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国 債 証 券	2.7500	900	946	75,403	2035/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国 債 証 券	5.7500	3,500	3,972	316,403	2022/07/15
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国 債 証 券	2.7500	2,700	2,853	227,265	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国 債 証 券	2.7500	2,900	3,056	243,413	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国 債 証 券	2.7500	1,560	1,654	131,746	2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国 債 証 券	1.7500	2,150	2,150	171,234	2020/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国 債 証 券	2.2500	890	909	72,429	2022/11/21
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国 債 証 券	2.0000	1,770	1,786	142,310	2021/12/21
小 計	—	—	47,170	51,717	4,118,815	—
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国 債 証 券	3.5000	900	994	81,432	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国 債 証 券	2.7500	660	685	56,196	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国 債 証 券	2.7500	550	575	47,106	2042/04/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国 債 証 券	2.3750	500	510	41,820	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国 債 証 券	2.1250	210	211	17,289	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国 債 証 券	2.8750	400	427	34,996	2029/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国 債 証 券	2.2500	200	195	16,012	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国 債 証 券	3.0000	810	852	69,858	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国 債 証 券	3.1250	1,600	1,664	136,341	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国 債 証 券	2.8750	460	490	40,189	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国 債 証 券	3.3750	480	540	44,243	2033/09/01
SINGAPORE 1.25 10/01/21	国 債 証 券	1.2500	1,000	983	80,527	2021/10/01
小 計	—	—	7,770	8,130	666,012	—
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国 債 証 券	3.2500	2,460	3,228	466,028	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国 債 証 券	3.5000	2,300	3,158	456,038	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国 債 証 券	4.0000	1,530	2,627	379,327	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国 債 証 券	1.7500	620	626	90,511	2049/01/22
UK TREASURY 1.5 01/22/21	国 債 証 券	1.5000	2,700	2,738	395,412	2021/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国 債 証 券	5.0000	2,030	2,518	363,537	2025/03/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国 債 証 券	4.0000	1,040	1,141	164,776	2022/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国 債 証 券	4.2500	2,100	2,943	424,932	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国 債 証 券	1.0000	580	583	84,174	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国 債 証 券	4.2500	1,850	2,487	359,095	2032/06/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国 債 証 券	8.0000	1,700	1,981	286,076	2021/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国 債 証 券	1.5000	2,400	2,291	330,757	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国 債 証 券	3.7500	1,630	2,509	362,326	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国 債 証 券	1.7500	1,730	1,794	259,101	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国 債 証 券	2.5000	1,890	2,446	353,164	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国 債 証 券	3.5000	1,720	2,830	408,654	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国 債 証 券	1.5000	1,970	2,042	294,914	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国 債 証 券	1.2500	2,320	2,351	339,463	2027/07/22

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

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

銘	柄	当			期			末		
		種	類	利	率	額	面	金	額	償還年月日
(ポーランド)					%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円		
POLAND 2.75 04/25/28		国	債	証	券	2.7500	1,900	1,910	55,393	2028/04/25
POLAND 2.0 04/25/21		国	債	証	券	2.0000	1,130	1,142	33,122	2021/04/25
POLAND 2.25 04/25/22		国	債	証	券	2.2500	4,000	4,061	117,738	2022/04/25
POLAND 2.5 04/25/24		国	債	証	券	2.5000	1,050	1,065	30,896	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26		国	債	証	券	2.5000	4,200	4,203	121,845	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25		国	債	証	券	3.2500	3,300	3,482	100,948	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27		国	債	証	券	2.5000	3,000	2,988	86,636	2027/07/25
POLAND 1.75 07/25/21		国	債	証	券	1.7500	2,200	2,211	64,105	2021/07/25
POLAND 5.75 09/23/22		国	債	証	券	5.7500	3,200	3,629	105,223	2022/09/23
POLAND 5.25 10/25/20		国	債	証	券	5.2500	2,970	3,157	91,529	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21		国	債	証	券	5.7500	3,680	4,079	118,273	2021/10/25
POLAND 4.0 10/25/23		国	債	証	券	4.0000	3,100	3,374	97,835	2023/10/25
小	計	—			—	36,520	38,526	1,116,887	—	
(ユーロ…アイルランド)					%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
IRISH 2.0 02/18/45		国	債	証	券	2.0000	870	950	119,254	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31		国	債	証	券	1.3500	210	218	27,357	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24		国	債	証	券	3.4000	930	1,088	136,548	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25		国	債	証	券	5.4000	1,260	1,651	207,250	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23		国	債	証	券	3.9000	700	815	102,318	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22		国	債	証	券	0.8000	950	980	123,085	2022/03/15
IRISH 4.5 04/18/20		国	債	証	券	4.5000	1,130	1,195	150,028	2020/04/18
IRISH 1.3 05/15/33		国	債	証	券	1.3000	450	456	57,225	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30		国	債	証	券	2.4000	1,100	1,273	159,760	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28		国	債	証	券	0.9000	580	591	74,225	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29		国	債	証	券	1.1000	340	348	43,788	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26		国	債	証	券	1.0000	1,200	1,252	157,141	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37		国	債	証	券	1.7000	570	598	75,095	2037/05/15
IRISH 5.0 10/18/20		国	債	証	券	5.0000	850	927	116,330	2020/10/18
IRISH 10/18/22		国	債	証	券	—	220	221	27,767	2022/10/18
小	計	—			—	11,360	12,568	1,577,178	—	
(ユーロ…オランダ)					%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
NETHERLANDS 3.75 01/15/42		国	債	証	券	3.7500	1,620	2,668	334,930	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47		国	債	証	券	2.7500	1,430	2,130	267,408	2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23		国	債	証	券	3.7500	590	687	86,292	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28		国	債	証	券	5.5000	1,350	1,998	250,729	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37		国	債	証	券	4.0000	1,560	2,458	308,524	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33		国	債	証	券	2.5000	1,300	1,652	207,342	2033/01/15
NETHERLANDS 01/15/22		国	債	証	券	—	2,310	2,342	294,018	2022/01/15
NETHERLANDS 01/15/24		国	債	証	券	—	1,680	1,701	213,544	2024/01/15
NETHERLANDS 3.5 07/15/20		国	債	証	券	3.5000	1,670	1,765	221,561	2020/07/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21		国	債	証	券	3.2500	1,860	2,030	254,868	2021/07/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23		国	債	証	券	1.7500	2,000	2,186	274,333	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26		国	債	証	券	0.5000	1,700	1,765	221,503	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22		国	債	証	券	2.2500	1,550	1,694	212,583	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24		国	債	証	券	2.0000	1,560	1,749	219,493	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25		国	債	証	券	0.2500	1,700	1,740	218,433	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28		国	債	証	券	0.7500	1,260	1,323	166,145	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27		国	債	証	券	0.7500	1,450	1,528	191,793	2027/07/15
小	計	—			—	26,590	31,424	3,943,507	—	

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

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

銘	柄	当			期			末					
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日
(ユーロ…ドイツ)					%		千	ユーロ		千	ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39		国	債	証	券	4.2500	1,390			2,388		299,775	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42		国	債	証	券	3.2500	1,500			2,366		297,004	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44		国	債	証	券	2.5000	2,710			3,871		485,825	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40		国	債	証	券	4.7500	1,740			3,220		404,183	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21		国	債	証	券	3.2500	3,150			3,435		431,107	2021/07/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20		国	債	証	券	3.0000	3,000			3,147		394,917	2020/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22		国	債	証	券	1.7500	2,700			2,908		364,942	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34		国	債	証	券	4.7500	2,080			3,450		433,033	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46		国	債	証	券	2.5000	2,600			3,773		473,531	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48		国	債	証	券	1.2500	1,300			1,480		185,747	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25		国	債	証	券	1.0000	2,500			2,706		339,607	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27		国	債	証	券	0.5000	2,700			2,830		355,147	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26		国	債	証	券	—	2,370			2,399		301,122	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28		国	債	証	券	0.2500	1,780			1,814		227,716	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23		国	債	証	券	2.0000	1,500			1,665		209,004	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24		国	債	証	券	1.0000	1,340			1,439		180,652	2024/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21		国	債	証	券	2.2500	1,070			1,146		143,874	2021/09/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20		国	債	証	券	2.2500	4,200			4,382		550,021	2020/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22		国	債	証	券	1.5000	1,650			1,768		221,923	2022/09/04
BUNDESUBL 0.25 10/16/20		国	債	証	券	0.2500	1,500			1,520		190,804	2020/10/16
BUNDESUBL 10/07/22		国	債	証	券	—	2,730			2,779		348,839	2022/10/07
BUNDESUBL 10/13/23		国	債	証	券	—	1,280			1,304		163,699	2023/10/13
小	計	—	—	—	—	88,160				104,329		13,092,260	—
(ユーロ…スペイン)					%		千	ユーロ		千	ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22		国	債	証	券	5.8500	2,300			2,701		339,032	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29		国	債	証	券	6.0000	2,750			3,977		499,169	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24		国	債	証	券	4.8000	2,200			2,683		336,699	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37		国	債	証	券	4.2000	1,960			2,638		331,163	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23		国	債	証	券	5.4000	2,800			3,386		424,970	2023/01/31
SPAIN 0.05 01/31/21		国	債	証	券	0.0500	400			401		50,423	2021/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25		国	債	証	券	1.6000	2,160			2,296		288,232	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24		国	債	証	券	3.8000	1,720			2,021		253,725	2024/04/30
SPAIN 5.5 04/30/21		国	債	証	券	5.5000	3,600			4,046		507,787	2021/04/30
SPAIN 4.0 04/30/20		国	債	証	券	4.0000	2,400			2,522		316,575	2020/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27		国	債	証	券	1.5000	2,000			2,078		260,818	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26		国	債	証	券	1.9500	1,790			1,933		242,651	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28		国	債	証	券	1.4000	2,230			2,281		286,293	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29		国	債	証	券	1.4500	980			992		124,562	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22		国	債	証	券	0.4000	2,200			2,232		280,177	2022/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26		国	債	証	券	5.9000	2,040			2,783		349,329	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40		国	債	証	券	4.9000	1,840			2,725		341,988	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41		国	債	証	券	4.7000	2,100			3,050		382,754	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66		国	債	証	券	3.4500	1,000			1,196		150,202	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25		国	債	証	券	4.6500	2,360			2,959		371,350	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30		国	債	証	券	1.9500	2,240			2,360		296,206	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32		国	債	証	券	5.7500	2,290			3,443		432,144	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33		国	債	証	券	2.3500	1,620			1,740		218,439	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28		国	債	証	券	1.4000	1,950			1,984		249,029	2028/07/30

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

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

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

■投資信託財産の構成

2019年2月21日現在

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

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月21日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2018年2月22日 至2019年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

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

変更前：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）

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

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

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年3月1日)

J－R E I T インデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2019年6月6日）

（計算期間 2018年6月7日～2019年6月6日）

J－R E I T インデックスファンド・マザーファンドの第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	2006年8月4日から無期限です。
運 用 方 針	東証 R E I T 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 投 資 対 象	東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

