

## 運用報告書 (全体版)

第9期<決算日2019年10月11日>

### D I A M コア資産設計ファンド (積極型)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合	
信託期間	2015年8月28日から無期限です。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。	
主要投資対象	D I A M コア資産設計 ファンド (積極型)	以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券 ( E T F ) 、短期金融資産等に投資する場合があります。
	国内債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド (厳選化型)・マザーファンド	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式パッシブ・ ファンド・マザーファンド	海外の株式を主要投資対象とします。
	エマージング債券 パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	エマージング株式 パッシブ・マザーファンド	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
	マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本、先進国および新興国の債券・株式の6資産に実質的に分散投資を行います。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券 ( E T F ) 、短期金融資産等 <sup>(*)</sup> に投資する場合があります。 (*) 市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 6資産の配分比率 (基本配分比率) は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。 基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率 (合計資産比率) を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時には基準価額の下落を一定水準 (下値目安値 <sup>(**)</sup> ) までに抑えることをめざします。なお、下値目安値は、3ヵ月毎に改定します。 (*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません (相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります)。	
投資制限	各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。	
分配方針	決算日 (原則として4月、10月の各11日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

愛称：まもラップ (積極型)

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、「D I A M コア資産設計ファンド (積極型)」は、2019年10月11日に第9期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

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

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

## DIAMコア資産設計ファンド（積極型）

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	債券先物比率	投資信託受益証券、債券投資比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率								
	円	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
5期(2017年10月11日)	10,451	0	7.8	58.7	1.9	36.7	—	—	—	0.4	312
6期(2018年4月11日)	10,571	0	1.1	7.7	0.3	5.7	—	—	—	0.1	297
7期(2018年10月11日)	10,089	0	△4.6	26.1	1.4	18.5	—	—	—	0.2	290
8期(2019年4月11日)	10,353	0	2.6	58.5	2.3	30.5	—	—	—	0.4	310
9期(2019年10月11日)	9,819	0	△5.2	10.7	0.7	6.4	—	—	—	0.1	281

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

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

### ■当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	債券先物比率	投資信託受益証券、債券投資比率
	騰落率								
(期首)	円	%	%	%	%	%	%	%	%
2019年4月11日	10,353	—	58.5	2.3	30.5	—	—	—	0.4
4月末	10,348	△0.0	54.0	2.6	30.1	—	—	—	0.3
5月末	10,050	△2.9	14.1	0.7	8.5	—	—	—	0.1
6月末	10,073	△2.7	8.3	0.4	4.9	—	—	—	0.1
7月末	10,058	△2.8	44.3	2.0	24.9	—	—	—	0.5
8月末	9,777	△5.6	9.9	0.5	6.2	—	—	—	0.2
9月末	9,820	△5.1	10.7	0.5	6.3	—	—	—	0.1
(期末)									
2019年10月11日	9,819	△5.2	10.7	0.7	6.4	—	—	—	0.1

(注1) 騰落率は期首比です。

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

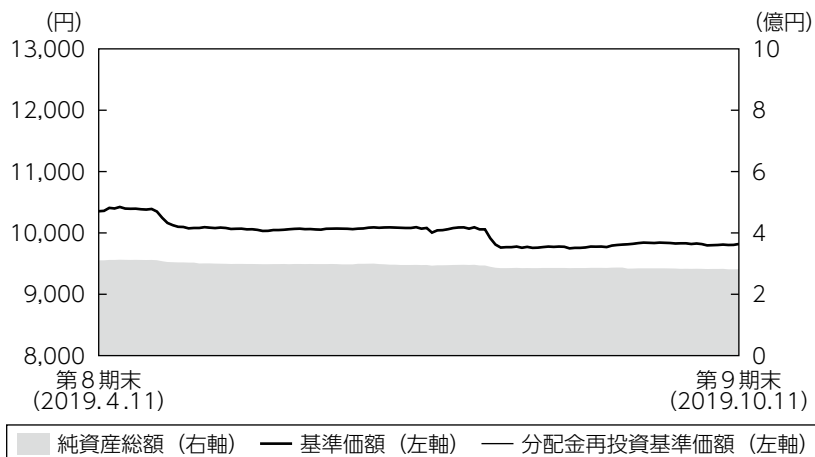
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2019年4月12日から2019年10月11日まで）

### 基準価額等の推移



第9期首：10,353円  
 第9期末：9,819円  
 （既払分配金0円）  
 騰落率：△5.2%  
 （分配金再投資ベース）

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

### 基準価額の主な変動要因

債券市場が上昇したことがプラスに寄与したものの、主要通貨に対して円高が進んだことが大きくマイナス寄与し、基準価額は下落しました。米中貿易摩擦に伴う米中関係の深刻化が懸念されたことや、米・欧による利下げ、ECB（欧州中央銀行）による量的緩和の再開等の金融緩和策等を受けて米・欧の債券利回りは低下（価格は上昇）し、また、欧州圏の景況感の低下や内外金利差が縮小したことなどを背景にして、対米ドル・対ユーロに対して円高が進みました。

### ◆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
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.2%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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	1.8%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	△1.5%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6.2%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	△10.1%

## 投資環境

国内債券市場は上昇（利回りは低下）しました。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、低下幅は縮小しました。

国内株式市場は期初から5月までは、米中貿易摩擦の激化懸念やメキシコへの追加関税による景気後退懸念などを要因として下落しました。6月初旬から7月にかけては、米国の利下げ観測や貿易摩擦問題の落ち着きなどを受けてやや値を戻す展開となりましたが、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再び下落しました。その後、ほぼ横ばいの推移となっておりますが、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。

先進国債券市場では、米国債、欧州債の利回りは、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、米中貿易摩擦の激化やブレグジット（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が追加金融緩和を決定したことなどから、欧州債の利回りは低下しました。

先進国株式市場は上昇しました。米国株式市場は、米国が中国への制裁関税の引き上げを発表し、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が、その後は、パウエルFRB議長が利下げに含みを持たせたことなどから上昇しました。8月以降は、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。欧州株式市場も米中通商協議の影響から、米国株式市場とほぼ同様の動きとなり、欧州各国市場は概ね前期末比で上昇しました。

新興国債券市場の利回りは低下しました。米国長期金利は米中貿易摩擦や世界経済の減速懸念を背景に低下し、対米国債スプレッドは縮小しました。スプレッドは、7月にかけては米中貿易摩擦の動向や先進国の金融政策への思惑などに左右されながら推移しました。8月にはアルゼンチン大統領選挙の予備選で与党が敗北したことを契機にスプレッドは拡大しましたが、その後は米中間の緊張緩和期待が高まったことで縮小に転じました。

新興国株式市場は前期末比で下落しました。トランプ米大統領が新たな対中制裁を発表すると米中貿易摩擦激化に対する懸念を背景に大きく調整し、制裁発動延期の発表や米中通商協議進展への期待が高まると悲観的なポジションが巻き戻されて反発するという展開を繰り返し、方向感の定まらない中期末を迎えました。

為替市場では、主要通貨に対して円高が進みました。世界景気の先行きに対する懸念が強まったことや、米国で利下げ観測が強まったことなどを背景にして為替市場は円高基調で始まりました。その後、米国が2回に渡って利下げを行ったことに加え、ECBが量的緩和を再開したことや、米・欧の長期金利低下による内外金利差の縮小などを背景にして期末まで円高基調で推移しました。

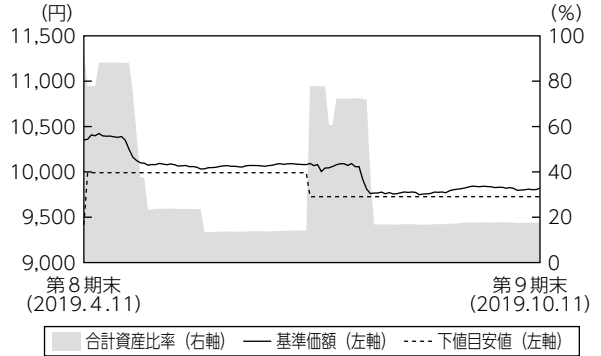
## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

国内外の6つのマザーファンドへの分散投資を行いつつ、基準価額の下落幅を抑制する運用を行いました。6月上旬にかけて基準価額が下落したため、合計資産比率を段階的に14%程度まで引き下げました。下値目安値変更後、合計資産比率を78%程度まで引き上げましたが、8月に基準価額が下落したため、合計資産比率を17%程度まで引き下げ、期末までその比率を維持しました。

※ 合計資産比率は純資産総額に対する各マザーファンド評価額の合計の割合です。

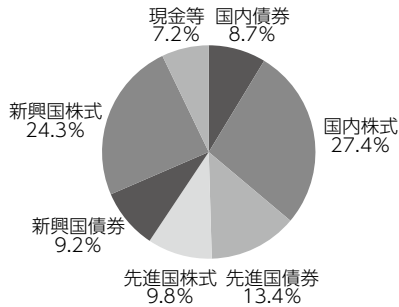
## <基準価額と合計資産比率の推移>



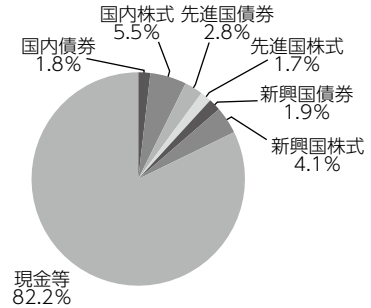
## 【運用状況】

### ○ポートフォリオ構成

#### 期首 (前期末)



#### 期末



※1 組入比率は純資産総額に対する割合です。

※2 現金等とは、短期国債等およびコール・ローンなどの短期金融資産等をあらわします。

※3 国内債券：国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式：国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、先進国債券：外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、先進国株式：外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、新興国債券：エマージング債券パッシブ・マザーファンド、新興国株式：エマージング株式パッシブ・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

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。

### ●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。

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

### ●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

## 分配金

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

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2019年4月12日 ～2019年10月11日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	735円

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

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

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

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

引き続き、国内外の6資産に分散投資を行い、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率を機動的に変更することでファンドのリスクをコントロールし、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざした運用を行います。

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●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。

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

### ●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

## ■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	(2019年4月12日 ～2019年10月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	57円	0.568%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,994円です。
(投信会社)	(27)	(0.270)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(27)	(0.270)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	( 3)	(0.027)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 0)	(0.003)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	1	0.005	(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)	( 1)	(0.005)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.015	(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)	( 1)	(0.007)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	( 0)	(0.002)	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)	( 1)	(0.007)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	59	0.591	

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

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

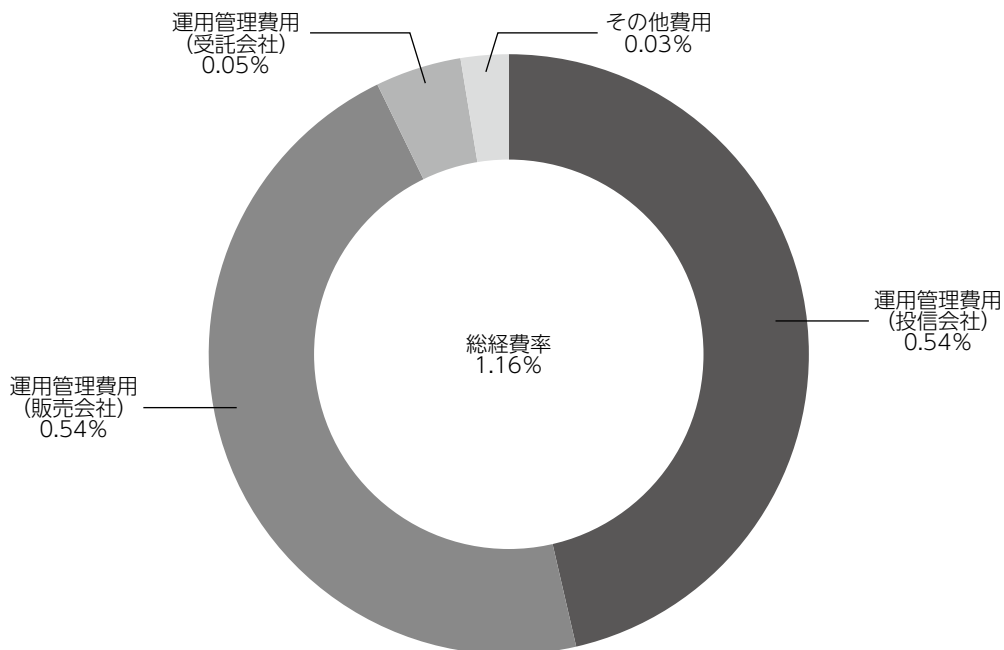
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.16%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2019年4月12日から2019年10月11日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19,263	25,500	35,966	47,500
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	30,846	76,400	58,693	141,600
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,639	38,200	39,045	71,500
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,859	25,300	13,866	49,600
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	12,896	25,200	25,219	48,400
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	55,719	64,300	107,324	120,700

■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		
	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	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	72,197,633千円	59,989,230千円	49,589,765千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	249,105,327千円	331,530,069千円	49,407,903千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.28	0.18	1.00

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年4月12日から2019年10月11日まで）

【D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）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	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	10千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0千円
(B) / (A)	0.0%

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

【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	当 期			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
公 社 債	百万円 61,376	百万円 5,402	% 8.8	百万円 106,939	百万円 12,285	% 11.5

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。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期			期		
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
株 式	百万円 19,083	百万円 24	% 0.1	百万円 53,113	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	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 176	百万円 519	百万円 2,304

(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 0.1

**【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。

**【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。

**【エマーシング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】**

期中の利害関係人との取引等はありません。

**【エマーシング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】**

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

**■組入資産の明細**

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期		末
	□ 数	□ 数	評 価	額
	千□	千□		千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,568	3,866		5,134
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	33,987	6,139		15,479
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	22,578	4,172		7,845
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,330	1,323		4,770
エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	14,906	2,583		5,235
エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	62,211	10,606		11,588

■投資信託財産の構成

2019年10月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,134	1.8
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	15,479	5.5
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,845	2.8
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,770	1.7
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5,235	1.8
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	11,588	4.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	233,373	82.3
投 資 信 託 財 産 総 額	283,428	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10月11日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,554,081千円、98.4％、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは325,232,012千円、99.0％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは112,243,088千円、98.7％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは42,785,457千円、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10月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.13円、1カナダ・ドル=81.33円、1オーストラリア・ドル=73.20円、1香港・ドル=13.79円、1シンガポール・ドル=78.66円、1ニュージーランド・ドル=68.36円、1台湾・ドル=3.51円、1イギリス・ポンド=134.47円、1イスラエル・シケル=30.80円、1スイス・フラン=108.48円、1トルコ・リラ=18.50円、1デンマーク・クローネ=15.94円、1ノルウェー・クローネ=11.86円、1スウェーデン・クローナ=10.99円、1メキシコ・ペソ=5.56円、1フィリピン・ペソ=2.09円、100チリ・ペソ=15.05円、100コロンビア・ペソ=3.12円、1カタール・リアル=29.59円、1サウジアラビア・リアル=28.87円、1インド・ルピー=1.53円、1パキスタン・ルピー=0.70円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.49円、1ブラジル・レアル=26.31円、1チェコ・コルナ=4.61円、100韓国・ウォン=9.10円、1オフショア・人民元=15.23円、1マレーシア・リンギット=25.83円、1南アフリカ・ランド=7.20円、1タイ・バーツ=3.55円、1ポーランド・ズロチ=27.61円、100ハンガリー・フォリント=35.83円、1ユーロ=119.01円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年10月11日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	283,428,324円
コール・ローン等	233,373,987
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	5,134,852
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)	15,479,091
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	7,845,918
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,770,712
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	5,235,135
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	11,588,629
(B) 負 債	1,710,698
未 払 解 約 金	30,205
未 払 信 託 報 酬	1,674,521
そ の 他 未 払 費 用	5,972
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	281,717,626
元 本	286,906,788
次 期 繰 越 損 益 金	△5,189,162
(D) 受 益 権 総 口 数	286,906,788口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	9,819円

(注) 期首における元本額は300,150,602円、当期中における追加設定元本額は6,903,112円、同解約元本額は20,146,926円です。

## ■損益の状況

当期 自2019年4月12日 至2019年10月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△62,396円
受 取 利 息	2,145
支 払 利 息	△64,541
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△13,328,329
売 買 益	863,272
売 買 損	△14,191,601
(C) 信 託 報 酬 等	△1,691,293
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△15,082,018
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	8,057,070
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,835,786
(配 当 等 相 当 額)	(6,251,472)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△4,415,686)
(G) 合 計(D+E+F)	△5,189,162
次 期 繰 越 損 益 金(G)	△5,189,162
追 加 信 託 差 損 益 金	1,835,786
(配 当 等 相 当 額)	(6,252,970)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△4,417,184)
分 配 準 備 積 立 金	14,854,053
繰 越 損 益 金	△21,879,001

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	6,252,970
(d) 分 配 準 備 積 立 金	14,854,053
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	21,107,023
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	735.68
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

# 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ます。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率				
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		債券組入率 比	新株予約債 権付社債 (転換社債) 比	債券先物率 比
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(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	—	—