■最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 率 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 率 先物比率	純 資 産 額
		期 中 騰 落 率	(配当込み) ベンチマーク	期 中 騰 落 率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
9 期（2015年6月8日）	17,124	21.8	3,194.43	22.0	98.9	－	29,321
10期（2016年6月6日）	18,293	6.8	3,414.59	6.9	99.1	－	23,383
11期（2017年6月6日）	17,626	△3.6	3,285.51	△3.8	98.3	1.5	29,280
12期（2018年6月6日）	18,181	3.1	3,386.35	3.1	97.8	1.7	35,462
13期（2019年6月6日）	20,819	14.5	3,880.89	14.6	97.4	2.0	33,154

（注1）不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

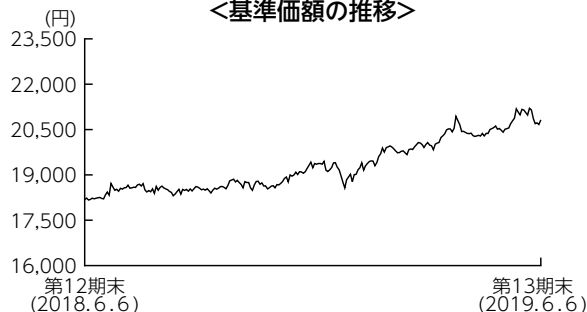
年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数
		騰 落 率	(配 当 込 み) (ベ ン チ マ ー ク)	騰 落 率		
(期 首) 2018 年 6 月 6 日	円	%	ポイント	%	%	%
	18,181	—	3,386.35	—	97.8	1.7
6 月 末	18,525	1.9	3,450.92	1.9	97.9	1.7
7 月 末	18,619	2.4	3,468.88	2.4	97.9	1.6
8 月 末	18,559	2.1	3,457.71	2.1	97.8	1.6
9 月 末	18,857	3.7	3,513.39	3.8	98.0	1.6
10 月 末	18,572	2.2	3,459.73	2.2	97.1	2.0
11 月 末	19,377	6.6	3,610.49	6.6	97.3	2.0
12 月 末	19,022	4.6	3,543.83	4.7	97.7	1.9
2019 年 1 月 末	19,902	9.5	3,709.11	9.5	97.6	1.9
2 月 末	20,003	10.0	3,728.00	10.1	97.8	1.9
3 月 末	20,659	13.6	3,851.10	13.7	97.4	2.0
4 月 末	20,510	12.8	3,822.76	12.9	97.4	2.0
5 月 末	20,865	14.8	3,889.57	14.9	97.4	2.1
(期 末) 2019 年 6 月 6 日	20,819	14.5	3,880.89	14.6	97.4	2.0

(注 1) 騰落率は期首比です。

(注 2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2018年6月7日から2019年6月6日まで）

＜基準価額の推移＞



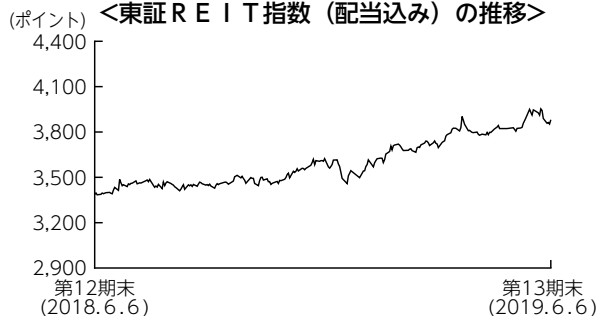
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は20,819円となり、前期末比で14.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米中貿易摩擦問題の悪化や、世界景気の先行き不透明感が拡大する中で内需ディフェンシブ株の一角として株式投資家からの資金流入が見られたこと、資産入れ替えに伴う物件売却による含み益の還元や良好なオフィス市況が続いたことなどからＪ－ＲＥＩＴ市場は堅調に推移し、基準価額は上昇しました。

＜東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の推移＞



投資環境

Ｊ－ＲＥＩＴ市場は米中貿易摩擦問題の悪化による世界景気の先行き不透明感の拡大から株式市場が調整色を強める中、2018年の年末にかけて急落する局面もありましたが、内需ディフェンシブ株の一角として株式投資家からの資金流入を支えに底堅い展開が続きました。積極的な資産入れ替え方針などによる投資主価値の向上への期待がＪ－ＲＥＩＴ市場を支えました。用途別では、東京都心を中心に賃料上昇の加速が好感されたオフィスリートや住宅リートが強い展開となりました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で14.6%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション) (投資証券)	0円 (0) (0)	0.002% (0.001) (0.002)
(b) その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)
合 計	0	0.002

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(19,315円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2018年6月7日から2019年6月6日まで)

(1) 投資証券

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
	千口	千口	千円	千円	千口	千口	千円	千円
国内								
エスコンジャパンリート投資法人	0.453	(-)	46,610	(-)	0.105	(-)	10,726	(-)
サンケイリアルエステート投資法人	0.42	(-)	46,708	(-)	0.085	(-)	9,423	(-)
日本アコモデーションファンド投資法人	1.391	(-)	754,893	(-)	1.678	(-)	906,646	(-)
MCUBS MidCity投資法人	4.71	(-)	430,896	(-)	5.634	(-)	511,654	(-)
森ヒルズリート投資法人	5.068	(-)	725,640	(-)	5.747	(-)	820,286	(-)
産業ファンド投資法人	5.087	(-)	610,692	(-)	5.864	(-)	691,702	(-)
アドバンス・レジデンス投資法人	4.195	(-)	1,269,257	(-)	4.827	(-)	1,455,790	(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2.891	(-)	503,716	(-)	2.958	(-)	515,373	(-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人	2.343	(-)	1,106,192	(-)	2.486	(-)	1,170,075	(-)
GLP投資法人	11.687	(-)	1,349,433	(-)	12.112	(-)	1,391,934	(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1.753	(-)	492,769	(-)	1.959	(-)	549,839	(-)
日本プロロジスリート投資法人	5.605	(-)	1,304,769	(-)	6.724	(-)	1,553,801	(-)
星野リゾート・リート投資法人	0.638	(-)	347,485	(-)	0.794	(-)	431,757	(-)
Oneリート投資法人	0.727	(-)	189,664	(-)	0.698	(-)	182,879	(-)
イオンリート投資法人	4.527	(-)	577,287	(-)	5.084	(-)	643,391	(-)
ヒューリックリート投資法人	3.686	(-)	634,103	(-)	3.832	(-)	658,106	(-)
日本リート投資法人	1.51	(-)	569,076	(-)	1.558	(-)	595,021	(-)
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	25.362	(-)	413,479	(-)	29.75	(-)	482,466	(-)
日本ヘルスケア投資法人	0.194	(-)	33,447	(-)	0.245	(-)	42,198	(-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
		千□		千円		千□		千円
積水ハウス・リート投資法人		10.88		816,731		12.78505		955,482
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		0.872		98,683		0.903		102,485
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		1.531		388,310		1.834		463,791
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		0.979		113,387		0.792		89,753
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		0.925		87,638		0.985		92,271
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		12.795		1,991,751		14.828		2,287,536
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		0.795		107,721		0.868		117,299
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールレジポート投資法人		3.398		377,212		3.804		413,302
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		1.572		169,393		1.517		161,151
		(-)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		0.373		41,552		0.422		46,668
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		1.088		366,513		1.07		357,633
		(-)		(-)		(-)		(-)
大江戸温泉リート投資法人		0.677		57,303		0.843		71,784
		(-)		(-)		(-)		(-)
さくら総合リート投資法人		0.914		80,405		1.203		105,471
		(-)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		2.189		293,230		1.966		237,514
		(2.811)		(-)		(-)		(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人		1.038		144,685		1.163		159,389
		(-)		(-)		(-)		(-)
三菱地所物流リート投資法人		0.488		124,478		0.523		132,034
		(-)		(-)		(-)		(-)
C R E ロジスティクスファンド投資法人		0.419		45,504		0.505		54,693
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		0.382		44,576		0.461		53,135
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		1.175		107,458		0.667		60,371
		(-)		(-)		(-)		(-)
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		1.022		96,114		0.497		45,956
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		4.049		2,800,052		4.883		3,337,385
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		4.181		2,586,008		5.021		3,065,959
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本リテールファンド投資法人		7.9		1,698,123		9.521		2,030,412
		(-)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		8.333		1,531,673		10.014		1,831,472
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		2.649		1,136,301		3.187		1,353,309
		(-)		(-)		(-)		(-)
プレミアム投資法人		4.093		515,233		4.71		591,243
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		2.801		462,193		3.378		554,209
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		2.895		351,407		3.25		391,392
		(-)		(-)		(-)		(-)
ユナイテッド・アーバン投資法人		9.222		1,616,588		11.122		1,943,050
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
森トラスト総合リート投資法人	2.99 (-)	498,302 (-)	3.606 (-)	595,059 (-)
インヴィンシブル投資法人	17.323 (-)	862,032 (-)	17.286 (-)	849,994 (-)
フロンティア不動産投資法人	1.42 (-)	636,625 (-)	1.713 (-)	765,194 (-)
平和不動産リート投資法人	2.606 (-)	307,549 (-)	3.142 (-)	369,026 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	2.745 (-)	629,236 (-)	3.362 (-)	765,770 (-)
福岡リート投資法人	2.161 (-)	370,629 (-)	2.606 (-)	444,427 (-)
ケネディクス・オフィス投資法人	1.291 (-)	933,876 (-)	1.554 (-)	1,129,668 (-)
いちごオフィスリート投資法人	3.626 (-)	349,372 (-)	4.105 (-)	395,886 (-)
大和証券オフィス投資法人	1.017 (-)	730,364 (-)	1.151 (-)	823,307 (-)
阪急阪神リート投資法人	1.946 (-)	280,257 (-)	2.276 (-)	325,626 (-)
スターツプロシード投資法人	0.655 (-)	112,392 (-)	0.797 (-)	136,046 (-)
大和ハウスリート投資法人	5.795 (-)	1,478,853 (-)	6.193 (-)	1,574,835 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	13.868 (-)	1,152,299 (-)	15.226 (-)	1,265,659 (-)
日本賃貸住宅投資法人	4.705 (-)	410,819 (-)	5.674 (-)	497,080 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	3.746 (-)	572,105 (-)	4.518 (-)	688,913 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	不動産投信指数先物取引	百万円 1,874	百万円 1,893	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2018年6月7日から2019年6月6日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D／C
投 資 証 券	百万円 38,981	百万円 567	% 1.5	百万円 44,355	百万円 500	% 1.1

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 1,690

(3) 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)	743千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	8千円
(B)／(A)	1.1%