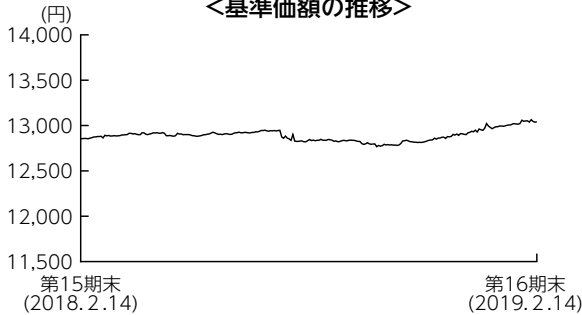
(注1) 騰落率は期首比です。

(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>



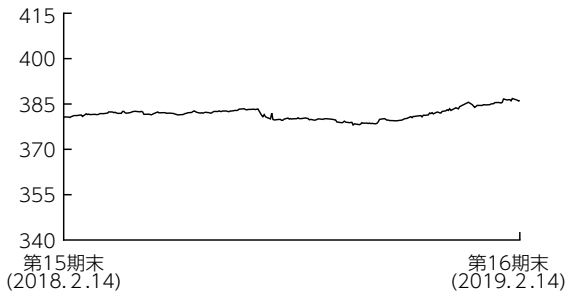
### 基準価額の推移

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。

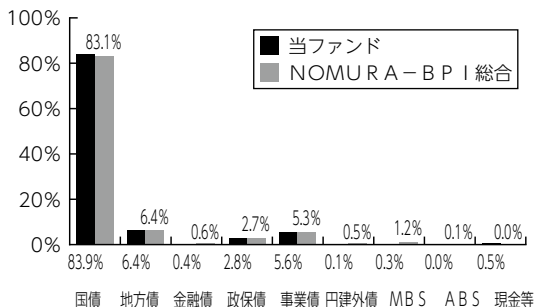
## ポートフォリオについて

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。

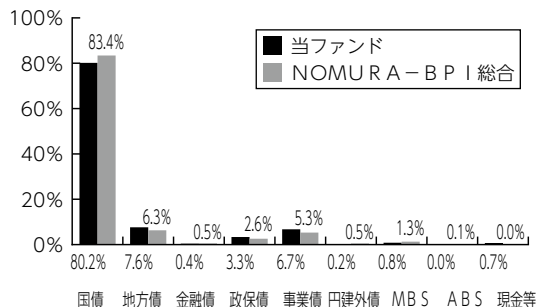
**【運用状況】** (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○**セクター別構成比**

期首 (前期末)

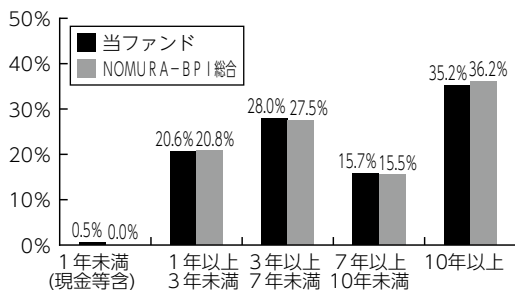


期末

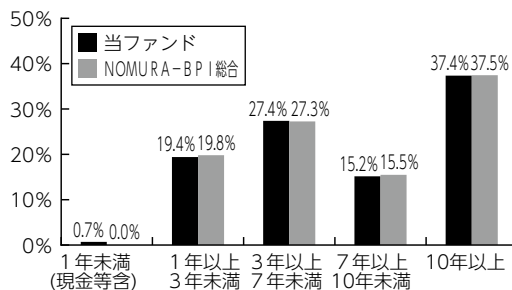


○**残存年限別構成比**

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7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (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
		千円	千円
国 内	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 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	
306回 利付国庫債券(10年)	1.4000	1,500,000	1,525,800	2020/03/20
387回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,000,000	1,003,250	2020/04/15
388回 利付国庫債券(2年)	0.1000	800,000	802,792	2020/05/15
124回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,200,000	2,208,272	2020/06/20
308回 利付国庫債券(10年)	1.3000	800,000	815,872	2020/06/20
309回 利付国庫債券(10年)	1.1000	1,000,000	1,017,150	2020/06/20
46回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	516,040	2020/06/22
390回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,200,000	1,204,620	2020/07/01
392回 利付国庫債券(2年)	0.1000	800,000	803,400	2020/09/01
125回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,000,000	3,013,170	2020/09/20
310回 利付国庫債券(10年)	1.0000	1,500,000	1,528,050	2020/09/20
311回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,020,000	1,035,810	2020/09/20
47回 利付国庫債券(20年)	2.2000	250,000	259,487	2020/09/21
393回 利付国庫債券(2年)	0.1000	1,000,000	1,004,480	2020/10/01
394回 利付国庫債券(2年)	0.1000	700,000	703,234	2020/11/01
126回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,500,000	2,512,700	2020/12/20
312回 利付国庫債券(10年)	1.2000	2,200,000	2,255,726	2020/12/20
48回 利付国庫債券(20年)	2.5000	500,000	524,725	2020/12/21
127回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,220,000	1,226,905	2021/03/20
313回 利付国庫債券(10年)	1.3000	1,790,000	1,845,185	2021/03/20
314回 利付国庫債券(10年)	1.1000	800,000	821,312	2021/03/20
128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	
315回 利付国庫債券(10年)	1.2000	1,500,000	1,548,330	2021/06/20
316回 利付国庫債券(10年)	1.1000	500,000	514,930	2021/06/20
51回 利付国庫債券(20年)	2.0000	600,000	630,654	2021/06/21
129回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,420,000	2,437,012	2021/09/20
317回 利付国庫債券(10年)	1.1000	1,000,000	1,033,090	2021/09/20
318回 利付国庫債券(10年)	1.0000	1,600,000	1,648,784	2021/09/20
52回 利付国庫債券(20年)	2.1000	550,000	582,565	2021/09/21
130回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,100,000	1,108,481	2021/12/20
319回 利付国庫債券(10年)	1.1000	800,000	829,032	2021/12/20
320回 利付国庫債券(10年)	1.0000	1,500,000	1,550,145	2021/12/20
131回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,020,000	2,036,927	2022/03/20
321回 利付国庫債券(10年)	1.0000	1,600,000	1,658,144	2022/03/20
322回 利付国庫債券(10年)	0.9000	1,000,000	1,033,240	2022/03/20
55回 利付国庫債券(20年)	2.0000	410,000	437,662	2022/03/21
132回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,000,000	2,018,140	2022/06/20
323回 利付国庫債券(10年)	0.9000	750,000	776,970	2022/06/20
324回 利付国庫債券(10年)	0.8000	850,000	877,710	2022/06/20
133回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,170,000	1,181,629	2022/09/20
325回 利付国庫債券(10年)	0.8000	1,500,000	1,552,620	2022/09/20
58回 利付国庫債券(20年)	1.9000	600,000	644,916	2022/09/20
134回 利付国庫債券(5年)	0.1000	780,000	788,299	2022/12/20
326回 利付国庫債券(10年)	0.7000	500,000	516,830	2022/12/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(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
(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
(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
(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
<b>(国債証券)</b>	%	千円	千円	
10回 利付国庫債券(40年)	0.9000	1,050,000	1,123,279	2057/03/20
11回 利付国庫債券(40年)	0.8000	480,000	496,252	2058/03/20
小 計	-	212,600,000	234,177,067	-
<b>(地方債証券)</b>	%	千円	千円	
680回 東京都公募公債	1.3900	200,000	202,988	2020/03/19
336回 大阪府公募公債	1.4600	200,000	203,202	2020/03/30
22年度1回 広島県公募公債	1.3700	200,000	203,454	2020/05/27
685回 東京都公募公債	1.1300	500,000	507,445	2020/06/19
2回 川崎市公募公債 15年	1.6300	100,000	102,174	2020/06/22
22年度6回 愛知県公募公債	1.1780	200,000	203,368	2020/07/30
22年度8回 静岡県公募公債	1.0590	200,000	203,170	2020/08/25
688回 東京都公募公債	0.9400	200,000	202,928	2020/09/18
22年度3回 横浜市公募公債	1.1680	200,000	203,654	2020/09/18
22年度5回 横浜市公募公債	1.2650	200,000	204,536	2020/12/11
345回 大阪府公募公債	1.2600	300,000	306,858	2020/12/25
94回 共同発行市場公募地方債	1.2400	100,000	102,372	2021/01/25
22年度12回 北海道公募公債	1.2900	200,000	204,918	2021/01/28
23年度1回 千葉市公募公債	1.3700	200,000	205,886	2021/04/21
23年度2回 埼玉県公募公債	1.1900	200,000	205,320	2021/05/25
697回 東京都公募公債	1.1100	500,000	512,750	2021/06/18
99回 共同発行市場公募地方債	1.1700	700,000	718,991	2021/06/25
701回 東京都公募公債	0.9900	700,000	717,570	2021/09/17
23年度4回 横浜市公募公債	1.0450	450,000	462,640	2021/11/12
23年度9回 静岡県公募公債	1.0450	200,000	205,690	2021/11/25
356回 大阪府公募公債	1.0600	200,000	205,900	2021/12/27
106回 共同発行市場公募地方債	0.9700	300,000	308,406	2022/01/25
23年度20回 愛知県公募公債	1.0820	500,000	516,625	2022/03/29
109回 共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	516,505	2022/04/25
708回 東京都公募公債	0.8900	500,000	514,625	2022/06/20
111回 共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	720,545	2022/06/24
364回 大阪府公募公債	0.7900	300,000	308,292	2022/09/27
194回 神奈川県公募公債	0.7910	300,000	308,949	2022/12/20
24年度7回 千葉県公募公債	0.7400	300,000	308,370	2022/12/22
119回 共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	515,795	2023/02/24
121回 共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	511,625	2023/04/25
25年度4回 愛知県公募公債	0.8560	300,000	310,809	2023/05/30
720回 東京都公募公債	0.8700	300,000	311,136	2023/06/20
25年度4回 札幌市公募公債	0.8000	200,000	206,816	2023/06/20
25年度2回 横浜市公募公債	0.8880	400,000	415,416	2023/07/14
374回 大阪府公募公債	0.9380	300,000	312,198	2023/07/28
25年度5回 千葉県公募公債	0.8400	200,000	207,496	2023/08/25
126回 共同発行市場公募地方債	0.8100	793,900	823,163	2023/09/25
127回 共同発行市場公募地方債	0.6800	500,000	515,710	2023/10/25
128回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	309,306	2023/11/24

銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>(地方債証券)</b>	%	千円	千円	
726回 東京都公募公債	0.7300	400,000	413,948	2023/12/20
25年度11回 福岡県公募公債	0.6940	200,000	206,880	2024/02/26
208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(12年)	1.1000	300,000	317,364	2024/06/26
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	413,108	2024/07/29
137回 共同発行市場公募地方債	0.5660	500,000	515,340	2024/08/23
488回 名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	464,796	2024/09/20
139回 共同発行市場公募地方債	0.5440	500,000	515,190	2024/10/25
26年度11回 京都府公募公債	0.4760	350,000	359,534	2024/12/19
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	509,955	2025/01/24
26年度17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 20年	2.1100	100,000	112,779	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	411,228	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	413,600	2025/05/23
148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 20年	2.1800	100,000	114,298	2025/09/19
9回 東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	235,646	2026/06/19
10回 東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	352,782	2026/09/18
4回 京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	118,960	2026/09/18
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	505,355	2027/01/25
29年度4回 大阪市公募公債	0.1500	200,000	201,538	2027/09/21
30年度1回 神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	303,813	2028/09/20
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	1.6350	300,000	351,966	2032/08/16
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	352,377	2034/05/08
小 計	-	21,443,900	22,249,515	-
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
10回 政保地方公共団体金融機構債券	1.3000	500,000	507,220	2020/03/13
15回 政保地方公共団体金融機構債券	1.0000	200,000	203,126	2020/08/14
20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
24回 地方公共団体金融機構債券	1.2080	300,000	308,169	2021/05/28
18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.2000	300,000	317,124	2021/08/30
149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
36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	309,315	2022/05/20
96回 高速道路機構債	0.7960	700,000	719,138	2022/09/20
180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
44回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	413,924	2023/01/20
55回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	516,280	2023/03/20
189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	512,435	2023/04/28
193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	520,425	2023/06/30
50回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	521,265	2023/07/14
195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	344,196	2023/07/31
116回 高速道路機構債	0.7220	100,000	103,129	2023/09/20
56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
<b>(特殊債券)</b>	%	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種住宅金融公庫債券	1.9600	16,924	17,384	2032/05/10
1 4 回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	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	-
<b>(金融債券)</b>	%	千円	千円	
い第779号 利付商工債	0.2200	200,000	200,430	2020/04/27
い第783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
<b>(金融債券)</b>	%	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	-
<b>(普通社債券)</b>	%	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 ラポバンク・ネダーランド円貨社債	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信託銀行劣後社債	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 BPCE SA円貨社債 (ソーシャルボンド)	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			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
(普通社債券)	%	千円	千円	
11回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	312,486	2022/12/20
18回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	105,410	2022/12/20
518回 中部電力社債	0.1900	200,000	200,078	2023/01/25
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	207,076	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	102,836	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	205,664	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	103,984	2023/03/24
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	312,129	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	103,527	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	207,264	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	104,316	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	416,868	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	327,003	2023/09/20
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	103,512	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	103,114	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	209,670	2023/11/24
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	218,732	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	310,788	2023/12/20

銘柄	当期			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
(普通社債券)	%	千円	千円	
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	418,232	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	416,568	2024/02/23
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	205,518	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	110,801	2024/03/19
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	111,836	2024/09/20
10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
321回 北海道電力社債	0.8860	161,000	166,007	2024/12/25
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	337,086	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	221,980	2025/06/20
42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
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	105,548	2026/06/25
34回 政保西日本高速道路債券	0.3350	200,000	203,580	2027/02/16
340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		比率
	評価額		
公社債		千円	%
コール・ローン等、その他	290,077,840		92.9
投資信託財産総額	22,099,018		7.1
	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 ・ 公 司 未 前 未 払 純 資 産	21,292,428,667 290,077,840,370 770,374,276 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 期 繰 越 損 益 本 金 数	223,973,156,427 68,139,769,721
(D) 受 益 権 総 口 数	223,973,156,427円
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	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	518,138,794円
追加設定元本額	113,380,695,236円	ダイナミック・ナビゲーション	1,967,915円
一部解約元本額	166,040,572,695円	リスク抑制世界8資産バランスファンド	8,646,074,074円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	1,457,077円
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	18,190,812,393円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2015)	1,137,081円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	96,924,740円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	3,528,101円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	78,480,076円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	2,289,786円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	24,093,695円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	74,378,770円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	812,042,492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
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	224,528,250円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	290,676円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	30,531,946円	D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
たわらノーロード 国内債券	5,608,098,569円	D I A M国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	7,747,418,144円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	204,097,771円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	427,767,841円
たわらノーロード バランス (堅実型)	49,073,204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
たわらノーロード バランス (標準型)	91,339,770円	D I A Mグローバル・バランスファンド25VA	260,471,994円
たわらノーロード バランス (積極型)	14,731,205円	D I A Mグローバル・バランスファンド50VA	208,048,280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	D I A M国際分散バランスファンド30VA	65,779,975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	D I A M国際分散バランスファンド50VA	178,262,613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	D I A M国内重視バランスファンド30VA	78,434,274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	D I A M国内重視バランスファンド50VA	34,112,030円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	12,398,109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)	74,517,588円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,927,516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)	153,733,627円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,439,484円	D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	5,107,603,663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	D I A Mバランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	2,727,549,689円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	652,905円	D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,036,022,852円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	17,517円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA	549,567,315円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,094,592,898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)	244,393,101円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	5,970,708,997円	D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA	3,133,418,256円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	8,327,473,971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)	651,756,777円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,375,978,536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)	188,050,355円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	1,787,117,039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)	43,906,910円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	1,979,799,847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)	75,249,648円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	311,374,467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)	44,304,010,853円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	87,494,470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)	300,469,968円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,329,877,194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)	6,766,577,431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 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)	25,810,172,316円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	3,138,341,596円	D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	73,681,229円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	760,934,771円	D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)	1,372,928円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	161,069,244円	D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)	6,828,815円
投資のソムリエ	4,442,528,933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)	28,718,365,712円
クルーズコントロール	2,280,157,246円	D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	406,399,314円
投資のソムリエ<DC年金>	414,716,710円	D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	124,390,494円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	2,350,099,207円	D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	499,470,914円
D I A M DC バランス・F (成長型)	282,293,752円	D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	697,893円
クルーズコントロール<DC年金>	1,617,997円	D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)	371,935円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	7,792,604円	期末元本合計	223,973,156,427円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	20,568,924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)

# 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	期中 落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 落率			
13期 (2015年2月9日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期 (2016年2月8日)	20,237	22.2	1,949.47	22.3	99.0	0.9	324,677
15期 (2017年2月7日)	19,981	△1.3	1,925.17	△1.2	98.2	1.7	286,897
16期 (2018年2月7日)	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
17期 (2019年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
	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）。