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

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

銘	柄	期首(前期末)	当 期			末
		□ 数	□ 数	評 価	額	比 率
不動産ファンド		千□	千□	千円		%
エスコンジャパンリート投資法人		－	0.348	36,226		0.1
サンケイリアルエステート投資法人		－	0.335	36,850		0.1
日本アコモデーションファンド投資法人		1.414	1.127	652,533		2.0
MCUBS MidCity投資法人		4.747	3.823	396,827		1.2
森ヒルズリート投資法人		4.57	3.891	589,875		1.8
産業ファンド投資法人		4.941	4.164	537,156		1.6
アドバンス・レジデンス投資法人		3.939	3.307	1,035,091		3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		2.164	2.097	379,557		1.1
アクティビア・プロパティーズ投資法人		1.925	1.782	840,213		2.5
GLP投資法人		8.832	8.407	991,185		3.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		1.613	1.407	415,065		1.3
日本プロロジスリート投資法人		5.67	4.551	1,048,095		3.2
星野リゾート・リート投資法人		0.672	0.516	278,124		0.8
Oneリート投資法人		0.465	0.494	136,986		0.4
イオンリート投資法人		4.04	3.483	465,328		1.4
ヒューリックリート投資法人		2.889	2.743	497,305		1.5
日本リート投資法人		1.143	1.095	459,900		1.4
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		25.067	20.679	360,848		1.1
日本ヘルスケア投資法人		0.206	0.155	26,892		0.1
積水ハウス・リート投資法人		10.65905	8.754	682,812		2.1
トーセイ・リート投資法人		0.684	0.653	76,139		0.2
ケネディクス商業リート投資法人		1.547	1.244	333,018		1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		0.524	0.711	84,466		0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		0.739	0.679	72,381		0.2
野村不動産マスターファンド投資法人		12.59	10.557	1,755,629		5.3
いちごホテルリート投資法人		0.666	0.593	73,354		0.2
ラサールロジポート投資法人		3.209	2.803	346,170		1.0
スターアジア不動産投資法人		0.998	1.053	120,042		0.4
マリモ地方創生リート投資法人		0.341	0.292	34,718		0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.805	0.823	285,581		0.9
大江戸温泉リート投資法人		0.714	0.548	45,812		0.1
さくら総合リート投資法人		1.023	0.734	67,601		0.2
投資法人みらい		0.621	3.655	179,460		0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		0.921	0.796	110,962		0.3
三菱地所物流リート投資法人		0.394	0.359	97,109		0.3
CREロジスティクスファンド投資法人		0.426	0.34	40,052		0.1

銘柄		期首(前期末)	当期			末
		□数	□数	評価額	比率	
不動産ファンド		千□	千□	千円	%	
ザイマックス・リート投資法人		0.392	0.313	38,655	0.1	
タカラレーベン不動産投資法人		－	0.508	48,971	0.1	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		－	0.525	52,920	0.2	
日本ビルファンド投資法人		4.12	3.286	2,474,358	7.5	
ジャパンリアルエステイト投資法人		4.233	3.393	2,225,808	6.7	
日本リテールファンド投資法人		8.033	6.412	1,391,404	4.2	
オリックス不動産投資法人		8.441	6.76	1,320,904	4.0	
日本プライムリアルティ投資法人		2.686	2.148	997,746	3.0	
プレミア投資法人		3.843	3.226	440,349	1.3	
東急リアル・エステート投資法人		2.852	2.275	415,642	1.3	
グローバル・ワン不動産投資法人		2.702	2.347	305,110	0.9	
ユナイテッド・アーバン投資法人		9.383	7.483	1,325,239	4.0	
森トラスト総合リート投資法人		3.041	2.425	421,950	1.3	
インヴィンシブル投資法人		11.668	11.705	685,913	2.1	
フロンティア不動産投資法人		1.447	1.154	537,764	1.6	
平和不動産リート投資法人		2.649	2.113	263,068	0.8	
日本ロジスティクスファンド投資法人		2.834	2.217	542,499	1.6	
福岡リート投資法人		2.2	1.755	303,439	0.9	
ケネディクス・オフィス投資法人		1.313	1.05	782,250	2.4	
いちごオフィスリート投資法人		3.294	2.815	284,033	0.9	
大和証券オフィス投資法人		0.917	0.783	585,684	1.8	
阪急阪神リート投資法人		1.857	1.527	224,621	0.7	
スターツプロシード投資法人		0.67	0.528	91,291	0.3	
大和ハウスリート投資法人		4.95	4.552	1,167,588	3.5	
ジャパン・ホテル・リート投資法人		12.279	10.921	954,495	2.9	
日本賃貸住宅投資法人		4.785	3.816	321,307	1.0	
ジャパンエクセレント投資法人		3.81	3.038	483,649	1.5	
合	計	□数・金額	215.55705	188.073	32,276,037	－
		銘柄数<比率>	59銘柄<97.8%>	63銘柄<97.4%>	－	97.4

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		期末
		買建額	売建額	
国内	東証REIT	百万円 671	百万円 －	

■投資信託財産の構成

2019年6月6日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
投資証券	千円 32,276,037	% 89.5	
コール・ローン等、その他	3,773,644	10.5	
投資信託財産総額	36,049,681	100.0	

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	36,049,681,856円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	2,402,172,999
投 資 証 券(評価額)	32,276,037,250
未 収 入 金	1,176,594,192
未 収 配 当 金	205,231,915
差 入 委 託 証 拠 金	△10,354,500
(B) 負 債	2,895,673,600
未 払 金	1,697,639,600
未 払 解 約 金	1,198,034,000
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	33,154,008,256
元 本	15,925,100,033
次 期 繰 越 損 益 金	17,228,908,223
(D) 受 益 権 総 口 数	15,925,100,033口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C／D)	20,819円

(注1) 期首元本額 19,505,563,952円
追加設定元本額 21,469,701,210円
一部解約元本額 25,050,165,129円

(注2) 期末における元本の内訳

M I T O ラップ型ファンド (安定型)	398,750円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	989,759円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	1,626,471円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	3,677,841円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	2,590,882円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	1,933,107円
たわらノーロード 国内リート	2,507,699,434円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	623,786,868円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	190,244,865円
たわらノーロード バランス (堅実型)	2,593,857円
たわらノーロード バランス (標準型)	51,331,561円
たわらノーロード バランス (積極型)	62,512,810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)	19,941,955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)	64,317,037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)	41,446,372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)	94,016,367円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	759,631円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	1,838,794円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,187,199円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,990,117円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	11,988,138円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	327,794,537円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,869,053円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	110,530,283円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	101,236,265円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	198,350,779円
投資のソムリエ	2,675,884,350円
投資のソムリエ<DC年金>	274,057,268円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	85,884,495円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	115,327,181円
ダイナミック・ナビゲーション	415,557円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,642,988,733円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	1,216,024円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	1,044,635円

リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	859,105円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,759,124円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	259,998,854円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	9,352,299円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	243,859円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	243,859円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	243,859円
Jリートインデックスファンド (DC)	13,039,056円
D I A M J－R E I Tインデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定)	88,900,881円
D I A M J－R E I Tインデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定)	803,441,710円
D I A M J－R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け)	4,507,558,117円
日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	261,962,505円
D I A Mグローバル8私募ファンド (適格機関投資家向け)	15,360,153円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	735,665,677円
期末元本合計	15,925,100,033円

■損益の状況

当期 自2018年6月7日 至2019年6月6日

項 目					当 期
(A) 配 受 そ 支	当 取 の	等 配 他	収 当 収	益 金 金	1,341,887,419円 1,342,747,089 148
			利	息	△859,818
(B) 有 売 売	価 証	券 買 買	売 買 損	益 益 損	2,969,521,242 3,330,702,386 △361,181,144
(C) 先 取	物 取 引	等 引	取 引 損	益 益	87,382,152 87,382,152
(D) そ の		他	費	用	△922
(E) 当 期	損 繰	益 越	金(A + B + C + D)		4,398,789,891
(F) 前 期			損 益	金	15,957,115,897
(G) 解 約		差	損 益	金	△23,507,060,955
(H) 追 加	信 託	差	損 益	金	20,380,063,390
(I) 合 次			計(E + F + G + H)		17,228,908,223
	期 繰 越	損 益	金(I)		17,228,908,223

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2019年6月24日）

（対象期間 2018年6月23日～2019年6月24日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		S & P 先進国 R E I T インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （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
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率		
	円	%	ポイント	%	%	百万円
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
12期(2019年6月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2	47,410

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

（注2）S & P 先進国 R E I Tインデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックス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 R E I Tインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

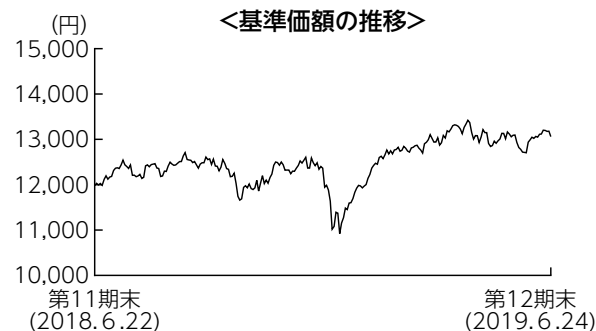
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率	
(期 首) 2018 年 6 月 22 日	円 11,979	% －	ポイント 120,101.82	% －	% 99.3
6 月 末	12,118	1.2	121,653.84	1.3	99.2
7 月 末	12,163	1.5	122,169.90	1.7	99.5
8 月 末	12,556	4.8	126,198.03	5.1	98.8
9 月 末	12,385	3.4	124,660.21	3.8	99.3
10 月 末	12,199	1.8	122,854.06	2.3	99.2
11 月 末	12,478	4.2	125,696.31	4.7	99.4
12 月 末	11,371	△5.1	114,497.86	△4.7	95.2
2019 年 1 月 末	12,425	3.7	125,279.31	4.3	99.5
2 月 末	12,719	6.2	128,472.03	7.0	99.5
3 月 末	13,189	10.1	133,215.20	10.9	99.0
4 月 末	13,149	9.8	132,848.94	10.6	99.6
5 月 末	12,780	6.7	129,142.44	7.5	99.6
(期 末) 2019 年 6 月 24 日	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2018年6月23日から2019年6月24日まで）

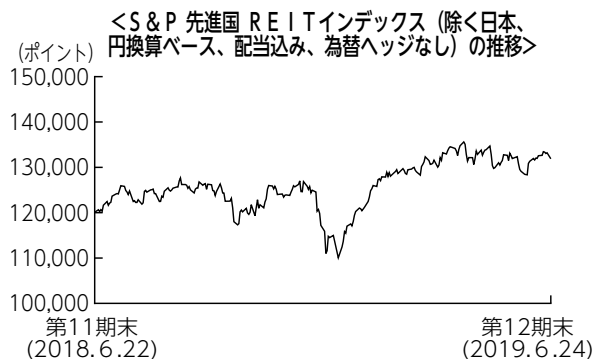


基準価額の推移

当期末の基準価額は13,060円となり、前期末に比べ9.0%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドで組入れている全ての通貨に対して円高となったことはマイナスに寄与したものの、世界的に金利の低下観測が広がった結果、米国やオーストラリアなど多くのリート市場が上昇し、基準価額は上昇しました。



投資環境

米国リート市場は、米中通商問題の深刻化や米国長期金利の上昇局面には下落する場面もありましたが、期を通じては長期金利の低下傾向やF R B（米連邦準備理事会）の金融引き締め姿勢からの転換を背景に上昇しました。欧州リート市場では、政治的な不透明感が高まったフランスや英国などが下落しました。オーストラリアリート市場は、オーストラリア長期金利の低下基調を背景に力強く上昇しました。

為替市場では、2018年の年末にかけて、米中通商問題や世界経済の減速懸念などから安全資産とされる

円が買われ、円高が進む展開となりました。2019年1月に米中通商問題の進展期待などから米ドルが買われ、米ドル高円安方向へと反転したものの、4月後半以降は米国の金利低下観測などから米ドル安円高となりました。ユーロは欧州経済の減速や、イタリアの財政悪化に対する懸念などから弱含む展開となり、ユーロ安円高となりました。豪ドルに対しても円高が進みました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである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9.8%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8%下回りました。ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	3円 (0) (1) (3)	0.025% (0.000) (0.004) (0.020)
(b) 有価証券取引税 (株 式) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	7 (0) (0) (7)	0.059 (0.000) (0.003) (0.056)
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	13 (7) (7)	0.108 (0.055) (0.052)
合 計	24	0.191

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(12,500円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2018年6月23日から2019年6月24日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数 百株	金 額 千アメリカ・ドル	株 数 百株	金 額 千アメリカ・ドル
外国	ア メ リ カ	(939.19)	(1,331)	939.19	1,846

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額 千アメリカ・ドル	口 数	金 額 千アメリカ・ドル
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	51.516 (-)	6,602 (-)	54.92 (-)	7,017 (-)
ALEXANDER'S INC.	1.909 (-)	644 (-)	2.109 (-)	721 (-)
BOSTON PROPERTIES INC	69.446 (-)	8,705 (-)	79.741 (-)	9,892 (-)
CEDAR REALTY TRUST INC	28.857 (-)	111 (-)	34.991 (-)	131 (-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	94.892 (2.152)	3,345 (73)	106.311 (-)	3,648 (-)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	73.746 (△1.902)	3,391 (-)	86.508 (-)	3,935 (-)
AGREE REALTY CORP	15.822 (-)	958 (-)	15.848 (-)	934 (-)
BRT APARTMENTS CORP	6.485 (-)	75 (-)	3.672 (-)	43 (-)
SL GREEN	38.987 (-)	3,601 (-)	46.27 (-)	4,211 (-)

	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
EPR PROPERTIES	36.696 (-)	2,589 (-)	37.75 (-)	2,650 (-)
PROLOGIS INC	270.614 (38.097)	18,158 (-)	312.238 (-)	20,970 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	62.176 (-)	11,494 (-)	71.282 (-)	13,104 (-)
LEXINGTON REALTY TRUST	90.68 (-)	789 (-)	105.782 (-)	901 (-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	43.075 (-)	4,047 (-)	47.892 (-)	4,480 (-)
CBL & ASSOCIATES	85.442 (-)	213 (-)	110.449 (-)	266 (-)
MACK CALI	43.703 (-)	916 (-)	50.278 (-)	1,058 (-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	72.133 (-)	3,530 (-)	80.15 (-)	3,844 (-)
COUSINS PROPERTIES INC	192.222 (△95.762)	1,693 (-)	222.783 (-)	1,959 (-)
LASALLE HOTEL PROPERTIES	20.928 (△33.49)	710 (-)	33.896 (-)	1,130 (-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10.337 (-)	217 (-)	11.376 (-)	238 (-)
SITE CENTERS CORP	62.071 (-)	804 (-)	76.856 (-)	999 (-)
ISTAR INC	1.455 (-)	15 (-)	29.85 (-)	333 (-)
DUKE REALTY TRUST	162.249 (-)	4,622 (-)	185.327 (-)	5,270 (-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15.635 (-)	85 (-)	29.663 (-)	177 (-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29.876 (-)	7,700 (-)	34.406 (-)	8,829 (-)
EQUITY RESIDENTIAL	165.741 (-)	11,471 (-)	190.111 (-)	13,025 (-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	33.211 (-)	4,234 (-)	37.721 (-)	4,748 (-)
FIRST INDUSTRIAL RT	57.032 (-)	1,828 (-)	65.302 (-)	2,086 (-)
GGP INC	29.411 (-)	616 (△1,331)	296.261 (-)	1,052 (-)
HCP INC	216.819 (-)	6,247 (-)	245.408 (-)	6,834 (-)
EQUITY COMMONWEALTH	54.381 (-)	1,702 (-)	62.791 (-)	1,938 (-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	55.449 (-)	1,677 (-)	64.426 (-)	1,897 (-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	49.393 (-)	2,198 (-)	56.792 (-)	2,548 (-)
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	70.873 (-)	1,886 (-)	82.804 (-)	2,191 (-)
WELLTOWER INC	172.408 (-)	12,327 (-)	192.047 (-)	13,223 (-)
EAST GROUP	16.855 (-)	1,691 (-)	18.78 (-)	1,871 (-)
KIMCO REALTY	194.856 (-)	3,226 (-)	225.334 (-)	3,685 (-)

	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
KILROY REALTY CORP	46.475	3,288	52.409	3,726
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	18.779	833	21.004	924
	(-)	(-)	(-)	(-)
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	101.848	1,394	119.626	1,621
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	38.01	555	36.722	546
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIBERTY PROPERTY TRUST	68.047	3,035	78.212	3,451
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	77.488	1,146	89.924	1,334
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	129.031	4,352	146.371	4,796
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	49.035	2,362	57.847	2,788
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	40.885	4,165	46.185	4,651
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	34.42	950	40.229	1,106
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	339.44	6,423	389.543	7,504
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	51.864	5,292	59.502	6,047
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	11.412	202	13.291	254
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	19.319	1,500	21.953	1,651
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	18.845	234	30.513	257
	(△33.797)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5.087	135	7.385	195
	(-)	(-)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	32.609	273	44.52	363
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	14.456	425	15.166	445
	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	8.613	1,201	10.055	1,372
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	34.058	446	40.201	524
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	135.852	8,640	147.998	9,179
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	83.618	5,314	86.319	5,453
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	126.173	5,190	141.55	5,776
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	41.911	1,109	46.256	1,253
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORECIVIC INC	47.876	1,033	56.529	1,230
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	5.197	272	5.818	310
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	138.155	24,451	160.362	28,042
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	19.507	1,864	22.845	2,155
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
アメリカ		千□		千アメリカ・ドル		千□		千アメリカ・ドル
PUBLIC STORAGE		67.783		14,402		78.32		16,545
		(-)		(-)		(-)		(-)
SUN COMMUNITIES INC		41.357		4,411		44.529		4,721
		(-)		(-)		(-)		(-)
TAUBMAN CENTERS INC		27.742		1,457		32.194		1,694
		(-)		(-)		(-)		(-)
TANGER FACTORY OUTLET		39.061		847		46.467		992
		(-)		(-)		(-)		(-)
UMH PROPERTIES INC		12.627		168		14.076		193
		(-)		(-)		(-)		(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		9.842		195		11.279		218
		(-)		(-)		(-)		(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME		4.471		312		5.022		360
		(-)		(-)		(-)		(-)
VENTAS INC		160.455		9,696		184.264		10,839
		(-)		(-)		(-)		(-)
VORNADO REALTY TRUST		79.398		5,462		91.041		6,222
		(-)		(-)		(-)		(-)
WASHINGTON REIT		34.047		919		39.493		1,099
		(-)		(-)		(-)		(-)
GEO GROUP INC		55.736		1,262		65.134		1,472
		(-)		(-)		(-)		(-)
WEINGARTEN REALTY INVST		53.776		1,539		62.494		1,781
		(-)		(-)		(-)		(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES		60.197		2,596		68.994		2,953
		(-)		(-)		(-)		(-)
KITE REALTY GROUP TRUST		36.187		580		40.688		645
		(-)		(-)		(-)		(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC		56.934		5,390		65.076		6,129
		(-)		(-)		(-)		(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		32.657		238		36.853		277
		(-)		(-)		(-)		(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		92.764		1,363		108.365		1,607
		(-)		(-)		(-)		(-)
CUBESMART		83.044		2,522		93.599		2,820
		(-)		(-)		(-)		(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC		91.946		10,374		105.056		11,808
		(-)		(-)		(-)		(-)
EDUCATION REALTY TRUST INC		7.995		331		40.156		1,665
		(-)		(-)		(-)		(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		92.217		970		103.416		1,104
		(-)		(-)		(-)		(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST		163.601		2,711		181.805		2,889
		(-)		(-)		(-)		(-)
DOUGLAS EMMETT INC		72.261		2,707		81.928		3,092
		(-)		(-)		(-)		(-)
DCT INDUSTRIAL TRUST INC		3.449		227		5.841		386
		(△37.35)		(-)		(-)		(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP		48.701		862		54.561		967
		(-)		(-)		(-)		(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC		54.775		1,047		65.251		1,246
		(-)		(-)		(-)		(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC		45.395		526		50.84		611
		(-)		(-)		(-)		(-)
TERRENO REALTY CORP		26.463		1,042		28.614		1,112
		(-)		(-)		(-)		(-)