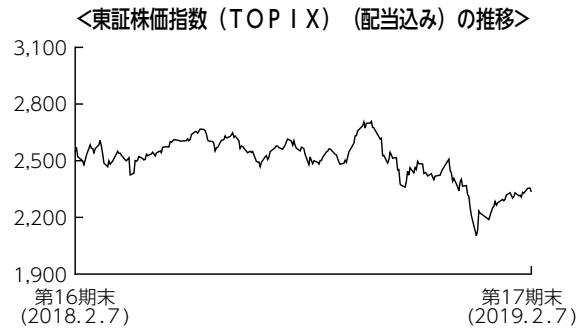
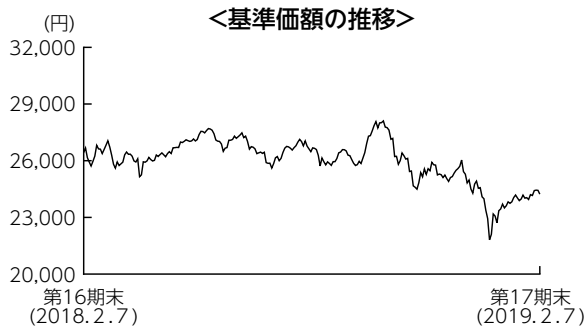
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	円	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク) ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2018年 2 月 7 日	26,432	% -	2,547.46	% -	98.1	0.8
2 月 末	26,718	1.1	2,574.87	1.1	97.9	2.7
3 月 末	26,174	△1.0	2,522.26	△1.0	95.2	4.6
4 月 末	27,108	2.6	2,611.85	2.5	98.4	1.5
5 月 末	26,665	0.9	2,568.21	0.8	97.4	2.2
6 月 末	26,446	0.1	2,548.78	0.1	96.3	3.7
7 月 末	26,787	1.3	2,581.96	1.4	96.4	3.6
8 月 末	26,523	0.3	2,556.25	0.3	95.9	4.0
9 月 末	28,001	5.9	2,698.09	5.9	97.4	2.5
10 月 末	25,366	△4.0	2,444.11	△4.1	96.4	3.7
11 月 末	25,703	△2.8	2,475.92	△2.8	97.2	2.7
12 月 末	23,069	△12.7	2,223.11	△12.7	95.9	4.5
2019年 1 月 末	24,204	△8.4	2,332.52	△8.4	98.5	1.5
(期 末) 2019年 2 月 7 日	24,228	△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 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (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7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (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
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		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

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

























## (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
株 式	4,125,464,360
未 収 入 金	275,040,369,410
未 収 入 委 託 証 書	89,044,788
未 収 入 委 託 証 書	424,228,839
(B) 負 債	1,984,233,000
未 収 入 委 託 証 書	1,489,440,000
未 収 入 委 託 証 書	376,733,000
(C) 純 資 産	279,184,314,397
元 本	115,232,523,115
次 期 繰 越 損 益	163,951,791,282
(D) 受 取 金 額	115,232,523,115円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	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国内株式バシッパ・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 TOP 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<DC年金>	38,649,342,706円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	937,399,472円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	3,139,647,393円
D I A Mバランス・ファンド<DC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 エゴリユーション	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
グルーズコントロール	1,257,278,344円
投資のソムリエ<DC年金>	401,357,411円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	222,726,425円
D I A M D C バランス・F (成長型)	277,618,478円
グルーズコントロール<DC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<DC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<DC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<DC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
日米資産分散戦略ファンド (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	金 配 当 益	6,275,204,545円
受 取	金	6,228,808,737
そ の 他 収 益	金	52,719,900
支 払 利 息	息	△6,324,092
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	損 益	△27,670,046,291
売 買	益	11,457,593,174
売 買	損	△39,127,639,465
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	損 益	△882,002,368
取 引	益	1,171,869,352
取 引	損	△2,053,871,720
(D) そ の 他 費 用	用	△6,516
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)		△22,276,850,630
(F) 前 期 繰 越 損 益 金		179,810,421,658
(G) 解 約 差 損 益 金		△53,943,765,219
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金		60,361,985,473
(I) 合 計(E + F + G + H)		163,951,791,282
次 期 繰 越 損 益 金(I)		163,951,791,282

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
12期（2015年2月23日）	18,820	14.8	ポイント 117,697.87	% 14.9	% 97.5	% -	百万円 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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。



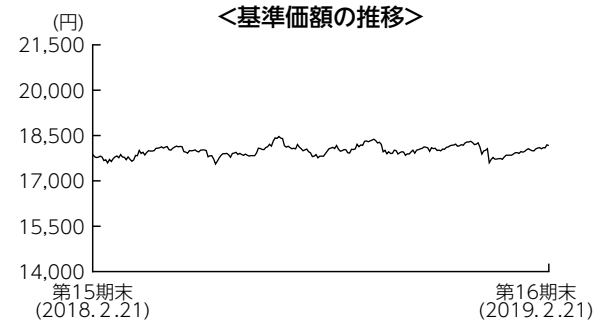
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率		騰 落 率			
(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

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。

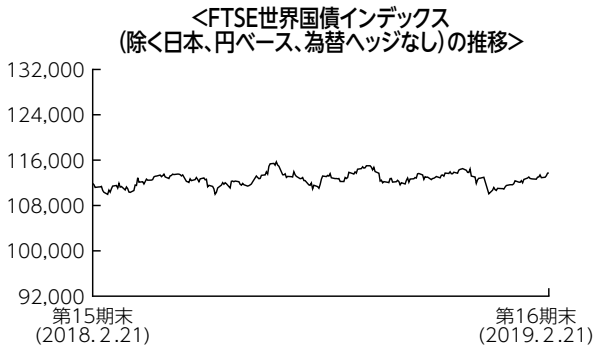
### 基準価額の主な変動要因

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



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

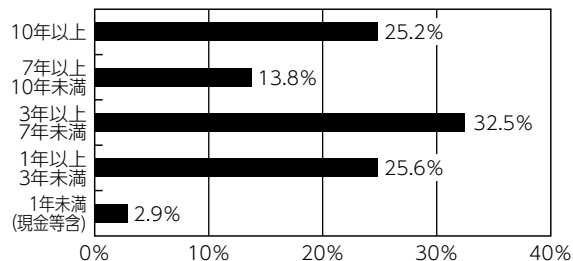
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

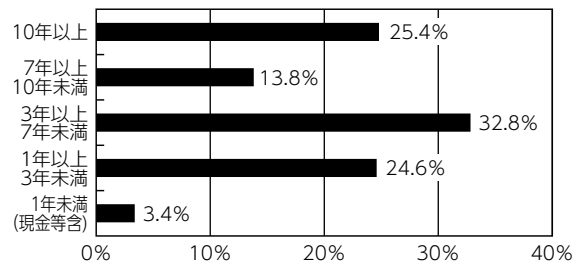
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○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	41.9%	△0.6%	
	カナダ	2.1%	△0.1%	
	計	43.4%	△0.7%	
中南米	メキシコ	0.8%	△0.0%	
	計	0.8%	△0.0%	
欧州	オーストリア	1.6%	△0.1%	
	ベルギー	2.5%	△0.1%	
	フィンランド	0.6%	△0.0%	
	フランス	10.3%	△0.2%	
	ドイツ	7.1%	△0.1%	
	アイルランド	0.8%	△0.1%	
	イタリア	10.0%	△0.2%	
	オランダ	2.1%	△0.1%	
	スペイン	5.9%	△0.1%	
	ユーロ計	40.9%	41.9%	△1.0%
	デンマーク	0.6%	△0.0%	
	スウェーデン	0.5%	△0.0%	
	スイス	0.0%	△0.2%	
英国	7.0%	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7ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（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	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BB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 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・リングギット 29,750	千マレーシア・リングギット 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	当 種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		末 償還年月日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・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	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 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	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.25 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	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(アメリカ)</b>		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.875 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	—	
<b>(カナダ)</b>		%	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	—	
<b>(オーストラリア)</b>		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	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		
<b>(オーストラリア)</b>		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 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	2030/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	900	1,005	80,113	2039/06/21	
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	—	
<b>(シンガポール)</b>		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	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	—	
<b>(イギリス)</b>		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	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	
<b>(イギリス)</b>		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 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	—
<b>(デンマーク)</b>		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	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	—
<b>(ノルウェー)</b>		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	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	—
<b>(スウェーデン)</b>		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	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	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(メキシコ)</b>		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 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	-
<b>(マレーシア)</b>		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	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	-
<b>(南アフリカ)</b>		%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	国債証券	8.0000	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	-
<b>(ポーランド)</b>		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	1,350	1,380	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	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ポーランド)</b>		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	1,900	1,910	55,393	2028/04/25
POLAND 2.00 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	-
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>		%	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	-
<b>(ユーロ…オランダ)</b>		%	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	
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>		%	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	—
<b>(ユーロ…フランス)</b>		%	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	
<b>(ユーロ…フランス)</b>			%	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	-	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	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	
BUNDESUBL 04/17/20	国債証券	-	1,130	1,137	142,758	2020/04/17	
BUNDESUBL 04/09/21	国債証券	-	2,200	2,226	279,459	2021/04/09	
BUNDESUBL 04/08/22	国債証券	-	2,010	2,043	256,409	2022/04/08	
BUNDESUBL 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
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 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	—
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	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	当	期				末						
		種	利	率	額		価		額	償還年月日		
							外	建			金	額
<b>(ユーロ…スペイン)</b>			%	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				-
<b>(ユーロ…イタリア)</b>			%	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
<b>(ユーロ…イタリア)</b>			%	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	-		
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	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	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…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
公 社 債	千円 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・リングギット=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 ・ ク 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	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	クルーズコントロール<DC年金>	2,093,489円
追加設定元本額	28,217,327,604円	D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	8,556,081円
一部解約元本額	41,303,335,221円	D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	22,578,913円
(注2) 期末における元本の内訳		ダイナミック・ナビゲーション	1,609,469円
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	8,079,391,033円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	15,793,100円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	9,105,775円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	11,075円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	25,280,519円	D I AMパッシブ資産分散ファンド	1,310,116,672円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	30,864,769円	D I AM海替フルハッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	7,061,418,108円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	76,286,272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
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	72,349,714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
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	38,058,966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
たわらノーロード 先進国債券	3,275,191,858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
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412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
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	159,226,230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
たわらノーロード バランス (堅実型)	3,033,012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
たわらノーロード バランス (標準型)	16,033,815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
たわらノーロード バランス (積極型)	4,324,944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
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	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
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	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
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	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
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	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
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	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
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	404,775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
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	1,631,952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
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	562,231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
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バランス・ファンド<DC年金> >1安定型	533,531,954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バランス・ファンド<DC年金> >3成長型	1,750,349,034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 DCバランス30インデックスファンド	372,685,112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 DCバランス50インデックスファンド	812,192,171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 DCバランス70インデックスファンド	621,735,533円	D I AMバランス30VA (適格機関投資家限定)	20,111,944円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	22,571,041円	D I AMバランス50VA (適格機関投資家限定)	999,297円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	600,919,427円	D I AMバランス70VA (適格機関投資家限定)	4,973,567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 DC 8資産バランスファンド (新興国10)	119,017,497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 DC 8資産バランスファンド (新興国20)	71,193,232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 DC 8資産バランスファンド (新興国30)	115,407,689円	D I AMバランス40VA (適格機関投資家限定)	362,862円
クルーズコントロール	2,914,474,463円	D I AMバランス60VA (適格機関投資家限定)	162,392円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	87,907,821円	期末元本合計	108,789,722,301円
D I AM DC バランス・F (成長型)	149,376,214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)

# 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		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	円	%	（円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	ポイント			
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

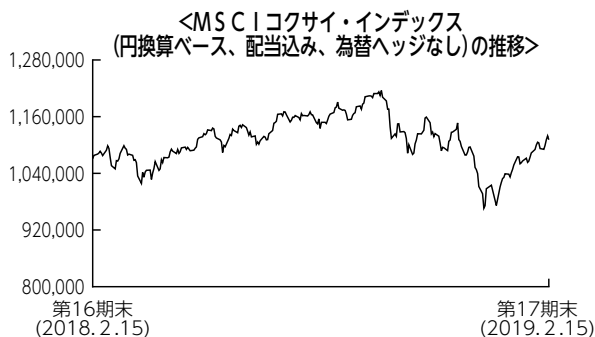
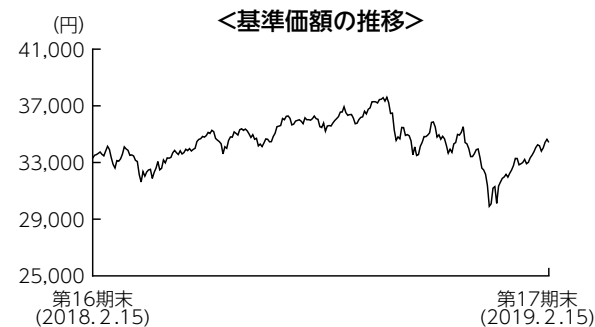
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2018年 2月 15日	33,302	% -	1,070,930.74	% -	% 95.7	% 2.2
2 月 末	33,921	1.9	1,092,375.78	2.0	97.4	3.1
3 月 末	32,479	△2.5	1,046,334.72	△2.3	93.9	1.1
4 月 末	33,937	1.9	1,093,785.41	2.1	95.2	2.5
5 月 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っ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7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2018年2月16日から2019年2月15日まで)

(1) 株 式

		買		付		売		付				
		株	数	金	額	株	数	金	額			
外	ア	メ	リ	カ	百株 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・シケル 2,148 (△672)	百株 6.47	千イスラエル・シケル 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	エ	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	エ	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	イ	ギ	リ	ス	百株 -	千ユーロ -	百株 708.26	千ユーロ 1,281			
						(708.26)	(-)					
						百株 799.56 (213.35)	千ユーロ 1,860 (-)	百株 213.35	千ユーロ 2,894			
						(213.35)	(-)					
						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			
						(△731.75)	(△164)					
						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									
(2.25)	(△92)											
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									
(481.28)	(△370)											

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユ ー ロ ョ ム	ポ ル ト ガ ル	1,040.31 百株 (-)	千ユーロ 480 (-)	百株 -	千ユーロ -
		ス ペ イ ン	10,840.28 百株 (24,625.24)	千ユーロ 7,240 (-)	25,985.66 百株	千ユーロ 1,833
		イ タ リ ア	13,019.42 百株 (169.72)	千ユーロ 5,212 (-)	3,232.23 百株	千ユーロ 1,512
		フ ィ ン ラ ン ド	1,301.96 百株 (232.9)	千ユーロ 2,216 (-)	87.29 百株	千ユーロ 375
		オ ー ス ト リ ア	141.92 百株 (-)	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
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
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
	(—)	(—)	(—)	(—)
<b>カナダ</b>	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)	(—)	(—)
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
LENDLEASE 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
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
SCENTRE GROUP	93.268 (-)	360 (-)	(-)	(-)
<b>香港</b>	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	22 (-)	1,735 (-)	(-)	(-)
<b>シンガポール</b>	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
ASCENDAS REAL ESTATE INV T	(-)	(△2)	(-)	(-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	384.8 (-)	673 (-)	178.5 (-)	305 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	(-)	(△2)	(-)	(-)
<b>イギリス</b>	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
LAND SECURITIES GROUP PLC	33.384 (-)	311 (-)	12.296 (-)	114 (-)
SEGRO PLC	42.887 (-)	247 (-)	21.086 (-)	138 (-)
<b>ユーロ (オランダ)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	3.332 (10.338)	493 (-)	1.609 (-)	244 (-)
<b>ユーロ (フランス)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
COVIVIO	2.332 (-)	196 (-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO SE	3.117 (△10.338)	602 (-)	(-)	(-)

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



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	
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 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		
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	コンプロマリット	
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	期首(前期末)		当期				業種等
	株数	株数	評価額		千円		
			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			
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		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	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	
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	コンプロマリット
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		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
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	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		
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		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	18.26	—	—	—	—	家庭用品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,339.61	1,769.14	3,340	368,884	368,884	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	128.73	151.11	1,095	120,958	120,958	機械
ALKERMES PLC	120.53	120.53	391	43,261	43,261	バイオテクノロジー
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	230.62	289.87	2,502	276,338	276,338	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.79	34.79	746	82,407	82,407	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	106.74	122.4	1,646	181,855	181,855	ソフトウェア
HCA HEALTHCARE INC	201.73	241.78	3,438	379,758	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	183,338	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	39.87	54.74	686	75,762	75,762	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	65.44	74.43	1,641	181,252	181,252	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	106.68	136.76	1,361	150,342	150,342	銀行
CIT GROUP INC	92.87	92.87	465	51,395	51,395	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	226.52	306	2,807	310,065	310,065	半導体・半導体製造装置
TARGA RESOURCES CORP	164.45	178.11	803	88,713	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	106,076	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	70.4	100.84	934	103,171	103,171	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	106.33	170	957	105,777	105,777	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	193.55	222.91	2,641	291,774	291,774	複合小売り
FORTINET INC	113.99	113.99	948	104,728	104,728	ソフトウェア
AON PLC	184.87	209.42	3,552	392,302	392,302	保険
TESLA INC	93.57	109.91	3,338	368,730	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	472,666	自動車
WORLDPAY INC	104.48	265.92	2,319	256,120	256,120	情報技術サービス
XPO LOGISTICS INC	—	128.25	763	84,346	84,346	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC	92.63	92.63	535	59,088	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	116,932	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD	99.58	121.38	544	60,175	60,175	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC	135.25	135.25	656	72,549	72,549	各種金融サービス
APTIV PLC	190.69	225.71	1,797	198,546	198,546	自動車部品
PHILLIPS 66	309.76	381.15	3,645	402,631	402,631	石油・ガス・消耗燃料
FACEBOOK INC	1,675.84	2,102.8	34,475	3,807,463	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	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	150,320	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	122.06	150.71	3,527	389,529	389,529	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	62.15	79.35	1,786	197,317	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	257,697	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,122.99	1,319.76	10,626	1,173,613	1,173,613	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	344.25	422.09	3,936	434,737	434,737	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	122.24	198.21	1,034	114,245	114,245	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	314.4	385.41	427	47,161	47,161	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	302.63	378	41,778	41,778	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC	128.91	128.91	560	61,887	61,887	商社・流通業
CDW CORP	108.24	130.4	1,223	135,156	135,156	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	638.82	638.82	394	43,600	43,600	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	101.99	101.99	368	40,673	40,673	旅客航空輸送業
ARCONIC INC	275.13	367.61	642	71,007	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	61,335	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	50.06	50.06	201	22,308	22,308	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	133.68	179.31	723	79,924	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	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	
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
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		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	
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・金額 銘柄数<比率>	219,768.86 602銘柄	263,700.87 593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	評価額	金額	
	株数	株数	外貨建金額	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	株数	金額	金額	
	53,166.94	65,230.79	105,393	8,257,557	
	銘柄数<比率>	銘柄数	-	<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		業種等
	株数	株数	評価額	金額	
			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	コングロマリット
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
WHELOCK & 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	コングロマリット
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	株数	金額	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	コングロマリット
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	コングロマリット
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	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額	未	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(シンガポール)</b>	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
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>	株数・金額 銘柄数<比率>	19,448	1,581,975	
	34,583.74 20銘柄	38,913.74 21銘柄	—	<0.5%>	
<b>(ニュージーランド)</b>	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	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>	株数・金額 銘柄数<比率>	3,827	288,149	
	3,701.45 4銘柄	5,561.13 7銘柄	—	<0.1%>	
<b>(イギリス)</b>	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	コンプロマリット
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		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		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
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 銘柄数<比率>	214,633.55 99銘柄	260,125.86 92銘柄	152,648 —	21,569,175 <6.2%>
<b>(イスラエル)</b>	百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	784.28	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 銘柄数<比率>	4,379.69 8銘柄	4,668.15 8銘柄	11,554 —	350,808 <0.1%>
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	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 FINANCIER 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		業種等	
	株数	株数	評価額	期末		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
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	14,896.88	101,038	11,094,022	
		36銘柄	38銘柄	-	<3.2%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	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	3,721.03	135,297	2,260,823	
		18銘柄	17銘柄	-	<0.6%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	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	
TELENOR 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	5,439.35	71,542	912,880	
		8銘柄	10銘柄	-	<0.3%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円		
ATLAS COPCO AB-A SHS	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	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額	期末	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(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
LLUNDIRIN 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・銘柄数<比率>	株数・銘柄数<比率>	金額	金額	
	16,627.09	21,528.76	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・銘柄数<比率>	株数・銘柄数<比率>	金額	金額	
	2,023.87	2,823.43	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・銘柄数<比率>	株数・銘柄数<比率>	金額	金額	
	14,597.77	16,459.79	43,155	5,380,611	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…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・金額 銘柄数<比率>	1,371.97	1,730.65	10,067	1,255,167	-
(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・金額 銘柄数<比率>	1,064.42	2,054.39	3,157	393,682	-
(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)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
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 銘柄数<比率>	株数	101,144	12,610,645	
	68銘柄	69銘柄	-	<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	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
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
BRENNTAG 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>	2,098.12 3銘柄	3,138.43 —	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	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…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	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額	期末	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…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>	株数・金額 銘柄数<比率>	11,003	1,371,872	
(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>	株数・金額 銘柄数<比率>	2,368	295,355	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	-	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中値により邦貨換算したものです。

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

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

## (2) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		
	□	数	□	数	外貨建金額	邦貨換算金額	
					千アメリカ・ドル	千円	
						比率	
不動産ファンド (アメリカ)		千□		千□		％	
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 INVST 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			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
<b>(アメリカ)</b>	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	910.976	1,082.101	65,889	7,276,820		-
	40銘柄<1.7%>	39銘柄<2.1%>	-	-		2.1
<b>(カナダ)</b>	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	23.005	29.711	805	66,824		-
	3銘柄<0.0%>	3銘柄<0.0%>	-	-		0.0
<b>(オーストラリア)</b>	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	1,584.164	1,671.194	8,525	667,952		-
	9銘柄<0.2%>	8銘柄<0.2%>	-	-		0.2
<b>(香港)</b>	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	163.5	185.5	16,073	226,155		-
	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	-	-		0.1
<b>(シンガポール)</b>	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	591.906	798.206	1,768	143,872		-
	3銘柄<0.0%>	4銘柄<0.0%>	-	-		0.0
<b>(イギリス)</b>	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	229.574	272.463	1,702	240,587		-
	4銘柄<0.1%>	4銘柄<0.1%>	-	-		0.1
<b>(オランダ)</b>	千口	千口	千ユーロ	千円		%
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	-	12.061	1,729	215,670		0.1
小計	-	12.061	1,729	215,670		-
	1銘柄<-%>	1銘柄<0.1%>	-	-		0.1
<b>(フランス)</b>	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			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	32.51 5銘柄<0.1%>	27.621 4銘柄<0.1%>	1,541	192,214			0.1
合計	3,535.635 65銘柄<2.2%>	4,078.857 64銘柄<2.6%>	-	9,030,097			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	柄別	当期		期末
		買建額	売建額	額
外国	S & P 500 EMINI FUT	4,908		百万円 -
	S & P / TSE 60 IX FUT	263		百万円 -
	SPI 200 FUTURES	188		百万円 -
	FTSE 100 INDEX FUTURE	445		百万円 -
	DJ EURO STOXX 50	1,174		百万円 -

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

## ■投資信託財産の構成

2019年2月15日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	率
株式	333,346,813		千円 %
投資信託受益証券、投資証券	9,030,097		94.0
コール・ローン等、その他	12,119,648		2.5
投資信託財産総額	354,496,559		3.4
			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 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	811,825,352
未 収 入 当 金	8,218,272,061
未 収 入 委 託 証 拠	581,033,916
未 収 入 委 託 証 拠	498,296,652
(B) 負 債	2,340,131,966
未 払 金	4,951,972,087
未 払 金	4,817,636,087
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	349,689,821,224
元 本	101,602,311,525
次 期 繰 越 損 益	248,087,509,699
(D) 受 取 権 益 総 額 (C / D)	101,602,311,525円
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	34,418円

(注1) 期首元本額	85,414,197,806円	DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	8,330,426円
追加設定元本額	42,163,749,070円	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	40,452,146円
一部解約元本額	25,975,635,351円	ダイナミック・ナビゲーション	388,924円
(注2) 期末における元本の内訳		リスク抑制世界8資産バランスファンド	677,295,161円
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	2,617,753,619円	ワールドアセットバランス (基本コース)	610,427,443円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,665,744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
MITO ラップ型ファンド (中立型)	8,231,580円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	724,126円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	16,074,086円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	562,792円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	22,332,727円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	267,666円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	23,592,520円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	436,307円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	19,511,274円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,484,883円
たわらノーロード 先進国株式	8,653,055,227円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	97,310,489円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	423,862円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	13,989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	DIAM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
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	81,659,165円	DIAM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
たわらノーロード バランス (堅実型)	6,355,387円	DIAM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
たわらノーロード バランス (標準型)	57,012,813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
たわらノーロード バランス (積極型)	90,265,532円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	21,819,707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	DIAM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
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	DIAM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
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	DIAM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
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	DIAM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
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	DIAM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
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	26,534円	DIAM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
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	143,098円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	19,449,829円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	869,061円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	60,207,131円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	667,205円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	499,415,290円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,472,482円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	622,804,311円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	40,530,877,161円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,971,721,205円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	177,133,387円	DIAM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
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	908,186,447円	DIAM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
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,088,583,348円	DIAM アサチ 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
DIAM DC バランス30インデックスファンド	128,572,029円	DIAM世界アセットバランスファンド (適格機関投資家向け)	85,003,032円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	360,021,829円	DIAMグローバル私募ファンド (適格機関投資家向け)	2,754,975円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	323,498,598円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	25,760,341円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	30,117,672円	DIAM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	14,513,929円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	800,847,222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)	4,330,444,265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	DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	117,506,788円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	215,665,489円	DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,323,905,558円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	144,342,457円	DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	5,050,880,568円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	249,688,816円	DIAMバランス30VA (適格機関投資家限定)	17,998,120円
投資のソムリエ	1,214,413,350円	DIAMバランス50VA (適格機関投資家限定)	860,549円
クルーズコントロール	462,306,913円	DIAMバランス70VA (適格機関投資家限定)	9,815,345円
投資のソムリエ<DC年金>	113,522,125円	DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	6,744,194,888円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	164,698,295円	DIAMバランス20VA (適格機関投資家限定)	58,588,772円
DIAM DC バランス・F (成長型)	95,711,034円	DIAMバランス40VA (適格機関投資家限定)	234,611円
クルーズコントロール<DC年金>	328,099円	DIAMバランス60VA (適格機関投資家限定)	262,654円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,148,634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	6,947,143,194円	
	受取	6,908,295,630	
	受取	10,909,289	
	の取	28,530,787	
	の他	△592,512	
	の払		
(B)	有価証券	5,056,491,180	
	買戻	32,377,087,657	
	損益	△27,320,596,477	
(C)	先物取引	217,753,623	
	取引	1,940,038,819	
	取引	△1,722,285,196	
(D)	その他	△54,363,769	
	費用		
(E)	当期損益	12,167,024,228	
	金(A+B+C+D)		
(F)	前期繰越	199,033,935,190	
	損益		
(G)	解約差	△63,448,458,649	
	損益		
(H)	追加信託	100,335,008,930	
	差損益		
(I)	合計(E+F+G+H)	248,087,509,699	
	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)

# エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 運用報告書

第11期 (決算日 2019年4月18日)

(計算期間 2018年4月19日～2019年4月18日)

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入率	債券先物率	純資産総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
7期 (2015年4月20日)	18,383	26.0	84,996.05	21.0	96.5	—	51,976
8期 (2016年4月18日)	17,120	△6.9	81,716.02	△3.9	96.5	—	51,487
9期 (2017年4月18日)	17,917	4.7	88,609.40	8.4	96.8	—	80,269
10期 (2018年4月18日)	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4	—	111,615
11期 (2019年4月18日)	19,206	7.8	93,647.60	6.8	97.5	—	108,066

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

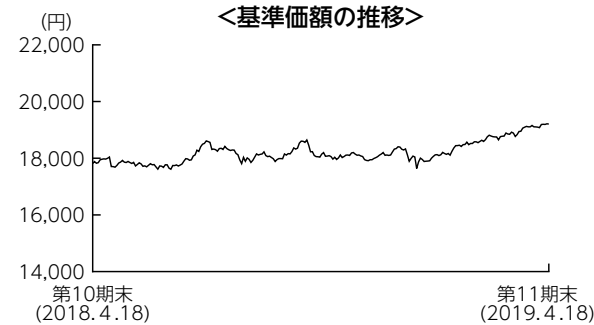
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		J Pモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2018 年 4 月 18 日	円 17,815	% -	ポイント 87,698.99	% -	% 96.4	% -
4 月 末	17,968	0.9	88,312.05	0.7	96.7	-
5 月 末	17,729	△0.5	86,655.48	△1.2	96.7	-
6 月 末	17,896	0.5	86,804.46	△1.0	96.0	-
7 月 末	18,309	2.8	88,872.32	1.3	96.6	-
8 月 末	18,092	1.6	86,318.34	△1.6	96.3	-
9 月 末	18,532	4.0	90,536.26	3.2	95.8	-
10 月 末	18,112	1.7	88,388.61	0.8	96.4	-
11 月 末	18,107	1.6	88,280.96	0.7	96.4	-
12 月 末	18,043	1.3	87,735.63	0.0	91.5	-
2019 年 1 月 末	18,109	1.7	89,669.33	2.2	97.8	-
2 月 末	18,656	4.7	92,243.65	5.2	95.8	-
3 月 末	19,062	7.0	93,010.99	6.1	96.6	-
(期 末) 2019 年 4 月 18 日	19,206	7.8	93,647.60	6.8	97.5	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年4月19日から2019年4月18日まで）

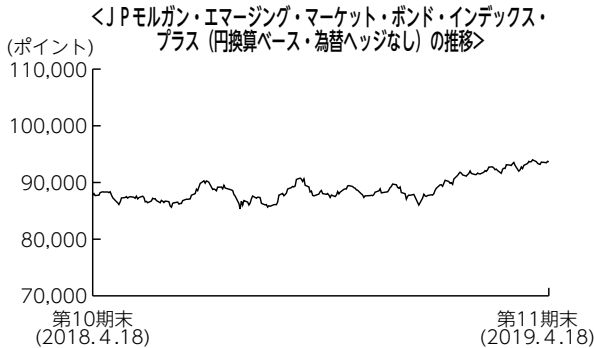


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は19,206円となり、前期末比で7.8%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

当期の新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）したものの、債券の利息収入や、為替市場で円安米ドル高が進行したことなどを主な要因として、基準価額は上昇しました。



### 投資環境

当期の新興国債券の利回りは上昇しました。

ベースとなる米国の長期金利は、良好な米雇用統計等を背景に上昇する局面もありましたが、その後FOMC（米連邦公開市場委員会）において2019年内の利上げを見送る姿勢が示されたことなどを背景にやや低下（価格は上昇）して期末を迎えました。

新興国債券の対米国債スプレッド（利回り格差）は、貿易摩擦への懸念などから拡大しつつ推移しましたが、期末にかけて原油価格の反発などからやや縮小し、通期で見るとやや拡大となりました。

為替市場では、期初から2018年12月にかけては、良好な米経済指標や米国の長期金利がやや上昇基調で推移したことなどを背景に、円安ドル高が進みました。12月後半からは、米国の長期金利の低下により日米金利差が縮まったことや、世界的な景気減速懸念を背景としたリスク回避的な動きなどを要因として、円買いが進みました。その後、米中貿易協議の進展への期待感などを背景に円安方向へ推移し、通期でみると円安ドル高が進みました。

## ポートフォリオについて

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

### 【運用状況】

#### ○国別構成比 期首（前期末）

国	ファンド	ベンチマーク	差	
中南米	アルゼンチン	0.0%	11.5%	△11.5%
	ブラジル	9.8%	8.0%	1.8%
	メキシコ	12.8%	11.0%	1.9%
	パナマ	4.8%	3.1%	1.8%
	ペルー	4.2%	2.5%	1.8%
	ベネズエラ	0.0%	2.7%	△2.7%
	コロンビア	8.7%	6.8%	1.8%
計	40.4%	45.5%	△5.1%	
欧州	ハンガリー	4.6%	4.0%	0.6%
	ロシア	10.9%	9.1%	1.8%
	トルコ	13.9%	12.2%	1.7%
	ウクライナ	0.0%	4.5%	△4.5%
	クロアチア	3.0%	2.5%	0.5%
	ルーマニア	2.0%	1.9%	0.1%
計	34.5%	34.2%	0.3%	
アジア・オセアニア	インドネシア	10.1%	9.4%	0.7%
	フィリピン	7.1%	6.9%	0.3%
計	17.2%	16.2%	1.0%	
アフリカ	南アフリカ	4.3%	4.0%	0.3%
	計	4.3%	4.0%	0.3%
現金など	3.6%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

#### 期末

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



(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

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

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で6.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを1.0%上回りました。これは、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（18,213円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況（2018年4月19日から2019年4月18日まで）

### 公社債

			買 付 額	売 付 額
外国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
			1,062,466	1,100,312 (2,459)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等（2018年4月19日から2019年4月18日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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



## ■組入資産の明細

### 公社債

#### (A) 債券種類別開示

##### 外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちＢＢ格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年末満
	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	876,100	940,532	105,377,278	97.5	11.0	68.9	21.6	6.9
合 計	—	—	105,377,278	97.5	11.0	68.9	21.6	6.9

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

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

#### (B) 個別銘柄開示

##### 外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末							
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	6.0500	11,900	13,506	1,513,281	2040/01/11		
BRAZIL 5.625 01/07/41	国債証券	5.6250	9,100	9,031	1,011,917	2041/01/07		
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国債証券	4.6000	10,000	9,530	1,067,741	2046/01/23		
BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	4.2500	13,100	13,214	1,480,566	2025/01/07		
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	4,800	5,830	653,288	2026/01/29		
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債証券	7.7500	6,100	8,515	954,026	2031/01/14		
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	5,400	6,134	687,364	2044/01/22		
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	国債証券	5.5500	10,400	11,312	1,267,475	2045/01/21		
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	国債証券	4.6650	6,100	6,194	694,016	2024/01/17		
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	国債証券	6.3750	3,600	4,609	516,449	2032/01/15		
COLOMBIA 6.125 01/18/41	国債証券	6.1250	9,000	10,561	1,183,320	2041/01/18		
INDONESIA 5.25 01/17/42	国債証券	5.2500	7,300	7,870	881,793	2042/01/17		
INDONESIA 6.75 01/15/44	国債証券	6.7500	6,500	8,325	932,769	2044/01/15		
BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	5.0000	11,800	10,656	1,193,989	2045/01/27		
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	国債証券	4.3500	7,000	6,462	724,086	2047/01/15		
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	国債証券	4.0000	7,400	7,529	843,555	2021/01/15		
INDONESIA 5.125 01/15/45	国債証券	5.1250	6,400	6,810	763,062	2045/01/15		
INDONESIA 5.25 01/08/47	国債証券	5.2500	3,400	3,687	413,098	2047/01/08		
INDONESIA 4.35 01/11/48	国債証券	4.3500	4,400	4,317	483,683	2048/01/11		
BRAZIL 8.25 01/20/34	国債証券	8.2500	5,200	6,573	736,474	2034/01/20		
PANAMA 6.7 01/26/36	国債証券	6.7000	9,900	12,781	1,432,082	2036/01/26		
BRAZIL 7.125 01/20/37	国債証券	7.1250	8,300	9,731	1,090,345	2037/01/20		
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	6,500	8,915	998,946	2038/01/17		
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国債証券	3.9500	6,800	7,059	790,945	2040/01/20		
INDONESIA 5.95 01/08/46	国債証券	5.9500	4,200	4,937	553,246	2046/01/08		
BRAZIL 4.875 01/22/21	国債証券	4.8750	13,400	13,842	1,550,880	2021/01/22		
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	3.6000	9,200	9,158	1,026,129	2025/01/30		
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	国債証券	5.0000	4,800	5,617	629,377	2037/01/13		
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	11,800	12,094	1,355,044	2025/01/15		
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	5,000	5,166	578,832	2027/01/08		
ROMANIA 4.875 01/22/24	国債証券	4.8750	6,600	7,008	785,266	2024/01/22		
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	5,000	5,249	588,137	2026/01/28		
CROATIA 6.0 01/26/24	国債証券	6.0000	7,400	8,262	925,677	2024/01/26		