	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
AMERICAN ASSETS TRUST INC	18.468	756	22.929	918
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	69.766	1,344	82.493	1,603
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	87.163	2,590	42.141	1,190
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	16.562	1,712	18.189	1,878
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	433.716	3,384	499.279	3,806
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHESAPEAKE LODGING TRUST	27.449	800	31.85	941
	(-)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	35.91	1,132	50.164	1,641
	(30.81)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	25.099	435	34.446	460
	(△14.934)	(275)	(-)	(-)
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	19.218	315	18.992	308
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	18.943	379	21.062	421
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	76.051	1,533	89.1	1,790
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	11.785	159	14.266	187
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	67.412	2,143	78.979	2,526
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	49.711	1,368	46.981	1,269
	(-)	(-)	(-)	(-)
SELECT INCOME REIT	17.842	358	15.153	303
	(△30.041)	(△275)	(-)	(-)
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	82.921	1,006	100.523	1,201
	(-)	(-)	(-)	(-)
CYRUSONE INC	47.651	2,745	51.267	2,962
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	88.533	6,276	73.747	5,184
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	6.716	159	35.458	806
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	4.885	61	6.282	75
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	88.972	2,415	103.593	2,774
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	23.653	1,864	27.331	2,167
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHEELER REIT INC	3.005	14	5.966	23
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	31.774	356	13.019	132
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	2.17	33	21.357	310
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRAMERCY PROPERTY TRUST	10.242	280	78.4	2,154
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	102.812	1,395	138.549	1,607
	(△114.402)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	74.371	1,277	86.48	1,455
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
アメリカ		千□		千アメリカ・ドル		千□		千アメリカ・ドル
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC		46.596		1,566		44.125		1,465
		(-)		(-)		(-)		(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT		116.839		2,536		134.902		2,907
		(-)		(-)		(-)		(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC		31.335		318		34.041		343
		(-)		(-)		(-)		(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC		6.242		334		2.548		162
		(-)		(-)		(-)		(-)
JBG SMITH PROPERTIES		51.021		1,957		48.676		1,864
		(-)		(-)		(-)		(-)
AMERICAN FINANCE TRUST INC		26.656		345		6.054		61
		(-)		(-)		(-)		(-)
RETAIL VALUE INC		3.809		117		4.277		131
		(6.384)		(4)		(-)		(-)
INVITATION HOMES INC		155.931		3,584		141.784		3,172
		(-)		(-)		(-)		(-)
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC		7.702		72		11.685		106
		(△9.16)		(△92)		(-)		(-)
FOREST CITY REALTY TRUST INC		52.941		1,308		166.076		4,168
		(-)		(-)		(-)		(-)
QTS REALTY TRUST INC		22.055		925		24.285		992
		(-)		(-)		(-)		(-)
SPIRIT MTA REIT		6.315		57		9.466		85
		(-)		(-)		(-)		(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC		54.236		850		61.314		959
		(-)		(-)		(-)		(-)
SAFEHOLD INC		6.107		111		3.363		56
		(-)		(-)		(-)		(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC		26.062		435		8.327		158
		(-)		(-)		(-)		(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST		12.934		255		12.233		247
		(15.095)		(-)		(-)		(-)
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC		43.876		946		52.732		1,136
		(-)		(-)		(-)		(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC		90.403		3,218		103.396		3,681
		(-)		(-)		(-)		(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		130.176		2,165		152.641		2,521
		(-)		(-)		(-)		(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC		8.292		82		13.258		140
		(-)		(-)		(-)		(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC		49.906		993		16.528		331
		(-)		(-)		(-)		(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC		3.807		39		6.214		61
		(-)		(-)		(-)		(-)
FARMLAND PARTNERS INC		8.074		55		12.967		77
		(-)		(-)		(-)		(-)
CITY OFFICE REIT INC		11.401		130		10.54		119
		(-)		(-)		(-)		(-)
WASHINGTON PRIME GROUP INC		78.797		477		87.457		527
		(-)		(-)		(-)		(-)
CARETRUST REIT INC		41.653		862		40.995		823
		(-)		(-)		(-)		(-)
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC		18.156		101		21.104		119
		(-)		(-)		(-)		(-)
STORE CAPITAL CORP		81.675		2,488		83.58		2,497
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
アメリカ		千□		千アメリカ・ドル		千□		千アメリカ・ドル
PARAMOUNT GROUP INC		75.42		1,067		91.771		1,299
		(-)		(-)		(-)		(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC		8.43		81		9.372		90
		(-)		(-)		(-)		(-)
URBAN EDGE PROPERTIES		52.551		1,037		53.423		1,045
		(-)		(-)		(-)		(-)
INFRAREIT INC		12.483		261		28.615		602
		(-)		(-)		(-)		(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC		29.853		549		23.175		419
		(-)		(-)		(-)		(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC		40.549		823		46.325		985
		(-)		(-)		(-)		(-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC		5.796		212		5.556		200
		(-)		(-)		(-)		(-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST		24.672		683		26.347		716
		(-)		(-)		(-)		(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC		4.323		145		4.537		141
		(-)		(-)		(-)		(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC		84.215		1,351		99.901		1,617
		(-)		(-)		(-)		(-)
GLOBAL NET LEASE INC		35.862		713		35.307		692
		(-)		(-)		(-)		(-)
TIER REIT INC		21.709		511		21.964		525
		(△20.073)		(-)		(-)		(-)
QUALITY CARE PROPERTIES INC		-		-		39.836		826
		(-)		(-)		(-)		(-)
MANULIFE US REIT		544.2		449		599.2		482
		(-)		(△12)		(-)		(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC		83.394		2,489		97.853		2,948
		(-)		(-)		(-)		(-)
VICI PROPERTIES INC		207.696		4,456		80.417		1,709
		(-)		(-)		(-)		(-)
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP		15.23		249		17.937		273
		(-)		(-)		(-)		(-)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES		9.588		378		10.272		423
		(-)		(-)		(-)		(-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC		26.462		714		27.36		727
		(-)		(-)		(-)		(-)
COLONY CAPITAL INC		183.257		1,039		220.405		1,213
		(-)		(-)		(-)		(-)
カナダ		千□		千カナダ・ドル		千□		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT		28.769		917		32.456		1,016
		(-)		(-)		(-)		(-)
CANADIAN APT PPTYS REIT		31.269		1,458		34.809		1,608
		(-)		(-)		(-)		(-)
MORGUARD REAL ESTATE INVNT TR		1.872		23		11.888		145
		(-)		(-)		(-)		(-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT		63.055		1,340		74.795		1,561
		(-)		(△0.00021)		(-)		(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		74.559		1,857		87.619		2,168
		(-)		(-)		(-)		(-)
ALLIED PROPERTIES REIT		21.435		964		22.484		999
		(-)		(-)		(-)		(-)
COMINAR REAL ESTATE INVNT TR		43.668		520		51.892		605
		(-)		(-)		(-)		(-)

	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
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	14.715	343	17.361	405
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHVIEW APARTMENT REIT	13.732	357	13.305	347
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.999	433	12.044	521
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	33.972	363	39.625	427
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	21.802	295	22.991	304
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21.662	275	21.914	268
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28.331	316	27.451	301
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5.315	92	6.065	101
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	44.11	597	48.142	656
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	16.637	184	8.155	86
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGELLAN COMMERCIAL REIT	1.817	24	8.847	121
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	34.28	393	32.393	371
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8.269	475	9.657	541
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	17.602	116	7.137	45
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHOICE PROPERTIES REIT	60.2	758	65.242	811
	(-)	(-)	(-)	(-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.287	139	2.25	43
	(-)	(-)	(-)	(-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20.46	258	16.695	212
	(-)	(-)	(-)	(-)
SLATE RETAIL REIT	-	-	1.333	16
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REIT	14.397	244	12.805	214
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	242.529	854	281.491	965
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRVAC GROUP	1,707.557	4,235	1,871.957	4,516
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVESTA OFFICE FUND	100.574	553	312.012	1,726
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	792.327	843	858.175	919
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	194.63	859	210.659	911
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	815.73	4,457	944.51	5,031
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABACUS PROPERTY GROUP	121.863	423	138.637	471
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	70.981	233	63.558	200
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
STOCKLAND	1,134.738	4,452	1,295.009	4,980
	(-)	(-)	(-)	(-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	105.055	316	110.745	332
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	474.812	5,255	520.639	5,654
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	736.22	8,330	844.47	9,396
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	1,388.558	3,692	1,620.371	4,201
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	204.429	1,599	238.778	1,840
	(-)	(-)	(-)	(-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	120.316	457	124.733	473
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	357.474	919	350.961	875
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARENA REIT	82.031	206	83.801	205
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROPERTYLINK GROUP	85.162	95	236.384	273
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	72.038	317	66.989	289
	(-)	(-)	(-)	(-)
APN INDUSTRIA REIT	10.177	28	13.842	35
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE REIT	232.204	400	212.63	359
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	24.928	83	35.314	110
	(-)	(-)	(-)	(-)
GDI PROPERTY GROUP	116.482	150	164.948	215
	(-)	(-)	(-)	(-)
RURAL FUNDS GROUP	132.102	291	131.091	286
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	2,387.236	9,609	2,758.491	10,773
	(-)	(-)	(-)	(-)
VIVA ENERGY REIT	137.23	321	164.432	372
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	954.5	77,547	1,116.5	88,799
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROSPERITY REIT	475	1,505	535	1,673
	(-)	(-)	(-)	(-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	647	3,348	658	3,335
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHAMPION REIT	683	3,963	863	4,929
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	493	2,629	512	2,656
	(-)	(-)	(-)	(-)
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	467	4,332	578	5,320
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPRING REIT	-	-	351	1,129
	(-)	(-)	(-)	(-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND MALL TRUST	1,392.6	3,168	1,527.5	3,427
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,307.3	3,540	1,409.9	3,776
	(-)	(△16)	(-)	(-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
シンガポール		千□	千シンガポール・ドル			千□	千シンガポール・ドル	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		1,354.3		2,447		1,494.6		2,659
		(-)		(-)		(-)		(-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		1,106.7		2,024		1,251.1		2,259
		(-)		(△12)		(-)		(-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		1,159.6		1,525		1,196.1		1,556
		(-)		(△5)		(-)		(-)
STARHILL GLOBAL REIT		446.8		312		528.1		367
		(-)		(△1)		(-)		(-)
ASCOTT RESIDENCE TRUST		579.6		646		688.9		755
		(-)		(△9)		(-)		(-)
FRASERS COMMERCIAL TRUST		269.8		384		296.4		418
		(-)		(△6)		(-)		(-)
KEPPEL REIT		836		977		979.3		1,137
		(-)		(-)		(-)		(-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST		219.6		503		237.1		531
		(-)		(-)		(-)		(-)
ESR REIT		783.4		406		662.5		335
		(-)		(△0.49376)		(-)		(-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS		284.3		436		341		519
		(-)		(△3)		(-)		(-)
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		258.7		369		259.9		362
		(-)		(△1)		(-)		(-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		311.4		356		349.5		385
		(-)		(△8)		(-)		(-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		289.4		394		306.8		419
		(-)		(△0.80117)		(-)		(-)
PARKWAY LIFE REIT		139.3		378		175.4		468
		(-)		(△3)		(-)		(-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST		721.7		170		948.2		223
		(-)		(△6)		(-)		(-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		555.8		1,095		619.1		1,209
		(-)		(△1)		(-)		(-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		761.3		1,308		915.9		1,553
		(-)		(-)		(-)		(-)
CACHE LOGISTICS TRUST		517.2		371		542.2		384
		(-)		(△0.51059)		(-)		(-)
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		98.2		40		236.8		97
		(-)		(-)		(-)		(-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST		771.3		918		942.2		1,109
		(-)		(△11)		(-)		(-)
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		278.6		230		312.3		256
		(-)		(△2)		(-)		(-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		284.3		179		288.3		180
		(-)		(-)		(-)		(-)
SPH REIT		254.9		257		295.4		296
		(-)		(-)		(-)		(-)
OUE HOSPITALITY TRUST		382.9		268		426.2		296
		(-)		(-)		(-)		(-)
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT		172.7		104		192.4		112
		(-)		(△0.09142)		(-)		(-)
FRASERS HOSPITALITY TRUST		398.4		285		125.4		89
		(-)		(△4)		(-)		(-)
KEPPEL DC REIT		408.1		577		469.3		654
		(-)		(-)		(-)		(-)
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST		820.8		886		837.9		898
		(-)		(△10)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
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	476.379	706	519.884	758
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	131.176	281	133.251	280
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	479.081	754	558.658	868
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	610.536	865	704.745	990
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	279.934	331	353.982	415
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVESTORE PROPERTY LTD	-	-	88.877	135
	(-)	(-)	(-)	(-)
STRIDE STAPLED GROUP	132.924	262	141.986	273
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	454.367	2,653	536.609	3,171
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAPITAL & REGIONAL PLC	97.167	33	191.461	64
	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	50.122	1,541	58.014	1,752
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	60.671	569	69.34	653
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	358.576	1,389	422.594	1,668
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	346.004	2,983	397.676	3,475
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	61.546	581	65.953	622
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTU PROPERTIES PLC	337.034	468	413.403	632
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	118.308	1,039	138.011	1,204
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	346.823	419	264.264	299
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	103.837	915	126.292	1,120
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	504.351	3,270	549.647	3,507
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	116.446	832	140.521	995
	(-)	(4)	(-)	(-)
ASSURA PLC	979.633	561	1,138.511	642
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	210.591	124	227.094	132
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	257.154	230	62.879	58
	(-)	(-)	(-)	(-)
HANSTEEN HOLDINGS PLC	146.332	137	154.385	145
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	544.164	483	316.63	272
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	96.354	544	113.596	636
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	302.075	564	345.983	645
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
RDI REIT PLC	268.946 (△435.616)	85 (-)	284.57 (-)	119 (-)
NEWRIVER REIT PLC	103.299 (-)	231 (-)	130.334 (-)	308 (-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	278.488 (-)	278 (-)	124.548 (-)	116 (-)
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	- (-)	- (-)	37.06 (-)	35 (-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	249.974 (-)	258 (-)	115.017 (-)	116 (-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	730.342 (-)	1,046 (-)	758.831 (-)	1,092 (-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	195.483 (-)	183 (-)	227.97 (-)	213 (-)
LXI REIT PLC	163.221 (-)	199 (-)	102.424 (-)	127 (-)
REGIONAL REIT LTD	42.589 (-)	43 (-)	50.002 (-)	50 (-)
イスラエル	千□	千イスラエル・シェケル	千□	千イスラエル・シェケル
REIT 1 LTD	49.236 (-)	741 (-)	55.868 (-)	848 (-)
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	11.931 (-)	68,035 (-)	2.615 (-)	16,416 (-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GREEN REIT PLC	236.998 (-)	359 (-)	289.749 (-)	436 (-)
HIBERNIA REIT PLC	301.843 (-)	419 (-)	359.133 (-)	497 (-)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	123.754 (-)	185 (-)	138.475 (-)	204 (-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18.473 (-)	525 (-)	25.483 (-)	749 (-)
VASTNED RETAIL	6.129 (-)	200 (-)	6.597 (-)	217 (-)
WERELDHAVE NV	18.915 (-)	542 (-)	21.418 (-)	611 (-)
NSI NV	5.389 (-)	189 (-)	6.676 (-)	233 (-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	62.815 (-)	9,724 (-)	71.729 (-)	11,288 (-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
BEFIMMO	9.827 (-)	494 (-)	11.687 (-)	582 (-)
COFINIMMO SA	10.427 (-)	1,144 (-)	11.214 (-)	1,220 (-)
RETAIL ESTATES	3.173 (-)	240 (-)	3.796 (-)	287 (-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8.965 (-)	205 (-)	7.531 (-)	173 (-)
WAREHOUSES DE PAUW	7.777 (-)	944 (-)	8.578 (-)	1,030 (-)
MONTEA SCA	5.495 (-)	379 (-)	1.933 (-)	144 (-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
ユーロ (ベルギー)		千□		千ユーロ		千□		千ユーロ
AEDIFICA		9.653		765		8.616		674
		(-)		(-)		(-)		(-)
COFINIMMO SA-RTS		-		-		8.342		5
		(-)		(-)		(-)		(-)
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES-RTS		-		-		6.367		1
		(6.367)		(-)		(-)		(-)
MONTEA CVA-RTS		-		-		2.68		1
		(2.68)		(-)		(-)		(-)
AEDIFICA SA-RTS		-		-		7.159		23
		(7.159)		(-)		(-)		(-)
ユーロ (フランス)		千□		千ユーロ		千□		千ユーロ
GECINA SA		27.493		3,620		28.486		3,740
		(-)		(-)		(-)		(-)
ICADE		18.147		1,356		20.929		1,547
		(-)		(-)		(-)		(-)
ALTAREA		1.082		195		1.391		258
		(-)		(-)		(-)		(-)
KLEPIERRE		93.413		2,800		109.79		3,292
		(-)		(-)		(-)		(-)
COVIVIO		24.261		2,156		27.794		2,471
		(-)		(-)		(-)		(-)
MERCIALYS		18.313		228		22.454		280
		(-)		(-)		(-)		(-)
COVIVIO		-		-		-		-
		(2.776)		(-)		(-)		(-)
ユーロ (ドイツ)		千□		千ユーロ		千□		千ユーロ
HAMBORNER REIT AG		28.848		261		34.209		305
		(-)		(-)		(-)		(-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		69.158		888		74.4		959
		(-)		(△24)		(-)		(-)
ユーロ (スペイン)		千□		千ユーロ		千□		千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		132.264		1,204		171.48		1,538
		(-)		(-)		(-)		(-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		29.717		235		44.258		357
		(-)		(△1)		(-)		(-)
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA		4.117		75		50.296		917
		(-)		(-)		(-)		(-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		151.755		1,734		163.968		1,881
		(-)		(△13)		(-)		(-)
ユーロ (イタリア)		千□		千ユーロ		千□		千ユーロ
BENI STABILI SPA		185.952		139		286.949		208
		(△336.763)		(-)		(-)		(-)
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		11.626		69		15.741		97
		(-)		(△0.18159)		(-)		(-)