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	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	国債証券	4.1250	8,000	8,124	910,302	2026/01/21
INDONESIA 5.875 01/15/24	国債証券	5.8750	6,200	6,833	765,668	2024/01/15
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	6,800	7,195	806,197	2026/01/08
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国債証券	4.2000	5,800	6,112	684,890	2024/01/21
BRAZIL 2.625 01/05/23	国債証券	2.6250	7,800	7,546	845,518	2023/01/05
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	10,800	10,802	1,210,346	2028/01/13
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	国債証券	3.7500	9,200	9,022	1,010,936	2028/01/11
INDONESIA 3.5 01/11/28	国債証券	3.5000	3,200	3,108	348,259	2028/01/11
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	国債証券	3.5000	6,400	6,472	725,216	2021/01/21
INDONESIA 2.95 01/11/23	国債証券	2.9500	3,800	3,766	421,962	2023/01/11
BRAZIL 8.75 02/04/25	国債証券	8.7500	4,800	5,944	665,974	2025/02/04
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国債証券	3.7000	6,400	6,362	712,811	2042/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	国債証券	4.6000	8,400	8,027	899,368	2048/02/10
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国債証券	9.5000	6,400	9,794	1,097,346	2030/02/02
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国債証券	5.6250	9,000	10,029	1,123,686	2044/02/26
ROMANIA 6.75 02/07/22	国債証券	6.7500	13,500	14,739	1,651,421	2022/02/07
BRAZIL 5.625 02/21/47	国債証券	5.6250	9,600	9,380	1,050,985	2047/02/21
COLOMBIA 4.0 02/26/24	国債証券	4.0000	9,100	9,348	1,047,357	2024/02/26
HUNGARY 5.375 02/21/23	国債証券	5.3750	9,600	10,337	1,158,231	2023/02/21
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	国債証券	3.0000	6,000	5,875	658,270	2028/02/01
PANAMA 3.875 03/17/28	国債証券	3.8750	6,100	6,279	703,516	2028/03/17
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	7.5000	12,300	13,714	1,536,572	2030/03/31
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	4.7500	15,400	14,976	1,677,967	2044/03/08
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	国債証券	4.3750	5,400	5,398	604,810	2029/03/21
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	国債証券	5.5000	3,600	4,122	461,832	2026/03/30
PERU 6.55 03/14/37	国債証券	6.5500	6,000	8,003	896,700	2037/03/14
HUNGARY 7.625 03/29/41	国債証券	7.6250	5,400	8,021	898,775	2041/03/29
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	国債証券	3.7000	6,600	6,577	736,957	2041/03/01
HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	5.3750	8,600	9,407	1,054,020	2024/03/25
PANAMA 3.75 03/16/25	国債証券	3.7500	8,200	8,400	941,236	2025/03/16
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	国債証券	3.6250	8,900	9,042	1,013,110	2022/03/15
HUNGARY 6.375 03/29/21	国債証券	6.3750	15,000	15,967	1,788,948	2021/03/29
CROATIA 6.375 03/24/21	国債証券	6.3750	9,400	9,912	1,110,574	2021/03/24
COLOMBIA 2.625 03/15/23	国債証券	2.6250	4,700	4,588	514,086	2023/03/15
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国債証券	4.1500	12,400	12,524	1,403,188	2027/03/28
PANAMA 4.5 04/16/50	国債証券	4.5000	8,300	8,550	957,978	2050/04/16
PANAMA 9.375 04/01/29	国債証券	9.3750	4,900	7,109	796,598	2029/04/01
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	5.6250	10,800	11,837	1,326,267	2042/04/04
INDONESIA 4.625 04/15/43	国債証券	4.6250	5,400	5,455	611,199	2043/04/15
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	国債証券	4.5000	9,800	10,111	1,132,908	2022/04/04
INDONESIA 3.75 04/25/22	国債証券	3.7500	8,000	8,115	909,262	2022/04/25
COLOMBIA 3.875 04/25/27	国債証券	3.8750	9,600	9,652	1,081,478	2027/04/25
CROATIA 5.5 04/04/23	国債証券	5.5000	9,400	10,147	1,136,871	2023/04/04
INDONESIA 3.375 04/15/23	国債証券	3.3750	4,700	4,714	528,178	2023/04/15
INDONESIA 4.1 04/24/28	国債証券	4.1000	5,000	5,067	567,751	2028/04/24
BRAZIL 6.0 04/07/26	国債証券	6.0000	8,800	9,684	1,085,050	2026/04/07
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	4,400	4,395	492,502	2026/04/14
COLOMBIA 8.125 05/21/24	国債証券	8.1250	2,900	3,495	391,588	2024/05/21
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	国債証券	5.8750	4,000	4,226	473,512	2022/05/30
PANAMA 4.5 05/15/47	国債証券	4.5000	5,000	5,197	582,327	2047/05/15
INDONESIA 4.875 05/05/21	国債証券	4.8750	10,100	10,455	1,171,425	2021/05/05
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	4.7500	10,400	10,743	1,203,668	2026/05/27
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	5,400	5,575	624,709	2030/06/22

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	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	17,000	17,637	1,976,105	2045/06/15
ROMANIA 5.125 06/15/48	国債証券	5.1250	6,600	6,495	727,802	2048/06/15
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	国債証券	6.3000	2,000	2,041	228,696	2048/06/22
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	5.2500	25,000	25,485	2,855,339	2047/06/23
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	国債証券	4.2500	9,400	9,383	1,051,354	2027/06/23
PERU 7.35 07/21/25	国債証券	7.3500	12,300	15,274	1,711,314	2025/07/21
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	国債証券	5.3750	3,800	3,556	398,525	2044/07/24
COLOMBIA 4.375 07/12/21	国債証券	4.3750	10,200	10,493	1,175,663	2021/07/12
CROATIA 6.625 07/14/20	国債証券	6.6250	12,500	13,023	1,459,124	2020/07/14
INDONESIA 3.85 07/18/27	国債証券	3.8500	2,600	2,601	291,423	2027/07/18
PERU 4.125 08/25/27	国債証券	4.1250	7,300	7,869	881,695	2027/08/25
ROMANIA 4.375 08/22/23	国債証券	4.3750	10,000	10,360	1,160,734	2023/08/22
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	7,200	7,650	857,106	2025/09/16
COLOMBIA 7.375 09/18/37	国債証券	7.3750	7,400	9,597	1,075,337	2037/09/18
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債証券	6.7500	6,200	7,599	851,430	2034/09/27
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	国債証券	5.6500	4,200	4,015	449,853	2047/09/27
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	国債証券	5.8750	4,200	4,737	530,772	2043/09/16
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	国債証券	4.8750	12,400	13,049	1,462,109	2023/09/16
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	8,800	8,943	1,001,973	2110/10/12
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	6,000	7,913	886,624	2034/10/23
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	7,200	6,789	760,658	2028/10/12
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	国債証券	5.0000	3,800	3,404	381,465	2046/10/12
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	4.0000	12,500	12,859	1,440,722	2023/10/02
PERU 5.625 11/18/50	国債証券	5.6250	14,000	17,922	2,008,023	2050/11/18
HUNGARY 5.75 11/22/23	国債証券	5.7500	10,000	11,033	1,236,215	2023/11/22
合 計	-	-	876,100	940,532	105,377,278	-

## ■投資信託財産の構成

2019年4月18日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 105,377,278	% 97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,776,376	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	108,153,654	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、108,062,033千円、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4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.04円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年4月18日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	108,198,466,795円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,718,186,219
公 社 債(評価額)	105,377,278,778
未 収 入 金	44,849,600
未 収 入 息	952,624,823
前 払 費 用	105,527,375
(B) 負 債	131,855,000
未 払 金	44,812,000
未 払 解 約 金	87,043,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	108,066,611,795
元 本	56,267,402,909
次 期 繰 越 損 益 金	51,799,208,886
(D) 受 益 権 総 口 数	56,267,402,909口
1万円当たり基準価額(C/D)	19,206円

(注1) 期首元本額 62,651,486,172円  
追加設定元本額 70,077,059,976円  
一部解約元本額 76,461,143,239円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>	244,903,365円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	186,943,193円
たわらノーロード バランス (堅実型)	9,275,929円
たわらノーロード バランス (標準型)	28,575,707円
たわらノーロード バランス (積極型)	14,342,881円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	225,683円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	622,010円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	1,082,769円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	380,746円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	493,728円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	65,812,114円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10)	196,851,738円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20)	178,790,603円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30)	351,300,641円
投資のソムリエ	8,673,899,294円
グループコントロール	720,989,640円
投資のソムリエ<DC年金>	866,443,655円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	150,180,507円
グループコントロール<DC年金>	505,453円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	4,605,473円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	14,319,990円
投資のソムリエ<DC年金>+リスク抑制型	329,284,222円
ダイナミック・ナビゲーション	523,034円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,014,673,512円
ワールドアセットバランス (基本コース)	1,007,730,855円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	3,896,242,405円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	3,585,101円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	3,128,078円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,356,956円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	6,074,397円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	698,429,996円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,591,616円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	795,968円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	795,968円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	795,968円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	16,237,347,272円
エマージング債券パッシブファンドVA (適格機関投資家専用)	1,660,368,468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)	3,096,334,797円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	4,451,022,211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)	3,910,785,285円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	4,231,991,681円
期末元本合計	56,267,402,909円

## ■損益の状況

当期 自2018年4月19日 至2019年4月18日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5,154,885,774円
受 取 利 息	5,155,605,545
支 払 利 息	△719,771
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,842,026,651
売 買 益	8,983,662,591
売 買 損	△6,141,635,940
(C) そ の 他 費 用	△12,198,340
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	7,984,714,085
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	48,963,587,466
(F) 解 約 差 損 益 金	△62,063,267,689
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	56,914,175,024
(H) 次 期 繰 越 損 益 金(H)	51,799,208,886

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

# エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 運用報告書

第11期 (決算日 2019年4月18日)

(計算期間 2018年4月19日～2019年4月18日)

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIエマージング・マーケット・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	投資信託 受益証券・ 投資証券 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	(円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	騰落率				
7期(2015年4月20日)	11,412	22.2	ポイント 250,241.33	% 23.2	% 95.4	% 3.6	% 0.9	百万円 41,339
8期(2016年4月18日)	8,600	△24.6	189,749.05	△24.2	92.8	6.1	1.0	36,196
9期(2017年4月18日)	10,121	17.7	224,042.80	18.1	95.8	3.2	0.9	40,863
10期(2018年4月18日)	12,241	20.9	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7	66,443
11期(2019年4月18日)	12,260	0.2	276,323.22	1.2	94.4	4.4	0.6	61,535

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

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

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

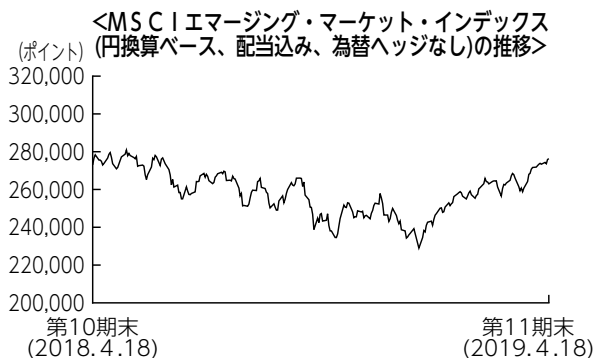
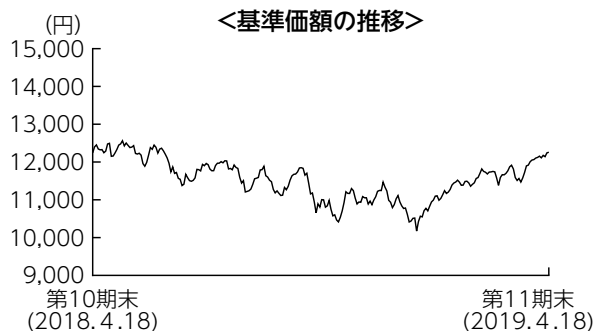
年 月 日	基 準 価 額		MSCIエマージング・ マーケット・インデックス		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
	円	騰落率	(円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	騰落率			
(期 首) 2018年 4 月 18 日	円 12,241	% -	ポイント 273,007.15	% -	% 92.1	% 7.1	% 0.7
4 月 末	12,288	0.4	273,760.40	0.3	92.2	7.1	0.7
5 月 末	11,889	△2.9	265,261.40	△2.8	91.6	7.2	0.6
6 月 末	11,411	△6.8	255,045.10	△6.6	93.0	6.3	0.7
7 月 末	11,979	△2.1	268,351.33	△1.7	94.6	4.7	0.7
8 月 末	11,637	△4.9	261,115.88	△4.4	87.4	11.6	0.6
9 月 末	11,843	△3.3	266,012.81	△2.6	93.3	6.1	0.7
10 月 末	10,537	△13.9	236,534.41	△13.4	94.8	4.5	0.7
11 月 末	11,248	△8.1	252,772.61	△7.4	96.5	2.6	0.6
12 月 末	10,518	△14.1	236,715.28	△13.3	95.4	2.7	0.6
2019年 1 月 末	11,272	△7.9	253,056.23	△7.3	93.4	5.9	0.6
2 月 末	11,731	△4.2	263,953.75	△3.3	91.1	8.2	0.6
3 月 末	11,577	△5.4	260,713.93	△4.5	92.0	7.4	0.6
(期 末) 2019年 4 月 18 日	12,260	0.2	276,323.22	1.2	94.4	4.4	0.6

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2018年4月19日から2019年4月18日まで）



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ました。トランプ米大統領による制裁の発動が公言されたトルコではリラが大幅に下落し、経済成長見通しを引き下げ、財政赤字の拡大が示唆された南アフリカでもランドが下落しました。

### 基準価額の推移

当期末の基準価額は12,260円となり、前期末比で0.2%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

ブラジルやインドなどの株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

当期の新興国株式市場は前期末比で上昇しました。期前半は世界景気の先行きや米中の貿易摩擦を巡る思惑などから下落しましたが、2019年の年明け以降は米国が金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから世界景気の先行き懸念が和らぎ、新興国株式市場は上昇基調となりました。米中通商協議の進展期待もあり、その後も市場心理の改善を背景に堅調に推移しました。中でも原油価格の安定が好感されたロシアや、改革派の新大統領が誕生したブラジルなどが上昇を牽引しました。

為替市場では2018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る展開となりました。2019年に入ると、米政府機関の閉鎖が回避されたことや、米中通商問題の進

## ポートフォリオについて

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

### 【運用状況】

#### ○組入上位10業種

##### 期首（前期末）

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

##### 期末

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



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.2%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△1.1%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

## 今後の運用方針

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



## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	11円 ( 9) ( 2) ( 0) ( 0)	0.091% (0.077) (0.013) (0.001) (0.000)
(b) 有価証券取引税 (株 式) (投 資 証 券)	11 (11) ( 0)	0.094 (0.094) (0.000)
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	16 (14) ( 2)	0.143 (0.125) (0.017)
合 計	38	0.327

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(11,540円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (2018年4月19日から2019年4月18日まで)

### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 11,927.77 (276.59)	千アメリカ・ドル 31,719 (-)	百株 14,699.08	千アメリカ・ドル 29,840
	香 港	百株 548,003.92 (8,325.56)	千香港・ドル 493,096 (△399)	百株 443,554.62	千香港・ドル 464,252
	台 湾	百株 133,134.93 (△3,774.01)	千台湾・ドル 766,554 (△6,020)	百株 162,084.36	千台湾・ドル 902,409
	イ ギ リ ス	百株 281.6 (-)	千イギリス・ポンド 233 (-)	百株 54.04	千イギリス・ポンド 47
	ト ル コ	百株 8,193.77 (2,671.91)	千トルコ・リラ 7,585 (-)	百株 13,654.19	千トルコ・リラ 10,559
	メ キ シ コ	百株 25,457.85 (-)	千メキシコ・ペソ 95,051 (△394)	百株 32,989.5	千メキシコ・ペソ 117,881
	フ ィ リ ピ ン	百株 15,189.44 (3.17)	千フィリピン・ペソ 132,856 (-)	百株 23,495.7	千フィリピン・ペソ 142,265
	チ リ	百株 202,488.51 (638.29)	千チリ・ペソ 1,724,802 (-)	百株 282,087.08	千チリ・ペソ 2,000,223
	コ ロ ン ビ ア	百株 4,437.15 (-)	千コロンビア・ペソ 3,637,945 (-)	百株 5,011.51	千コロンビア・ペソ 4,116,756
	カ タ ー ル	百株 1,092.57 (-)	千カタール・リアル 11,083 (-)	百株 1,457.03	千カタール・リアル 8,059
イ ン ド	百株 23,664.17 (3,507.78)	千インド・ルピー 1,463,123 (-)	百株 28,858.51	千インド・ルピー 1,650,478	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	パキスタン	百株 — (—)	千パキスタン・ルピー — (—)	百株 613	千パキスタン・ルピー 12,028
	インドネシア	百株 124,997 (—)	千インドネシア・ルピア 68,526,603 (—)	百株 162,218	千インドネシア・ルピア 76,953,524
	アラブ首長国連邦	百株 14,131.71 (420)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 7,741 (—)	百株 16,834.42	千アラブ首長国連邦・ディルハム 6,415
	ブラジル	百株 21,389 (2,933.23)	千ブラジル・レアル 58,351 (△933)	百株 25,900.64	千ブラジル・レアル 66,920
	チエコ	百株 637.07 (—)	千チエコ・コルナ 9,092 (△22)	百株 744.1	千チエコ・コルナ 12,137
	韓国	百株 6,193.84 (5,802.04)	千韓国・ウォン 35,916,372 (△1,871)	百株 7,387.98	千韓国・ウォン 42,620,362
	中国	百株 25,146 (315.2)	千オフショア・人民元 30,194 (—)	百株 2,485	千オフショア・人民元 3,687
	マレーシア	百株 36,236 (764.6)	千マレーシア・リンギット 24,326 (—)	百株 52,486.8	千マレーシア・リンギット 29,713
	南アフリカ	百株 21,141.3 (△575.78)	千南アフリカ・ランド 213,051 (△4,806)	百株 23,259.26	千南アフリカ・ランド 227,163
	タイ	百株 47,425 (10,608)	千タイ・バーツ 174,461 (△19)	百株 49,809	千タイ・バーツ 207,726
	ポーランド	百株 2,729.57 (—)	千ポーランド・ズロチ 8,768 (—)	百株 4,308.01	千ポーランド・ズロチ 11,516
	ハンガリー	百株 406.05 (—)	千ハンガリー・フォリント 185,732 (—)	百株 452.31	千ハンガリー・フォリント 227,297
ユーロ圏	百株 3,613.99 (△4,185.15)	千ユーロ 527 (△2)	百株 8,481.84	千ユーロ 709	

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## (2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 — (59,033)	千タイ・バーツ — (19)	証券 — (—)	千タイ・バーツ — (—)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

### (3) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
トルコ EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	千口 — (-)	千トルコ・リラ — (-)	千口 231.071 (-)	千トルコ・リラ 399 (-)
メキシコ FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	千口 69.8 (-)	千メキシコ・ペソ 12,260 (-)	千口 89.3 (-)	千メキシコ・ペソ 15,870 (-)
CEMEX SAB DE CV	715.2 (-)	7,226 (-)	776.7 (-)	8,656 (-)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	207 (-)	5,840 (△159)	203.5 (-)	5,327 (-)
南アフリカ HYPROP INVESTMENTS LTD	千口 — (-)	千南アフリカ・ランド — (-)	千口 7.533 (-)	千南アフリカ・ランド 772 (-)
FORTRESS REIT LTD-B	— (95.302)	— (1,476)	37.518 (-)	558 (-)
RESILIENT REIT LTD	— (-)	— (△161)	— (-)	— (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

### (4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 53,548	百万円 55,556	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	56,174,054千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	52,855,602千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.06

(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4月19日から2019年4月18日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### (1) 外国株式

銘柄	株数	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		
CTRIIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	416	390.58	1,716	192,327	インターネット販売・通信販売	
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	235	170	270	30,303	金属・鉱業	
SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	755	699	431	48,305	石油・ガス・消耗燃料	
CREDICORP LTD	70.49	64.94	1,508	169,062	銀行	
SINA CORP	61	58.7	380	42,577	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	607.25	527.53	422	47,283	無線通信サービス	
NETEASE INC-ADR	83	74.21	1,990	223,061	娯楽	
SOUTHERN COPPER CORP	87.8	72.48	303	33,976	金属・鉱業	
LUKOIL SPON ADR	462.85	467	4,056	454,474	石油・ガス・消耗燃料	
GAZPROM PAO ADR	5,826.6	5,196.69	2,631	294,844	石油・ガス・消耗燃料	
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	1,198.44	1,570.79	645	72,332	銀行	
INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	-	1,058	125	14,082	石油・ガス・消耗燃料	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	962.8	1,028.8	157	17,693	不動産管理・開発	
SURGUTNEFTEGAZ ADR	982.17	775.37	299	33,550	石油・ガス・消耗燃料	
51.JOB INC ADR	-	23	214	24,034	専門サービス	
X5 RETAIL GROUP NV GDR	-	126.36	338	37,885	食品・生活必需品小売り	
NOVATEK PJSC GDR	103.65	88.33	1,604	179,819	石油・ガス・消耗燃料	
BAIDU INC -SPON ADR	289	263.13	4,481	502,151	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	139.7	136.17	363	40,765	金属・鉱業	
MMC NORILSK NICKEL ADR	726.38	635.43	1,445	161,965	金属・鉱業	
ROSNEFT OIL CO GDR	1,389.2	1,151	788	88,336	石油・ガス・消耗燃料	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	142	136.49	1,224	137,218	各種消費者サービス	
SEVERSTAL GDR	269.57	247.28	397	44,550	金属・鉱業	
TATNEFT ADR	284.7	246.84	1,727	193,591	石油・ガス・消耗燃料	
MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	-	237.48	210	23,627	金属・鉱業	
VTB BANK OJSC GDR	3,220	1,720	199	22,334	銀行	
DP WORLD PLC	183.2	152.19	263	29,498	運送インフラ	
MAGNIT PJSC GDR	388.47	356.89	503	56,400	食品・生活必需品小売り	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	434	424.34	331	37,178	インターネット販売・通信販売	
RUSHYDRO PJSC ADR	1,939.6	-	-	-	電力	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	339	339.86	1,177	131,901	各種消費者サービス	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	-	27	145	16,265	資本市場	
SBERBANK ADR	2,890.2	2,588.17	3,856	432,068	銀行	
PHOSAGRO PJSC GDR	199.72	137.84	176	19,814	化学	
HUAZHU GROUP LTD ADR	-	126.76	529	59,365	ホテル・レストラン・レジャー	
YY INC-ADR	43	43.98	387	43,376	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
GDS HOLDINGS LTD ADR	-	56	215	24,193	情報技術サービス	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	-	81.15	150	16,883	娯楽	
58.COM INC ADR	97	91.17	660	74,056	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
AUTHOME INC ADR	56	56.56	634	71,062	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
WEIBO CORP ADR	49	54.27	386	43,262	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
JD.COM INC ADR	692	697.18	2,081	233,164	インターネット販売・通信販売	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	1,208.8	1,230.79	23,083	2,586,271	インターネット販売・通信販売	
MOMO INC SPON ADR	115	140.47	506	56,720	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
BAOZUN INC-SPN ADR	-	34	141	15,869	インターネット販売・通信販売	
PINDUODUO INC ADR	-	184.17	423	47,500	インターネット販売・通信販売	
YUM CHINA HOLDINGS INC	405	343.85	1,524	170,819	ホテル・レストラン・レジャー	
IQIYI INC ADR	-	111.09	254	28,502	娯楽	
POLYUS PJSC GDR	-	60.12	233	26,135	金属・鉱業	
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	-	47.46	144	16,223	医薬品	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	-	306.96	599	67,132	航空貨物・物流サービス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	27,352.59 37銘柄	24,857.87 50銘柄	66,349 -	7,433,825 <12.1%>	

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	
JIANGXI COPPER CO LTD	1,380	1,240	1,396	19,938	金属・鉱業
JIANGSU EXPRESS	1,240	1,280	1,397	19,960	運送インフラ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	1,620	1,260	936	13,368	旅客航空輸送業
ANGANG STEEL CO LTD-H	-	1,040	601	8,583	金属・鉱業
CHINA MOBILE LIMITED	6,440	5,825	44,270	632,175	無線通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	1,310	1,060	5,363	76,592	建設資材
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	-	2,880	624	8,924	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING ENTERPRISES	525	515	2,188	31,255	ガス
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	4,240	4,360	2,075	29,636	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	3,720	3,400	3,325	47,483	ヘルスケア・テクノロジー
YANZHOU COAL MINING CO LTD	1,880	1,720	1,523	21,761	石油・ガス・消耗燃料
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	770	700	4,861	69,422	パーソナル用品
WUJIANG POWER INTL CORP-H	-	1,440	499	7,135	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	-	1,240	739	10,553	旅客航空輸送業
CNOOC LTD	18,770	16,970	25,183	359,620	石油・ガス・消耗燃料
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	3,220	2,700	2,484	35,471	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	4,980	4,520	7,069	100,949	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	4,051.2	3,651.2	10,771	153,810	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,928.88	2,648.88	9,059	129,364	不動産管理・開発
CITIC LTD	6,300	5,620	6,676	95,341	コングロマリット
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	-	1,980	362	5,174	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	1,880	1,620	1,143	16,332	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	7,300	6,980	4,976	71,067	コンピュータ・周辺機器
PETRO CHINA CO LTD	22,000	19,820	10,028	143,212	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	6,487.42	5,927.42	5,785	82,612	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	1,741.9	1,599.9	4,167	59,515	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	26,652	24,092	14,840	211,924	石油・ガス・消耗燃料
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	-	540	590	8,436	医薬品
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	1,020	940	1,821	26,014	情報技術サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	-	2,320	2,308	32,963	ソフトウェア
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	800	755	5,617	80,213	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	3,660	2,880	2,399	34,258	石油・ガス・消耗燃料
TOWNGAS CHINA CO LTD	-	910	546	7,809	ガス
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,620	1,520	1,363	19,469	運送インフラ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	-	6,340	1,217	17,382	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	1,320	1,240	2,031	29,004	運送インフラ
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD	3,740	3,740	1,260	17,998	金属・鉱業
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	-	800	1,848	26,389	資本市場
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	-	1,040	1,851	26,435	運送インフラ
CHINA EVERBRIGHT LTD	1,120	1,060	1,600	22,856	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,858	1,710	4,172	59,581	ガス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	660	635	1,768	25,253	電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	5,220	4,780	8,995	128,462	自動車
SHENZHEN INVESTMENT LTD	-	3,060	973	13,895	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	860	820	2,906	41,510	ガス
BYD CO LTD	680	575	3,432	49,019	自動車
CHINA TELECOM CORP LTD	14,640	13,400	5,654	80,750	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	2,020	1,720	1,446	20,656	エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	11,700	14,300	2,330	33,285	娯楽
SINOTRANS LTD	-	1,900	668	9,550	航空貨物・物流サービス
MAANSHAN IRON & STEEL	-	1,720	700	9,996	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	2,490	3,375.92	2,636	37,650	商業サービス・用品
MMG LTD	-	2,200	869	12,409	金属・鉱業
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	1,700	1,360	884	12,623	紙製品・林産品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	4,851.92	6,617.88	6,181	88,266	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	2,250	1,890	895	12,792	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	1,952	1,912	2,168	30,962	独立系発電事業者・エネルギー販売業者

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	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	2,900	3,125	2,221	31,728	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	7,790	7,150	15,694	224,113	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	5,850	5,610	1,924	27,478	金属・鉱業
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	—	700	343	4,908	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,600	1,760	1,355	19,352	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	3,172	2,747	2,238	31,970	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD	2,154.4	1,764.4	2,558	36,533	機械
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	—	1,000	507	7,239	海運業
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	3,530	3,730	1,406	20,080	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL	430	460	872	12,454	コンプロマリット
TINGYI HOLDING CORP	1,940	1,780	2,249	32,128	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	400	340	1,598	22,819	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	2,980	2,820	4,094	58,471	水道
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	—	2,080	998	14,257	医薬品
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	1,733.33	1,413.33	4,932	70,436	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	1,460	1,460	1,319	18,847	運送インフラ
SINO BIOPHARMACEUTICAL	4,740	6,755	5,383	76,879	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,920	2,650	7,499	107,092	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	5,979	5,426	214,652	3,065,238	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	5,470	4,920	46,469	663,583	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	5,660	5,080	2,458	35,110	水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	9,702.4	9,702.4	824	11,776	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	3,500	728	10,395	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	1,980	1,640	1,669	23,840	旅客航空輸送業
ZTE CORP	712.88	712.88	1,867	26,671	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	2,500	2,500	792	11,316	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	3,600	3,340	6,032	86,137	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	—	2,485	921	13,165	海運業
BANK OF COMMUNICATIONS	9,172.05	8,102.05	5,436	77,632	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	2,062.5	1,862.5	1,495	21,356	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	775	720	3,916	55,931	電子装置・機器・部品
CHINA CONSTRUCTION BANK	88,185.3	91,385.3	65,431	934,367	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	800	726	7,506	107,197	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,940	2,700	2,327	33,235	自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	1,600	1,580	2,022	28,879	不動産管理・開発
SSY GROUP LTD	—	1,440	1,114	15,915	医薬品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	1,680	1,710	1,332	19,022	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	3,740	3,920	2,943	42,039	建設資材
BANK OF CHINA LTD	83,102	75,282	28,757	410,660	銀行
SHUI ON LAND LTD	—	3,355	657	9,390	不動産管理・開発
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,200	1,130	2,808	40,098	不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	—	820	636	9,086	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	1,004	800	1,342	19,169	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	4,089.7	3,709.7	15,228	217,460	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	77,302.35	65,902.35	39,936	570,297	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	—	960	695	9,925	金属・鉱業
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	—	1,040	923	13,187	電子装置・機器・部品
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	2,756	2,276	1,604	22,913	各種電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	4,830	4,420	3,593	51,314	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	—	1,780	623	8,896	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	640	540	1,002	14,311	機械
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	607	510	2,129	30,405	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	1,250	1,150	2,633	37,606	家庭用耐久財
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	—	1,910	508	7,255	食品
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	5,691.42	7,271.42	9,409	134,363	不動産管理・開発
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	3,690	3,690	1,265	18,073	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	9,388	8,798	4,539	64,827	銀行

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	—	1,210	1,142	16,311	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	757	687	6,753	96,435	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,150	1,040	5,761	82,275	繊維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL	2,795.28	2,610.28	3,362	48,009	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	5,680	5,140	2,806	40,075	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	3,085	2,535	958	13,683	不動産管理・開発
SOHO CHINA LTD	1,780	1,725	520	7,439	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	810	760	1,637	23,387	ソフトウェア
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	13,620	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SINOTRUK HONG KONG LTD	—	645	1,208	17,260	機械
CHINA RAILWAY GROUP LTD	4,470	3,380	2,217	31,662	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	—	1,220	868	12,404	食品
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	790	525	683	9,761	通信機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	1,875	1,650	1,592	22,737	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,970	4,880	3,059	43,693	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	2,768	2,518	8,536	121,894	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,490	2,500	6,362	90,856	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD - H	4,034.5	3,374.5	2,460	35,128	機械
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	1,530	1,260	913	13,044	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,400	2,115	1,501	21,443	食品・生活必需品小売り
BBMG CORP	—	2,220	663	9,478	建設資材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	—	1,452	651	9,309	金属・鉱業
SINOPHARM GROUP CO	1,280	1,076	3,437	49,092	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	—	2,380	2,030	28,990	建設資材
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	—	2,760	637	9,104	建設・土木
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	2,078.05	2,745.27	2,855	40,770	自動車
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	—	1,995	1,302	18,603	金属・鉱業
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	2,850	2,680	1,286	18,369	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	3,170	2,720	1,471	21,013	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	900	737	1,292	18,459	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	4,720	4,720	1,057	15,097	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	3,250	3,250	627	8,957	医薬品
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,570	2,330	9,646	137,747	不動産管理・開発
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	—	1,660	750	10,714	不動産管理・開発
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,615	1,440	4,068	58,091	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	814	846	3,912	55,874	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	5,428.8	5,926.56	3,627	51,794	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	—	2,030	702	10,029	不動産管理・開発
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	—	848	812	11,600	電気設備
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,570	2,690	1,035	14,789	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	27,260	27,910	10,326	147,465	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	—	550	1,193	17,043	専門小売り
FAR EAST HORIZON LTD	2,020	1,990	1,671	23,870	各種金融サービス
CITIC SECURITIES CO LTD	2,425	2,025	3,685	52,628	資本市場
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	—	1,720	1,668	23,824	不動産管理・開発
HAITONG SECURITIES CO LTD	3,636	2,920	3,095	44,199	資本市場
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	6,910	7,890	2,674	38,194	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	490	460	1,343	19,180	医薬品
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	3,820	3,340	1,940	27,710	不動産管理・開発
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	—	1,215	871	12,440	建設・土木
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	3,455	3,285	1,833	26,175	資本市場
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	9,860	9,860	0	0	半導体・半導体製造装置
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1,000	850	1,067	15,245	自動車部品
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	3,230	3,230	0	0	食品
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	—	960	668	9,541	商業サービス・用品
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	—	940	355	5,073	不動産管理・開発
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	—	598	980	14,004	資本市場