(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 (2018年6月23日から2019年6月24日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	柄	期首(前期末)		当期		期末	
		□	数	□	数	外貨建金額 千円	邦貨換算金額 比率
不動産ファンド (アメリカ)		千口		千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MANULIFE US REIT		511.5		456.5	394	42,417	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		43.436		40.032	5,815	624,738	1.3
ALEXANDER'S INC.		1.606		1.406	525	56,433	0.1
BOSTON PROPERTIES INC		65.092		54.797	7,456	800,947	1.7
CEDAR REALTY TRUST INC		33.531		27.397	72	7,828	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		84.226		74.959	2,852	306,382	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A		66.724		52.06	2,663	286,157	0.6
AGREE REALTY CORP		13.167		13.141	877	94,252	0.2
BRT APARTMENTS CORP		—		2.813	36	3,967	0.0
SL GREEN		37.248		29.965	2,532	272,056	0.6
EPR PROPERTIES		27.43		26.376	2,049	220,204	0.5
PROLOGIS INC		224.948		221.421	18,008	1,934,437	4.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC		58.29		49.184	10,220	1,097,879	2.3
LEXINGTON REALTY TRUST		91.973		76.871	747	80,262	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		39.066		34.249	3,636	390,602	0.8
CBL & ASSOCIATES		72.069		47.062	44	4,822	0.0
MACK CALI		38.286		31.711	755	81,208	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		65.269		57.252	3,148	338,250	0.7
COUSINS PROPERTIES INC		178.182		51.859	1,983	213,079	0.4
LASALLE HOTEL PROPERTIES		46.458		—	—	—	—
URSTADT BIDDLE PROPERTIES		12.432		11.393	244	26,263	0.1
SITE CENTERS CORP		64.983		50.198	679	72,957	0.2
ISTAR INC		28.395		—	—	—	—
DUKE REALTY TRUST		150.436		127.358	4,063	436,554	0.9
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		39.727		25.699	79	8,530	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		27.845		23.315	6,994	751,299	1.6
EQUITY RESIDENTIAL		155.294		130.924	10,215	1,097,402	2.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST		30.863		26.353	3,526	378,822	0.8
FIRST INDUSTRIAL RT		52.771		44.501	1,642	176,392	0.4
GGP INC		266.85		—	—	—	—
HCP INC		198.084		169.495	5,542	595,373	1.3
EQUITY COMMONWEALTH		51.112		42.702	1,416	152,152	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		52.993		44.016	1,431	153,808	0.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC		43.81		36.411	1,583	170,140	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST		69.715		57.784	1,437	154,434	0.3
WELLTOWER INC		156.947		137.308	11,485	1,233,806	2.6
EAST GROUP		14.741		12.816	1,494	160,522	0.3
KIMCO REALTY		179.68		149.202	2,819	302,915	0.6
KILROY REALTY CORP		41.605		35.671	2,709	291,061	0.6
LTC PROPERTIES INC		16.835		14.61	679	72,961	0.2
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST		100.809		83.031	678	72,869	0.2
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A		33.032		34.32	474	50,986	0.1
LIBERTY PROPERTY TRUST		62.537		52.372	2,663	286,071	0.6
BRANDYWINE REALTY TRUST		74.331		61.895	930	99,997	0.2
IRON MOUNTAIN INC		118.572		101.232	3,245	348,631	0.7
THE MACERICH COMPANY		45.998		37.186	1,255	134,894	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		37.342		32.042	3,912	420,262	0.9
ACADIA REALTY TRUST		34.26		28.451	807	86,735	0.2
HOST HOTELS & RESORTS INC		312.724		262.621	4,771	512,589	1.1
MID AMERICA		47.941		40.303	4,799	515,582	1.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST		15.638		13.759	231	24,904	0.1
NATIONAL HEALTH INVS INC		17.625		14.991	1,206	129,567	0.3
INVESTORS REAL ESTATE TRUST		50.011		4.546	271	29,138	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC		6.553		4.255	132	14,214	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST		29.416		17.505	108	11,696	0.0
GETTY REALTY CORP		13.326		12.616	393	42,296	0.1

銘柄	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	%
PS BUSINESS PARKS		8.446	7.004	1,234	132,612	0.3
RPT REALTY		33.773	27.63	347	37,337	0.1
REALTY INCOME CORP		119.894	107.748	7,784	836,242	1.8
REGENCY CENTERS CORP		62.085	59.384	4,128	443,470	0.9
UDR INC		113.114	97.737	4,464	479,590	1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES		42.988	38.643	1,094	117,598	0.2
CORECIVIC INC		50.174	41.521	928	99,774	0.2
SAUL CENTERS INC		5.042	4.421	244	26,243	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC		130.666	108.459	17,797	1,911,757	4.0
LIFE STORAGE INC		19.733	16.395	1,591	170,919	0.4
PUBLIC STORAGE		63.208	52.671	12,667	1,360,729	2.9
SUN COMMUNITIES INC		33.726	30.554	3,967	426,182	0.9
TAUBMAN CENTERS INC		25.845	21.393	902	96,977	0.2
TANGER FACTORY OUTLET		40.143	32.737	527	56,687	0.1
UMH PROPERTIES INC		14.882	13.433	175	18,888	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		12.671	11.234	241	25,921	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME		5.259	4.708	407	43,781	0.1
VENTAS INC		150.254	126.445	8,891	955,137	2.0
VORNADO REALTY TRUST		73.134	61.491	4,105	441,040	0.9
WASHINGTON REIT		33.313	27.867	770	82,799	0.2
GEO GROUP INC		51.638	42.24	928	99,777	0.2
WEINGARTEN REALTY INVST		50.686	41.968	1,190	127,897	0.3
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES		57.893	49.096	2,296	246,712	0.5
KITE REALTY GROUP TRUST		35.532	31.031	482	51,866	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC		53.193	45.051	4,853	521,394	1.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		44.756	40.56	307	33,025	0.1
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		95.603	80.002	1,085	116,618	0.2
CUBESMART		77.311	66.756	2,280	244,958	0.5
DIGITAL REALTY TRUST INC		86.876	73.766	9,084	975,833	2.1
EDUCATION REALTY TRUST INC		32.161	—	—	—	—
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		85.121	73.922	754	81,074	0.2
MEDICAL PROPERTIES TRUST		154.694	136.49	2,485	266,990	0.6
DOUGLAS EMMETT INC		67.6	57.933	2,368	254,402	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC		39.742	—	—	—	—
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C		47.738	41.878	724	77,824	0.2
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC		54.405	43.929	903	97,019	0.2
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC		44.281	38.836	443	47,683	0.1
TERRENO REALTY CORP		23.552	21.401	1,026	110,232	0.2
AMERICAN ASSETS TRUST INC		17.616	13.155	624	67,108	0.1
RLJ LODGING TRUST		74.135	61.408	1,094	117,614	0.2
AMERICOLD REALTY TRUST		19.99	65.012	2,209	237,302	0.5
CORESITE REALTY CORP		14.529	12.902	1,514	162,666	0.3
VEREIT INC		407.682	342.119	3,250	349,129	0.7
CHESAPEAKE LODGING TRUST		25.52	21.119	605	65,063	0.1
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		29.264	45.82	1,304	140,079	0.3
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST		42.132	17.851	467	50,220	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES		16.134	16.36	244	26,220	0.1
CHATHAM LODGING TRUST		19.517	17.398	334	35,882	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC		75.62	62.571	1,224	131,537	0.3
WHITESTONE REIT		17.842	15.361	197	21,203	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC		65.87	54.303	1,843	198,038	0.4
STAG INDUSTRIAL INC		40.858	43.588	1,361	146,272	0.3
SELECT INCOME REIT		27.352	—	—	—	—
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC		92.273	74.671	907	97,537	0.2
CYRUSONE INC		41.756	38.14	2,289	245,901	0.5
WP CAREY INC		45.338	60.124	5,145	552,720	1.2
ALEXANDER & BALDWIN INC		28.742	—	—	—	—
GLADSTONE LAND CORP		5.526	4.129	47	5,145	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC		86.903	72.282	2,050	220,279	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		21.716	18.038	1,454	156,193	0.3