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	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	—	7,170	3,427	48,941	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	—	430	1,593	22,750	食品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	—	740	1,594	22,772	ライフサイエンス・ツール/サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	—	1,180	1,692	24,163	商業サービス・用品
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	—	3,080	1,136	16,229	自動車部品
CHINA TOWER CORP LTD	—	38,060	7,992	114,134	各種電気通信サービス
XIAOMI CORP	—	3,356	3,966	56,645	コンピュータ・周辺機器
MEITUAN DIANPING	—	294	1,622	23,174	インターネット販売・通信販売
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY-RTS	—	114	11	167	電気設備
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	—	2,760	1,189	16,986	半導体・半導体製造装置
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	9,040	7,960	1,759	25,120	資本市場
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	—	1,340	1,779	25,411	不動産管理・開発
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	1,640	1,480	4,070	58,119	機械
CHINA VANKE CO LTD-H	1,254.61	1,208.61	3,952	56,436	不動産管理・開発
LUYE PHARMA GROUP LTD	—	1,080	774	11,057	医薬品
CAR INC	—	680	432	6,175	陸運・鉄道
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	—	390	748	10,681	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD	12,130	9,810	2,158	30,819	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
FULLSHARE HOLDINGS LTD	7,025	6,950	646	9,229	電気設備
BAIC MOTOR CORP LTD	—	1,635	1,038	14,825	自動車
GF SECURITIES CO LTD	1,332	1,120	1,285	18,360	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	512	512	1,584	22,628	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	1,794	1,458	2,303	32,895	資本市場
3SBIO INC	1,130	1,290	1,984	28,331	バイオテクノロジー
LEGEND HOLDINGS CORP	—	315	685	9,783	コンピュータ・周辺機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	2,120	1,605	1,810	25,853	医薬品
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	10,000	9,040	1,545	22,074	資本市場
CHINA LITERATURE LTD	—	240	894	12,766	メディア
DALI FOODS GROUP CO LTD	—	1,880	1,017	14,523	食品
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	—	1,410	922	13,168	電子装置・機器・部品
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	—	5,250	882	12,594	保険
MEITU INC	1,050	1,525	526	7,513	コンピュータ・周辺機器
BOC AVIATION LTD	—	194	1,320	18,852	商社・流通業
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	—	230	686	9,803	保険
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	—	960	1,689	24,127	資本市場
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	—	445	3,722	53,156	ライフサイエンス・ツール/サービス
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	—	20,960	503	7,183	繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	779,691.89	892,466.75	981,470	14,015,400	
	銘 柄 数 < 比 率 >	207 銘柄	—	< 22.8 % >	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACER INC	3,145.32	2,785.32	5,918	21,485	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	745.54	675.54	16,212	58,853	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	466.16	456.16	8,781	31,875	半導体・半導体製造装置
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	7,378.06	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	2,629.28	1,949.28	8,109	29,435	建設資材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	—	310	6,975	25,319	電子装置・機器・部品
TAIWAN BUSINESS BANK	3,361.71	3,714.57	4,438	16,113	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	990	850	5,839	21,197	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	730	650	5,622	20,409	コンピュータ・周辺機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	725.43	549.75	4,150	15,066	コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC	2,668.58	2,608.58	15,834	57,477	コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	900.7	920.7	4,525	16,426	不動産管理・開発
EVA AIRWAYS CORP	2,861.61	1,962.69	3,081	11,185	旅客航空輸送業
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	687.6	627.6	16,411	59,574	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,397.55	5,123.45	9,401	34,127	銀行
CHINA AIRLINES	2,321.56	2,321.56	2,309	8,385	旅客航空輸送業
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	2,011.69	1,961.69	8,072	29,302	自動車部品



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	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
CHINA STEEL CORP	13,500.58	12,110.58	30,579	111,002	金属・鉱業
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	2,641.46	2,649.94	6,704	24,336	保険
ADVANTECH CO LTD	368.89	298.89	7,412	26,907	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	4,503.04	3,913.04	7,630	27,698	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	2,066.63	1,976.63	32,021	116,237	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,100	1,080	6,901	25,051	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,903.27	3,573.27	39,127	142,032	各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	8,801.94	8,731.94	9,954	36,134	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,718	1,468	16,368	59,416	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	1,786.58	1,982.76	2,518	9,140	海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	3,418.24	3,218.24	10,507	38,142	コングロマリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	298.25	298.25	7,083	25,712	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	183.22	153.22	6,504	23,610	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	612.85	512.85	10,026	36,395	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	4,366.33	4,246.33	46,284	168,014	化学
FORMOSA TAFFETA CO LTD	650	950	3,439	12,483	繊維・アパレル・贅沢品
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	3,105.94	3,355.94	36,411	132,175	化学
GIANT MANUFACTURING	301.51	301.51	6,542	23,750	レジャー用品
MEDIATEK INC	1,575.07	1,435.07	41,401	150,288	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,039.36	6,319.36	28,563	103,685	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	7,093.13	6,342.32	12,208	44,318	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	310	260	10,894	39,545	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	1,770	1,440	10,742	38,994	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	10,461.41	8,761.41	15,682	56,929	資本市場
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	8,589.2	7,749.2	34,173	124,051	保険
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	13,614.03	12,234.03	12,234	44,409	銀行
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,070.28	9,361.68	22,421	81,389	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	16,345.32	12,492.25	114,678	416,284	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	11,374.95	10,264.95	28,844	104,705	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	102.2	92.2	42,642	154,792	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	9,989.77	9,785.89	13,895	50,442	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	8,567.24	9,430.61	8,232	29,885	保険
INVENTEC CO LTD	2,680.05	2,060.05	5,150	18,694	コンピュータ・周辺機器
HTC CORPORATION	568.32	-	-	-	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	2,188.45	1,848.45	8,188	29,724	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	10,955.33	10,584.43	12,330	44,761	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	18,500.48	16,720.48	34,026	123,515	銀行
MACRONIX INTERNATIONAL	1,930	-	-	-	半導体・半導体製造装置
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	8,913.27	9,322.2	19,902	72,247	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	685.6	855.6	6,485	23,542	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	4,998.28	4,898.28	38,010	137,978	化学
WISTRON CORP	2,593.01	2,669.16	6,873	24,949	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	2,369.9	2,289.9	8,655	31,420	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	5,112.97	4,622.97	33,655	122,168	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	573.92	543.92	15,692	56,962	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,374.8	1,084.8	12,475	45,284	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	166.58	126.58	3,930	14,267	半導体・半導体製造装置
RUJENTEX DEVELOPMENT CO LTD	906.56	543.93	2,328	8,450	不動産管理・開発
RUJENTEX INDUSTRIES LTD	687.15	338.29	2,611	9,480	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	945.88	955.88	6,882	24,982	電子装置・機器・部品
SILICONWARE PRECISION INDS	2,277.43	-	-	-	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP	706.39	346.39	1,773	6,437	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	1,448.99	1,518.99	5,870	21,311	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT CORP	3,898.74	4,445.61	18,649	67,697	建設資材
TATUNG CO LTD	-	1,640	4,239	15,389	家庭用耐久財
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	2,280	-	-	-	電気設備
TAIWAN SEMICONDUCTOR	25,800.83	23,370.83	611,147	2,218,464	半導体・半導体製造装置

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	12,005.25	11,565.25	14,109	51,217	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	3,240	3,180	5,342	19,392	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORP	220	231.6	7,990	29,004	電子装置・機器・部品
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	2,270	2,030	7,226	26,233	運送インフラ
ININOLUX CORPORATION	9,643.45	8,203.45	8,490	30,820	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	1,995.26	1,432.03	5,814	21,104	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	205.6	190.73	5,521	20,043	機械
TAIMED BIOLOGICS INC	180	180	3,033	11,009	バイオテクノロジー
PEGATRON CORP	1,955.54	1,925.54	11,765	42,707	コンピュータ・周辺機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	130	90	3,640	13,215	機械
WIN SEMICONDUCTORS CORP	340	310	6,789	24,644	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,300.76	1,117.37	14,916	54,148	各種金融サービス
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,880	—	—	—	各種電気通信サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	483.85	453.85	5,105	18,534	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	8,528.28	8,394.12	16,536	60,027	銀行
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	—	2,990	14,531	52,748	銀行
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	—	3,329.03	25,034	90,874	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	210	190	6,555	23,794	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	150	150	3,802	13,803	家庭用耐久財
GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	180	—	—	—	電子装置・機器・部品
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	1,833,403 87銘柄	6,655,254 —	<10.8%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	—	227.56	184	26,881	金属・鉱業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	184 1銘柄	26,881 —	<0.0%>
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
AKBANK TAS	2,165.63	2,958.91	1,938	37,676	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	215.2	197.24	402	7,822	飲料
ARCELIK	304.29	189.02	350	6,816	家庭用耐久財
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	176.77	317.66	679	13,215	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	1,527.76	1,259.6	1,161	22,576	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	89.14	59.19	307	5,983	自動車
KOC HOLDING AS	845.07	673.25	1,145	22,275	コングロマリット
PETKIM PETROKIMYA HOLDING	801.59	881.74	417	8,107	化学
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	796.24	543.97	323	6,291	コングロマリット
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	177.97	—	—	—	自動車
TURK HAVA YOLLARI	578.27	490.81	704	13,691	旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,108.41	931.18	1,219	23,713	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI AS	2,430.61	2,383.94	2,074	40,319	銀行
TURKIYE IS BANKASI	1,625.02	1,510.63	919	17,884	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	129.01	106.81	1,408	27,387	石油・ガス・消耗燃料
ULKER BISKUVI SANAYI AS	131.21	—	—	—	食品
YAPI VE KREDI BANKASI AS	735.99	—	—	—	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING AS	983.54	1,091.14	892	17,351	各種金融サービス
COCA-COLA ICECEK AS	64.51	—	—	—	飲料
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	218.17	190.11	1,533	29,806	食品・生活必需品小売り
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	907.31	—	—	—	銀行
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	137.35	137.35	332	6,472	運送インフラ
TURKIYE HALK BANKASI AS	619.7	619.7	394	7,673	銀行
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	562	—	—	—	各種電気通信サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	16,207 18銘柄	315,065 —	<0.5%>
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
ALFA SAB DE CV	3,062	2,641	5,379	32,009	コングロマリット
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	538	—	—	—	飲料
EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	191	191	2,286	13,604	複合小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(メキシコ)</b>	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
GRUPO TELEVISAB	2,614	2,389	9,718	57,824	メディア
GRUPO BIMBO SAB DE CV	1,644	1,626	6,588	39,201	食品
GRUMA SAB DE CV	245.7	216.4	4,322	25,716	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	220.3	202.6	3,867	23,011	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	543	376	2,745	16,338	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	2,616	2,484	30,533	181,673	銀行
MEXICHEM SAB DE CV	1,082.25	940.25	4,305	25,617	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	147	161.55	3,703	22,036	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	1,567	1,343	4,579	27,248	家庭用品
ALSEA SAB DE CV	-	437	1,959	11,661	ホテル・レストラン・レジャー
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	206.85	204.65	6,310	37,549	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	4,110.52	3,389.52	19,913	118,484	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE CV	35,278.78	32,125.78	47,899	285,002	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	2,447	1,988	5,741	34,160	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	434	426	4,559	27,126	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	5,462	4,962	27,519	163,739	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	397	312	6,083	36,196	運送インフラ
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	-	274	2,493	14,838	メディア
GENTERA SAB DE CV	1,030	-	-	-	消費者金融
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	532	544	4,579	27,247	ガス
BANCO SANTANDER MEXICO SA	1,953.9	1,545.9	5,024	29,893	銀行
GRUPO LALA SAB DE CV	504	-	-	-	食品
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	-	515	6,283	37,386	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	216,398 23銘柄	1,287,571 <2.1%>	
<b>(フィリピン)</b>	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	7,964	7,186	33,774	73,290	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,309.4	1,798.9	9,893	21,469	コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	1,040.86	855.7	7,102	15,412	銀行
AYALA CORP	248.03	244.33	21,989	47,717	各種金融サービス
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	3,406	3,077	4,609	10,002	コングロマリット
DMCI HOLDINGS INC	3,518.5	3,518.5	4,222	9,162	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC	27.85	27.85	5,194	11,271	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	406.8	814.2	10,503	22,791	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,900.5	2,892.4	17,744	38,506	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP	441.3	437.2	13,290	28,841	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	820.37	1,449.97	11,309	24,542	銀行
BDO UNIBANK INC	2,130.13	1,925.83	25,420	55,163	銀行
MEGAWORLD CORP	9,620	9,620	5,473	11,878	不動産管理・開発
PLDT INC	95.2	86	10,526	22,842	無線通信サービス
ROBINSONS LAND CORP	2,187.22	2,187.22	5,314	11,533	不動産管理・開発
SECURITY BANK CORP	234.2	234.2	4,215	9,147	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC	9,369.75	9,700.75	38,414	83,360	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	902.1	791.3	12,027	26,100	食品
SM INVESTMENTS CORP	241.58	219.38	20,402	44,273	コングロマリット
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	18,109	11,489	5,147	11,169	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	2,163	1,282	4,608	10,001	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY	240	234.3	8,879	19,269	電力
GT CAPITAL HOLDINGS INC	90.7	91.37	7,876	17,091	各種金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	287,943 23銘柄	624,836 <1.0%>	
<b>(チリ)</b>	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	70,291.7	64,144.7	315,207	53,364	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	45.34	47.7	217,860	36,883	銀行
BANCO DE CHILE	27,488.49	22,134.93	220,441	37,320	銀行
EMPRESAS CMPC SA	1,248.39	1,115.77	255,399	43,239	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	392.14	376.73	325,080	55,036	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(チリ)</b>	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	151.7	130.24	123,728	20,947	飲料
ENTEL CHILE SA	165	135.72	95,954	16,245	無線通信サービス
ENEL AMERICAS SA	30,871.2	28,187.18	332,552	56,301	電力
COLBUIN SA	9,365.35	8,191.36	125,901	21,315	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AGUAS ANDINAS SA	3,253.57	2,240.14	85,774	14,521	水道
EMBOTELLADORA ANDINA SA	272.7	404.01	99,984	16,927	飲料
LATAM AIRLINES GROUP SA	326.04	306.55	220,102	37,263	旅客航空輸送業
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	93.43	106.24	271,974	46,045	化学
SACI FALABELLA	774.28	674.78	338,807	57,360	複合小売り
ITAU CORPBANCA	194,162.26	132,369.77	79,805	13,511	銀行
CENCOSUD SA	1,483.98	1,511.41	210,977	35,718	食品・生活必需品小売り
AES GENER SA	2,571.35	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ENEL CHILE SA	26,991.19	28,910.6	201,477	34,110	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	369,948.11 18銘柄	290,987.83 17銘柄	3,521,029 -	596,110 <1.0%>
<b>(コロンビア)</b>	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	453.24	441.5	719,645	25,547	電力
ECOPETROL SA	4,479.53	4,555.98	1,380,461	49,006	石油・ガス・消耗燃料
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	101.38	101.38	345,705	12,272	各種金融サービス
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	3,736.94	3,418.31	447,798	15,896	銀行
CEMENTOS ARGOS SA	622.75	377.2	305,909	10,859	建設資材
GRUPO ARGOS SA	271.99	282.17	503,955	17,890	建設資材
BANCOLOMBIA SA	259.2	209.47	860,502	30,547	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	471.49	449.76	1,863,805	66,165	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	254.28	240.67	850,046	30,176	各種金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,650.8 9銘柄	10,076.44 9銘柄	7,277,830 -	258,362 <0.4%>
<b>(カタール)</b>	百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR INSURANCE CO SAQ	174.87	144.17	570	17,512	保険
QATAR NATIONAL BANK	242.17	429.98	7,781	238,822	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	217.11	182.02	844	25,914	銀行
OOREDOO QSC	84.1	67.6	438	13,445	各種電気通信サービス
DOHA BANK QSC	180.35	-	-	-	銀行
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	32.22	50.5	856	26,300	総合公益事業
INDUSTRIES QATAR QSC	155.52	174.05	2,193	67,304	コンプロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	69.65	114.06	1,877	57,635	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	285.29	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN	389.23	365.35	1,329	40,813	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	79.16	167.63	592	18,170	不動産管理・開発
EZDAN HOLDING GROUP QSC	844.31	694.16	770	23,647	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,753.98 12銘柄	2,389.52 10銘柄	17,255 -	529,567 <0.9%>
<b>(インド)</b>	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	2,984.36	2,705.06	363,492	592,492	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	748.55	729.4	26,076	42,503	石油・ガス・消耗燃料
ASIAN PAINTS LTD	286.21	278.04	40,566	66,122	化学
EICHER MOTORS LTD	14.43	12.23	26,013	42,402	自動車
GRASIM INDUSTRIES LTD	356.29	326.39	28,838	47,006	建設資材
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	800.51	721.96	49,678	80,975	自動車
SHREE CEMENT LTD	8.3	8.46	16,577	27,021	建設資材
ICICI BANK LTD	2,503.82	2,271.54	92,451	150,696	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	657.34	584.63	15,472	25,219	石油・ガス・消耗燃料
STATE BANK OF INDIA LTD	1,838.08	1,709.63	53,981	87,989	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	36.57	189.35	9,698	15,808	陸運・鉄道
LIC HOUSING FINANCE LTD	343.15	262.42	13,735	22,388	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LTD	374.27	301.06	16,656	27,149	金属・鉱業
TATA MOTORS LTD	1,746.54	1,561.48	35,992	58,667	自動車