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
WHEELER REIT INC	2.961	—	—	—	—	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	—	18.755	228	24,558	0.1	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	19.187	—	—	—	—	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	68.158	—	—	—	—	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	180.298	30.159	1,354	145,461	0.3	
PHYSICIANS REALTY TRUST	76.067	63.958	1,144	122,910	0.3	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	34.068	36.539	1,486	159,709	0.3	
AMERICAN HOMES 4 RENT	110.338	92.275	2,305	247,705	0.5	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	35.997	33.291	393	42,305	0.1	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	—	3.694	434	46,633	0.1	
JBG SMITH PROPERTIES	39.622	41.967	1,699	182,532	0.4	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	—	20.602	219	23,613	0.0	
RETAIL VALUE INC	—	5.916	202	21,714	0.0	
INVITATION HOMES INC	120.949	135.096	3,667	394,001	0.8	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	13.143	—	—	—	—	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	113.135	—	—	—	—	
QTS REALTY TRUST INC	21.476	19.246	894	96,134	0.2	
SPIRIT MTA REIT	17.097	13.946	122	13,108	0.0	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	55.942	48.864	758	81,464	0.2	
SAFEHOLD INC	—	2.744	78	8,433	0.0	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	—	17.735	370	39,816	0.1	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	8.484	24.28	493	52,971	0.1	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	49.73	40.874	901	96,814	0.2	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	84.705	71.712	2,889	310,366	0.7	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	127.551	105.086	1,935	207,931	0.4	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13.902	8.936	87	9,407	0.0	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	33.378	653	70,167	0.1	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	8.916	6.509	76	8,166	0.0	
FARMLAND PARTNERS INC	14.523	9.63	65	7,034	0.0	
CITY OFFICE REIT INC	14.463	15.324	189	20,378	0.0	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	78.952	70.292	278	29,901	0.1	
CARETRUST REIT INC	32.366	33.024	814	87,515	0.2	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34.578	31.63	218	23,478	0.0	
STORE CAPITAL CORP	72.549	70.644	2,471	265,524	0.6	
PARAMOUNT GROUP INC	86.597	70.246	1,029	110,546	0.2	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8.278	7.336	82	8,896	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	44.936	44.064	790	84,869	0.2	
INFRAREIT INC	16.132	—	—	—	—	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	18.694	25.372	464	49,930	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	45.298	39.522	828	88,984	0.2	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7.762	8.002	328	35,233	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	21.369	19.694	583	62,640	0.1	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6.974	6.76	266	28,668	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	91.138	75.452	1,194	128,303	0.3	
GLOBAL NET LEASE INC	28.621	29.176	577	62,086	0.1	
TIER REIT INC	20.328	—	—	—	—	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	39.836	—	—	—	—	
CLIPPER REALTY INC	5.169	5.169	63	6,790	0.0	
PARK HOTELS & RESORTS INC	85.299	70.84	1,998	214,667	0.5	
VICI PROPERTIES INC	—	127.279	2,900	311,591	0.7	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	21.513	18.806	300	32,241	0.1	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	11.004	10.32	440	47,369	0.1	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26.006	25.108	711	76,381	0.2	
COLONY CAPITAL INC	208.616	171.468	886	95,226	0.2	
小計	口数金額 銘柄数<比率>	9,953,908 161銘柄<71.3%>	7,983,341 155銘柄<72.3%>	319,298 —	34,299,078 —	— 72.3
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%	
SMARTCENTRES REIT	27.854	24.167	823	67,014	0.1	
CANADIAN APT PPTYS REIT	29.587	26.047	1,284	104,556	0.2	
MORGUARD REAL ESTATE INVNT TR	10.016	—	—	—	—	

銘柄	期首(前期末)		当		期		末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	率		
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		%		
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	60.656	48.916	1,128	91,847		0.2		
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	65.342	52.282	1,393	113,401		0.2		
ALLIED PROPERTIES REIT	19.518	18.469	886	72,153		0.2		
COMINAR REAL ESTATE INVNT TR	38.546	30.322	376	30,676		0.1		
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	12.463	9.817	239	19,495		0.0		
NORTHVIEW APARTMENT REIT	10.096	10.523	287	23,415		0.0		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.781	7.736	314	25,588		0.1		
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	30.141	24.488	287	23,398		0.0		
CROMBIE REAL ESTATE INV	18.049	16.86	267	21,777		0.0		
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20.114	19.862	280	22,793		0.0		
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	21.137	22.017	262	21,324		0.0		
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	7.446	6.696	122	9,978		0.0		
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM	37.235	33.203	465	37,860		0.1		
DREAM INDUSTRIAL REIT	13.888	22.37	270	22,030		0.0		
AGELLAN COMMERCIAL REIT	7.03	—	—	—		—		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	17.406	19.293	256	20,884		0.0		
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	9.917	8.529	531	43,240		0.1		
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	—	10.465	69	5,689		0.0		
CHOICE PROPERTIES REIT	58.346	53.304	747	60,867		0.1		
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	—	5.037	96	7,854		0.0		
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12.724	16.489	239	19,513		0.0		
SLATE RETAIL REIT	7.739	6.406	80	6,579		0.0		
SLATE OFFICE REIT	12.079	12.079	72	5,888		0.0		
KILLAM APARTMENT REIT	15.367	16.959	333	27,122		0.1		
小計	口数・金額	572,477	522,336	11,118	904,955	—	—	
銘柄数<比率>	25銘柄<1.8%>	25銘柄<1.9%>	—	—	—	1.9		
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		%		
BWP TRUST	205.883	166.921	645	48,267		0.1		
MIRVAC GROUP	1,562.622	1,398.222	4,404	329,096		0.7		
INVESTA OFFICE FUND	211.438	—	—	—		—		
CROMWELL PROPERTY GROUP	674.83	608.982	761	56,878		0.1		
CHARTER HALL RETAIL REIT	140.441	124.412	577	43,133		0.1		
GPT GROUP	761.372	632.592	3,966	296,365		0.6		
ABACUS PROPERTY GROUP	137.44	120.666	520	38,859		0.1		
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	88.555	95.978	368	27,538		0.1		
STOCKLAND	1,031.289	871.018	3,762	281,156		0.6		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	85.235	79.545	256	19,197		0.0		
DEXUS	429.175	383.348	5,167	386,117		0.8		
GOODMAN GROUP	676.39	568.14	8,567	640,167		1.4		
VICINITY CENTRES	1,363.217	1,131.404	2,964	221,490		0.5		
CHARTER HALL GROUP	196.697	162.348	1,803	134,771		0.3		
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	104.165	99.748	428	32,048		0.1		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	307.102	313.615	802	59,989		0.1		
ARENA REIT	108.676	106.906	306	22,925		0.0		
PROPERTYLINK GROUP	151.222	—	—	—		—		
CHARTER HALL LONG WALE REIT	72.501	77.55	396	29,610		0.1		
APN INDUSTRIA REIT	42.579	38.914	114	8,577		0.0		
NATIONAL STORAGE REIT	223.901	243.475	445	33,292		0.1		
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62.65	52.264	183	13,707		0.0		
GDI PROPERTY GROUP	208.566	160.1	228	17,106		0.0		
RURAL FUNDS GROUP	104.894	105.905	248	18,596		0.0		
SCENTRE GROUP	2,259.234	1,887.979	7,268	543,118		1.1		
VIVA ENERGY REIT	183.737	156.535	425	31,813		0.1		
小計	口数・金額	11,393,811	9,586,567	44,617	3,333,828	—	—	
銘柄数<比率>	26銘柄<6.9%>	24銘柄<7.0%>	—	—	—	7.0		
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円		%		
LINK REIT	910.52	748.52	71,932	989,075		2.1		
PROSPERITY REIT	522	462	1,570	21,598		0.0		
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	492	481	2,578	35,449		0.1		
CHAMPION REIT	871.07	691.07	4,485	61,669		0.1		

銘 柄	期 首(前期末)		当 期			末	
	口	数	口	数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(香港)		千口		千口	千香港・ドル	千円	%
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		403		384	2,284	31,416	0.1
FORTUNE REAL ESTATE (HK)		588		477	5,094	70,047	0.1
SPRING REIT		351		—	—	—	—
小 計	口	4,137.59	口	3,243.59	87,945	1,209,256	—
銘 柄 数<比 率>	7銘柄<2.1%>	—	6銘柄<2.6%>	—	—	—	2.6
(シンガポール)		千口		千口	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPITALAND MALL TRUST		1,136.76		1,001.86	2,564	203,539	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV		1,014.36		911.76	2,771	219,966	0.5
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		1,132.679		992.379	2,123	168,536	0.4
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		952.79		808.39	1,568	124,458	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		876.22		839.72	1,318	104,625	0.2
STARHILL GLOBAL REIT		550.5		469.2	363	28,857	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		548.015		438.715	570	45,261	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		270.88		244.28	385	30,629	0.1
KEPPEL REIT		769.7		626.4	789	62,635	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		247.6		230.1	584	46,382	0.1
ESR REIT		539.43		660.33	353	28,036	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		314.3		257.6	414	32,913	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		234.58		233.38	359	28,522	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU		236.6		198.5	202	16,068	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		235.095		217.695	317	25,223	0.1
PARKWAY LIFE REIT		167.7		131.6	402	31,957	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU		798.3		571.8	131	10,436	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		524.22		460.92	995	79,009	0.2
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		811.8		657.2	1,334	105,875	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST		435.78		410.78	328	26,079	0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		357.2		218.6	98	7,806	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		912.6		741.7	1,068	84,760	0.2
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		317.2		283.5	277	22,048	0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		359.6		355.6	240	19,048	0.0
SPH REIT		265.4		224.9	238	18,918	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST		488.62		445.32	316	25,091	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT		276.1		256.4	156	12,412	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		—		273	193	15,382	0.0
KEPPEL DC REIT		402.2		341	552	43,840	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL T		572.75		555.65	677	53,797	0.1
小 計	口	15,748.979	口	14,058.279	21,700	1,722,122	—
銘 柄 数<比 率>	29銘柄<3.2%>	—	30銘柄<3.6%>	—	—	—	3.6
(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		423.696		380.191	661	46,876	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		129.943		127.868	310	22,017	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST		441.448		361.871	698	49,489	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD		606.953		512.744	825	58,496	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		356.878		282.83	383	27,156	0.1
INVESTORE PROPERTY LTD		88.877		—	—	—	—
STRIDE STAPLED GROUP		149.101		140.039	308	21,830	0.0
小 計	口	2,196.896	口	1,805.543	3,187	225,866	—
銘 柄 数<比 率>	7銘柄<0.4%>	—	6銘柄<0.5%>	—	—	—	0.5
(イギリス)		千口		千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC		419.592		337.35	1,821	249,462	0.5
CAPITAL & REGIONAL PLC		229.731		135.437	18	2,540	0.0
DERWENT LONDON PLC		46.537		38.645	1,218	166,805	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC		63.285		54.616	543	74,491	0.2
HAMMERSON PLC		333.513		269.495	750	102,816	0.2
LAND SECURITIES GROUP PLC		317.138		265.466	2,210	302,674	0.6
WORKSPACE GROUP PLC		50.811		46.404	411	56,301	0.1
INTU PROPERTIES PLC		372.244		295.875	224	30,711	0.1
UNITE GROUP PLC		111.92		92.217	891	122,114	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC		312.94		395.499	523	71,707	0.2
SHAFTESBURY PLC		103.012		80.557	659	90,292	0.2

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
(イギリス)	千口	千口	千口	千円	千円	%
SEGRO PLC	425.024	379.728	2,820	386,255	0.8	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	119.899	95.824	669	91,645	0.2	
ASSURA PLC	1,013.326	854.448	541	74,183	0.2	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	221.364	204.861	114	15,625	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	—	194.275	188	25,752	0.1	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	167.573	159.52	152	20,817	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	—	227.534	199	27,294	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	89.348	72.106	446	61,121	0.1	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	295.326	251.418	506	69,409	0.1	
RDI REIT PLC	528.881	77.641	80	10,972	0.0	
NEWRIVER REIT PLC	131.034	103.999	194	26,631	0.1	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	81.48	235.42	185	25,403	0.1	
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37.06	—	—	—	—	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	—	134.957	112	15,413	0.0	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	626.95	598.461	921	126,208	0.3	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	228.6	196.113	180	24,680	0.1	
LXI REIT PLC	73.4	134.197	167	22,971	0.0	
REGIONAL REIT LTD	118.301	110.888	120	16,460	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	6,518.289 26銘柄<5.7%>	6,042.951 28銘柄<4.9%>	16,874	2,310,766	— 4.9
(イスラエル)	千口	千口	千口	千円	千円	%
REIT 1 LTD	70.287	63.655	1,128	33,530	0.1	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	70.287 1銘柄<0.1%>	63.655 1銘柄<0.1%>	1,128	33,530	— 0.1
(韓国)	千口	千口	千口	千円	千円	%
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	—	9.316	63,255	5,870	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	— —銘柄<—%>	9,316 1銘柄<0.0%>	63,255	5,870	— 0.0
(ユーロ…アイルランド)	千口	千口	千口	千円	千円	%
GREEN REIT PLC	293.629	240.878	422	51,646	0.1	
HIBERNIA REIT PLC	299.53	242.24	340	41,574	0.1	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	138.876	124.155	206	25,223	0.1	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	732.035 3銘柄<0.3%>	607.273 3銘柄<0.2%>	968	118,444	— 0.2
(ユーロ…オランダ)	千口	千口	千口	千円	千円	%
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21.124	14.114	347	42,442	0.1	
VASTNED RETAIL	6.794	6.326	175	21,420	0.0	
WERELDHAVE NV	16.816	14.313	335	40,976	0.1	
NSI NV	7.625	6.338	237	28,975	0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	57.184	48.27	6,475	791,555	1.7	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	109.543 5銘柄<3.0%>	89,361 5銘柄<2.0%>	7,570	925,369	— 2.0
(ユーロ…ベルギー)	千口	千口	千口	千円	千円	%
BEFIMMO	9.8	7.94	409	50,082	0.1	
COFINIMMO SA	8.205	7.418	830	101,558	0.2	
RETAIL ESTATES	3.232	2.609	204	24,971	0.1	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6.873	8.307	211	25,893	0.1	
WAREHOUSES DE PAUW	7.037	6.236	897	109,769	0.2	
MONTEA SCA	—	3.562	265	32,438	0.1	
AEDIFICA	7.647	8.684	719	87,894	0.2	
COFINIMMO SA-RTS	8.342	—	—	—	—	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	51.136 7銘柄<0.7%>	44,756 7銘柄<0.9%>	3,539	432,609	— 0.9
(ユーロ…フランス)	千口	千口	千口	千円	千円	%
GECINA SA	20.261	19.268	2,605	318,439	0.7	
ICADE	18.935	16.153	1,281	156,679	0.3	
ALTAREA	1.518	1.209	217	26,631	0.1	
KLEPIERRE	87.317	70.94	2,111	258,069	0.5	
COVIVIO	22.663	21.906	2,018	246,758	0.5	

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		
(ユーロ…フランス)		千□	千□	千ユーロ	千円		%		
MERCIALYS		22,547	18,406	210	25,739		0.1		
小 計	□ 数	173,241	147,882	8,445	1,032,318		—		
	銘 柄 数<比 率>	6銘柄<2.4%>	6銘柄<2.2%>	—	—		2.2		
(ユーロ…ドイツ)		千□	千□	千ユーロ	千円		%		
HAMBORNER REIT AG		33.143	27.782	247	30,292		0.1		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		61.358	56.116	788	96,377		0.2		
小 計	□ 数	94,501	83,898	1,036	126,670		—		
	銘 柄 数<比 率>	2銘柄<0.3%>	2銘柄<0.3%>	—	—		0.3		
(ユーロ…スペイン)		千□	千□	千ユーロ	千円		%		
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		136.98	97.764	999	122,135		0.3		
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		39.724	25.183	172	21,117		0.0		
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS S		46.179	—	—	—		—		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		140.114	127.901	1,580	193,243		0.4		
小 計	□ 数	362,997	250,848	2,752	336,497		—		
	銘 柄 数<比 率>	4銘柄<1.0%>	3銘柄<0.7%>	—	—		0.7		
(ユーロ…イタリア)		千□	千□	千ユーロ	千円		%		
BENI STABILI SPA		437.76	—	—	—		—		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		20.03	15.915	94	11,555		0.0		
小 計	□ 数	457.79	15,915	94	11,555		—		
	銘 柄 数<比 率>	2銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	—	—		0.0		
合 計	□ 数	52,573.48	44,555.511	—	47,028,742		—		
	銘 柄 数<比 率>	311銘柄<99.3%>	303銘柄<99.2%>	—	—		99.2		

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、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

2019年6月24日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券	千円 47,028,742	% 99.2	千円 47,410,913	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	382,171	0.8	382,171	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	47,410,913	100.0	47,410,913	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、47,359,422千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.42円、1カナダ・ドル=81.39円、1オーストラリア・ドル=74.72円、1香港・ドル=13.75円、1シンガポール・ドル=79.36円、1ニュージーランド・ドル=70.86円、1イギリス・ポンド=136.94円、1イスラエル・シェケル=29.71円、100韓国・ウォン=9.28円、1ユーロ=122.24円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年6月24日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	47,623,950,891円
コ	ー	133,244,022
投	信	5,083,074,363
投	託	41,945,667,910
未	資	361,567,209
未	収	100,397,387
(B) 負	配	213,744,900
未	入	213,036,900
未	当	708,000
(C) 純	金	47,410,205,991
資	金	36,301,672,788
産	金	11,108,533,203
総	損	36,301,672,788円
額(A-B)	益	13,060円
元	金	
次	金	
期	金	
繰	金	
越	金	
損	金	
益	金	
(D) 受	口	36,301,672,788円
益	数	
権	口	
総	口	
口	数	
1	口	
万	口	
口	口	
当	口	
た	口	
り	口	
基	口	
準	口	
価	口	
額	口	
(C/D)	口	

(注1) 期首元本額 44,369,434,317円
追加設定元本額 48,480,219,419円
一部解約元本額 56,547,980,948円

(注2) 期末における元本の内訳
先進国REITインデックスF<為替ヘッジなし> (ファンドラップ) 160,560,827円
先進国REITインデックスF<為替ヘッジあり> (ファンドラップ) 93,381,433円
MITO ラップ型ファンド (安定型) 5,570,605円
MITO ラップ型ファンド (中立型) 14,365,615円
MITO ラップ型ファンド (積極型) 22,970,643円
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 53,567,046円
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 38,170,950円
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 28,280,765円
たわらノーロード 先進国リート 3,920,685,465円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> 599,465,183円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> 151,921,418円
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 326,595,821円
たわらノーロード バランス (堅実型) 2,096,319円
たわらノーロード バランス (標準型) 42,404,047円
たわらノーロード バランス (積極型) 94,801,723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) 17,099,439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) 87,460,533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) 76,847,691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) 204,814,938円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 676,227円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 2,026,563円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 1,696,987円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 5,195,023円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 19,026,187円
マネックス資産設計ファンド (育成型) 520,077,807円
マネックス資産設計ファンド エボリューション 53,216,299円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 175,540,190円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 158,001,161円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 310,814,217円
投資のソムリエ 7,768,303,637円
投資のソムリエ<DC年金> 795,364,191円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> 135,937,313円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 282,312,537円
ダイナミック・ナビゲーション 746,055円

リスク抑制世界8資産バランスファンド 4,021,843,742円
ワールドアセットバランス (基本コース) 951,671,015円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 3,735,792,629円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 4,282,362円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 3,668,511円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 2,038,670円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 7,614,992円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 673,546,769円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 16,954,156円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 794,026円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 794,026円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 794,026円
DIAMパッシブ資産分散ファンド 834,894,408円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金> 40,270,163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) 363,780,773円
DIAMグローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け) 12,032,969円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 3,432,240,792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) 2,009,502,069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) 3,461,256,521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) 557,905,314円
期末元本合計 36,301,672,788円

■損益の状況

当期 自2018年6月23日 至2019年6月24日

項 目					当 期
(A) 配 当 受 取 等 配 収 当 益 金					2,193,044,685円
受 取 等 配 収 当 益 金					2,191,595,379
受 取 等 配 収 当 益 金					1,865,527
支 払 利 利 息 息					△416,221
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益					1,897,564,952
売 買 益 益					7,074,533,912
売 買 損 損					△5,176,968,960
(C) そ の 他 費 用					△51,136,964
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)					4,039,472,673
(E) 前 期 繰 越 損 益 金					8,778,934,476
(F) 解 約 差 損 益 金					△12,880,878,527
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金					11,171,004,581
(H) 合 計(D + E + F + G)					11,108,533,203
次 期 繰 越 損 益 金(H)					11,108,533,203

(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。