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
JSW STEEL LTD	860	834.15	24,290	39,593		金属・鉱業
TATA POWER CO LTD	1,147.7	1,004.83	7,179	11,702		電力
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	33.39	57.51	17,370	28,314		食品
NESTLE INDIA LTD	23.43	22.5	25,100	40,913		食品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	736.48	—	—	—		電気設備
GAIL INDIA LTD	689.58	700.27	24,621	40,133		ガス
VEDANTA LTD	1,603.88	1,150.72	21,282	34,690		金属・鉱業
AXIS BANK LTD	1,895.45	1,810.46	139,604	227,555		銀行
TITAN COMPANY LTD	311.53	276.48	30,967	50,476		繊維・アパレル・贅沢品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,215.18	1,226.55	19,679	32,078		石油・ガス・消耗燃料
LUPIN LTD	225	224.53	18,702	30,484		医薬品
ACC LTD	39.22	—	—	—		建設資材
BAJAJ FINANCE LTD	175.42	165.95	50,324	82,028		消費者金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,591.84	1,555.5	315,253	513,862		貯蓄・抵当・不動産金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	581.63	438.7	18,230	29,715		メディア
INFOSYS LTD	1,833.01	3,320.56	240,441	391,920		情報技術サービス
WIPRO LTD	1,215.45	1,346.1	37,811	61,633		情報技術サービス
INDIAN OIL CORP LTD	1,166.92	1,682.52	26,196	42,700		石油・ガス・消耗燃料
HINDUSTAN UNILEVER LTD	683.93	615.5	107,007	174,422		家庭用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	592.5	518.18	57,365	93,505		情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	613.72	515.6	21,088	34,373		パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	47.9	45.09	12,353	20,135		自動車
DR REDDYS LABORATORIES LTD	115.96	103.89	29,349	47,840		医薬品
BHARTI AIRTEL LTD	1,486.01	1,351.06	47,118	76,802		無線通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	63.66	292.61	16,270	26,521		飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	1,027.77	813.13	37,611	61,306		医薬品
DIVI'S LABORATORIES LTD	—	77.03	13,207	21,528		ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	112.21	101.11	75,413	122,923		自動車
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	170.84	136.89	8,799	14,343		医薬品
AUROBINDO PHARMA LTD	304.26	262.23	20,516	33,442		医薬品
HAVELLS INDIA LTD	248	264.92	20,084	32,738		電気設備
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	644.6	950.48	15,036	24,509		自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	150.42	138.34	17,010	27,726		消費者金融
PETRONET LNG LTD	702.38	528.75	12,721	20,736		石油・ガス・消耗燃料
CIPLA LTD/INDIA	355	318.7	17,826	29,057		医薬品
LARSEN & TOUBRO LTD	504.12	456.02	62,994	102,681		建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	96.16	93.55	39,805	64,883		建設資材
ASHOK LEYLAND LTD	1,138.2	1,108.86	10,683	17,414		機械
BOSCH LTD	7.74	6.87	12,553	20,462		自動車部品
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	481.21	853.92	182,038	296,723		情報技術サービス
NTPC LTD	1,803.33	2,100.66	28,894	47,098		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	82	74.74	19,977	32,563		医薬品
YES BANK LTD	1,816.38	1,622.58	43,233	70,470		銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	722.16	546.35	12,675	20,660		建設資材
BHARAT FORGE LTD	237.4	184.21	9,362	15,260		自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,156.54	1,161.35	24,963	40,690		金属・鉱業
ITC LTD	3,583.67	3,281.99	100,822	164,341		タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	—	116.66	15,069	24,563		化学
UNITED PHOSPHORUS LTD	361.1	348.38	32,535	53,032		化学
SIEMENS INDIA LTD	62.19	—	—	—		コンプロマリット
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	238.24	328.23	21,932	35,749		パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	467.41	455.27	36,335	59,226		情報技術サービス
VODAFONE IDEA LTD	1,965.27	1,965.27	5,699	9,289		無線通信サービス
MARICO LTD	453.8	456.6	16,620	27,090		パーソナル用品
POWER FINANCE CORP LTD	659.1	—	—	—		各種金融サービス
PAGE INDUSTRIES LTD	—	5.28	12,585	20,514		繊維・アパレル・贅沢品
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	—	1,710.78	33,676	54,893		電力

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE REC LTD	716.16	508.92	20,135	32,820	運送インフラ
BAJAJ FINSERV LTD	856.77	551.73	8,300	13,530	各種金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	37.2	37.23	28,216	45,992	保険
COAL INDIA LTD	84.02	79.67	24,446	39,847	自動車
TATA MOTORS LTD	759.01	1,124.57	28,294	46,119	石油・ガス・消耗燃料
VAKRANGEE LTD	315.68	—	—	—	自動車
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	359.54	—	—	—	情報技術サービス
BHARTI INFRATEL LTD	329.95	289.33	12,185	19,861	消費者金融
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	283.64	322.96	10,107	16,474	各種電気通信サービス
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	344.12	254.66	21,199	34,554	貯蓄・抵当・不動産金融
CADILA HEALTHCARE LTD	23.33	23.33	223	363	金属・鉱業
AVENUE SUPERMARTS LTD	181.46	169.62	5,731	9,342	医薬品
IDFC BANK LTD	—	112.16	15,821	25,789	食品・生活必需品小売り
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,144.21	—	—	—	銀行
	—	83	13,129	21,401	旅客航空輸送業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	3,245,320	5,289,872	
	80銘柄	79銘柄	—	<8.6%>	
(パキスタン)	百株	百株	千パキスタン・ルピー	千円	
LUCKY CEMENT LTD	99	—	—	—	建設資材
MCB BANK LTD	390	390	7,264	5,811	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	745	745	10,622	8,497	石油・ガス・消耗燃料
UNITED BANK LTD	514	—	—	—	銀行
HABIB BANK LTD	544	544	6,597	5,278	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	1,679	24,483	
	5銘柄	3銘柄	—	19,587	<0.0%>
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
AKR CORPORINDO TBK PT	1,504	—	—	—	商社・流通業
UNITED TRACTORS TBK PT	1,692.01	1,670.01	4,413,001	35,304	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	4,792	4,588	2,959,260	23,674	食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,673	1,375	6,792,500	54,340	家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	21,705	19,392	15,028,800	120,230	自動車
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	53,615	47,363	18,329,481	146,635	各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	8,456	6,756	4,171,830	33,374	食品
GUDANG GARAM TBK PT	486	448	3,692,640	29,541	タバコ
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	9,248	7,955	2,967,215	23,737	タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	1,856	1,803	3,876,450	31,011	建設資材
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	—	2,620	2,037,050	16,296	紙製品・林産品
BUKIT ASAM TBK PT	—	2,567	1,021,666	8,173	石油・ガス・消耗燃料
BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	2,904.16	2,613.16	2,462,903	19,703	銀行
BANK MANDIRI	19,918	17,900	13,648,750	109,190	銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	2,765	—	—	—	複合小売り
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	—	980	1,026,550	8,212	紙製品・林産品
BANK RAKYAT INDONESIA	58,799	52,904	22,960,336	183,682	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	10,641	10,641	2,511,276	20,090	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	7,443	7,244	7,026,680	56,213	銀行
KALBE FARMA TBK PT	24,762	18,222	2,724,189	21,793	医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	3,303	2,765	3,684,362	29,474	建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	10,390	9,338	25,656,155	205,249	銀行
XL AXIATA TBK PT	2,907	—	—	—	無線通信サービス
JASA MARGA PERSERO TBK PT	2,001.25	2,001.25	1,220,762	9,766	運送インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT	8,517	7,465	1,052,565	8,420	不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT	14,345	14,345	1,872,022	14,976	石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK	19,128	16,599	1,195,128	9,561	不動産管理・開発
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	2,390	2,385	2,164,387	17,315	食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	1,808	1,808	690,656	5,525	各種電気通信サービス
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	4,803	4,803	1,239,174	9,913	銀行
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	3,920	—	—	—	建設・土木

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)	百株	百株	千円	千円	
PT SURYA CITRA MEDIA TBK	5,113	5,113	892,218	7,137	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	310,884.42 29銘柄	273,663.42 28銘柄	157,318,009 -	1,258,544 <2.0%>
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千円	千円	
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	1,260	1,361.45	697	21,295	銀行
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	1,869.09	1,648.45	2,739	83,698	各種電気通信サービス
DUBAI INVESTMENTS PJSC	1,322.22	-	-	-	コンピュータリット
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	2,083.32	2,010.06	1,887	57,661	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	1,528.79	2,589.74	4,122	125,953	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,868.87	3,431.66	1,705	52,104	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	3,000	3,561.42	644	19,693	不動産管理・開発
EMAAR DEVELOPMENT PJSC	-	774.63	292	8,945	不動産管理・開発
EMAAR MALLS PJSC	1,781.66	1,781.66	297	9,089	不動産管理・開発
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	2,727.83	-	-	-	ホテル・レストラン・レジャー
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	1,902.35	1,902.35	251	7,671	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,344.13 10銘柄	19,061.42 9銘柄	12,638 -	386,112 <0.6%>
(ブラジル)	百株	百株	千円	千円	
BRF SA	442.92	474.92	1,340	38,102	食品
VALE SA	3,340.21	3,005.21	15,702	446,257	金属・鉱業
RAIA DROGASIL SA	234	206	1,333	37,908	食品・生活必需品小売り
TIM PARTICIPACOES SA	950	763	906	25,761	無線通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	194.5	238.5	800	22,754	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	294	198	621	17,674	電力
BANCO DO BRASIL SA	907	847	3,997	113,618	銀行
INVESTIMENTOS ITAU SA	4,166.86	4,323.6	4,959	140,939	銀行
LOJAS AMERICANAS SA	744.74	770.74	1,153	32,769	複合小売り
GERDAU SA	1,022.3	1,010.3	1,513	43,011	金属・鉱業
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	170.06	158.06	1,446	41,102	食品・生活必需品小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	3,075.1	2,782.1	8,396	238,625	石油・ガス・消耗燃料
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	-	328	729	20,740	専門小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	4,104.12	3,774.12	10,095	286,921	石油・ガス・消耗燃料
KROTON EDUCACIONAL SA	1,482.68	1,373.68	1,344	38,220	各種消費者サービス
CCR SA	1,328.2	1,214.2	1,404	39,925	運送インフラ
WEG SA	564.4	900.72	1,667	47,382	機械
BANCO BRADESCO SA PREF	3,513.25	3,505.5	12,016	341,518	銀行
BANCO BRADESCO SA	1,079.18	997.41	3,000	85,265	銀行
NATURA COSMETICOS SA	194	198	902	25,659	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	616.06	617.06	947	26,919	金属・鉱業
SUZANO SA	470	523.75	2,163	61,474	紙製品・林産品
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3,386.98	4,639.47	15,027	427,074	銀行
PORTO SEGURO SA	126	88	496	14,107	保険
FIBRIA CELULOSE SA	246.9	-	-	-	紙製品・林産品
B2W CIA DIGITAL	-	162	587	16,703	インターネット販売・通信販売
BRASKEM SA	170.3	157.3	768	21,847	化学
ENGIE BRASIL SA	173.7	211.87	896	25,476	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LOCALIZA RENT A CAR	511.8	584.8	1,899	53,981	陸運・鉄道
TELEFONICA BRASIL S.A.	472.28	434.28	2,019	57,391	各種電気通信サービス
LOJAS RENNNER SA	772.7	713.7	2,918	82,938	複合小売り
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	318.64	-	-	-	電力
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	381.52	358.52	1,594	45,311	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	165	162	726	20,649	石油・ガス・消耗燃料
EQUATORIAL ENERGIA SA	224	177	1,382	39,286	電力
EMBRAER SA	670.6	656.6	1,249	35,511	航空宇宙・防衛
M DIAS BRANCO SA	104	104	419	11,926	食品
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	250	-	-	-	電力
ODONTOPREV SA	322	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ブラジル)</b>	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	855.65	765.65	927	26,351	不動産管理・開発
JBS SA	899	900	1,719	48,853	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	962.49	794.49	1,094	31,114	電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	346.98	338.98	1,383	39,305	水道
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	103.8	344.4	768	21,826	不動産管理・開発
SUL AMERICA SA	178.69	178.69	561	15,946	保険
HYPERA SA	350	365	916	26,036	医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	2,181.16	1,987.16	6,180	175,637	資本市場
MAGAZINE LUIZA SA	-	75	1,198	34,065	複合小売り
QUALICORP SA	220	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL SA	408	408	1,793	50,984	銀行
CIELO SA	1,293.07	1,113.07	990	28,153	情報技術サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	740	689	1,918	54,514	保険
ITAUSA - INVESTIMENTOS ITAU SA-RCT	76.42	-	-	-	銀行
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	445	373	742	21,095	食品・生活必需品小売り
AMBEV SA	4,941.95	4,481.95	7,641	217,177	飲料
KLABIN SA	643	648	1,071	30,460	容器・包装
RUMO SA	1,082	1,080	1,901	54,051	陸運・鉄道
IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	-	137	1,301	36,988	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	52,917.21 54銘柄	51,338.8 52銘柄	138,540 -	3,937,324 <6.4%>
<b>(チェコ)</b>	百株	百株	千チェコ・コルナ	千円	
KOMERCNI BANKA AS	71	71.13	6,440	31,753	銀行
O2 CZECH REPUBLIC AS	56.77	-	-	-	各種電気通信サービス
CEZ	179.78	150.14	8,092	39,896	電力
MONETA MONEY BANK AS	572.58	551.83	4,403	21,709	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	880.13 4銘柄	773.1 3銘柄	18,936 -	93,359 <0.2%>
<b>(韓国)</b>	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
CHEIL WORLDWIDE INC	70.97	75.51	189,152	18,707	メディア
HANMI SCIENCE CO LTD	11.64	11.87	89,499	8,851	医薬品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	41	31.24	261,478	25,860	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	32.87	29.4	873,180	86,357	保険
DB INSURANCE CO LTD	50.6	48.71	336,586	33,288	保険
WOONGJIN COWAY CO LTD	52.8	50.7	475,059	46,983	家庭用耐久財
KT&G CORP	123.85	113.07	1,158,967	114,621	タバコ
S-1 CORPORATION	21.26	14.44	144,111	14,252	商業サービス・用品
KOREA GAS CORP	29.97	24.69	113,327	11,208	ガス
CJ CORP	15.47	16.95	216,960	21,457	コンビニ・コンビニ
KAKAO CORP	48.77	48.62	571,285	56,500	インタラクティブ・メディアおよびサービス
CJ ENM CO LTD	-	9.87	218,916	21,650	インターネット販売・通信販売
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	-	26.34	78,493	7,762	機械
SK TELECOM CO LTD	20.3	18.59	460,102	45,504	無線通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO	29.87	26.49	258,277	25,543	建設・土木
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	406.12	403.22	324,188	32,062	資本市場
NCSOFT CORPORATION	18.7	16.88	844,000	83,471	娯楽
LG UPLUS CORP	-	96.56	141,460	13,990	各種電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	40.5	-	-	-	電気設備
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	135.4	135.4	69,189	6,842	建設・土木
POSCO INTERNATIONAL CORP	36	36	65,340	6,462	商社・流通業
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	10.15	8.96	1,278,592	126,452	パーソナル用品
LG CHEM LTD	49.4	43.91	1,629,061	161,114	化学
LG CHEM LTD	6.41	7.26	152,460	15,078	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	1.77	2.01	168,237	16,638	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	450.23	407.81	1,857,574	183,714	銀行
HDC HOLDINGS CO LTD	59.1	-	-	-	建設・土木
S-OIL CORP	43.83	43.83	416,823	41,223	石油・ガス・消耗燃料



銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	77.71	82.89	187,331	18,527	化学
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	66	59.97	224,887	22,241	資本市場
POSCO CHEMICAL CO LTD	-	21.26	131,812	13,036	建設資材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	16.65	16.77	481,299	47,600	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	29.55	28.26	289,665	28,647	専門小売り
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	36.2	38.44	472,812	46,761	機械
HYUNDAI MOBIS	71.83	64.84	1,488,078	147,170	自動車部品
SK HYNIX INC	612.13	554.2	4,444,684	439,579	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	79.26	74.08	393,364	38,903	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	19.97	19.54	147,527	14,590	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	163.75	135.32	1,772,692	175,319	自動車
HYUNDAI STEEL CO	80.09	71.94	348,189	34,435	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	250.79	226.06	331,177	32,753	銀行
KCC CORP	6.7	5.54	193,069	19,094	建設関連製品
KIA MOTORS CORP	280.9	251.7	1,064,691	105,297	自動車
KOREA ZINC CO LTD	8.27	8.38	388,832	38,455	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	274.52	247.64	715,679	70,780	電力
HANWHA CORP	37.85	37.85	119,795	11,847	コングロマリット
KOREAN AIR CO LTD	53.01	43.87	157,493	15,576	旅客航空輸送業
OCI COMPANY LTD	18.29	18.29	175,401	17,347	化学
CJ LOGISTICS	8.6	8.6	140,610	13,906	陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	19.3	15.09	143,204	14,162	化学
KT CORP	20.48	20.48	55,910	5,529	各種電気通信サービス
HLB INC	-	29.94	254,190	25,139	レジャー用品
LG ELECTRONICS INC	113.15	102.93	781,238	77,264	家庭用耐久財
LOTTE CORP	33.66	28.1	145,277	14,367	コングロマリット
HANSSEM CO LTD	11	-	-	-	家庭用耐久財
LG CORP	102.15	92.19	690,503	68,290	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	170.37	133.62	194,417	19,227	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	54.9	60.04	240,160	23,751	建設・土木
NAVER CORP	29.52	133.74	1,598,193	158,061	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	11.87	12.49	123,651	12,229	複合小売り
DONGSUH CO INC	27.98	-	-	-	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	40.61	42.91	310,668	30,725	資本市場
OTTOGI CORP	1.12	1.12	82,208	8,130	食品
AMOREPACIFIC GROUP	28.91	27.61	225,573	22,309	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	120.47	106.55	346,287	34,247	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	78.3	74.46	2,021,589	199,935	金属・鉱業
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	-	144.49	239,130	23,650	建設・土木
SAMSUNG SDI CO LTD	58.31	52.65	1,213,582	120,023	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	60.07	54.55	640,962	63,391	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	101.45	4,532.55	21,325,647	2,109,106	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	299.01	391.72	341,971	33,820	機械
HANWHA AEROSPACE CO LTD	31.41	-	-	-	航空宇宙・防衛
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	18.33	782.05	2,967,879	293,523	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	8.27	6.46	203,490	20,125	複合小売り
HYOSUNG CORP	21.65	-	-	-	コングロマリット
YUHAN CORP	10.37	9.51	237,750	23,513	医薬品
HANON SYSTEMS	190.93	171.56	213,592	21,124	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	64.8	56.67	219,879	21,746	保険
GS HOLDINGS CORP	52.69	47.51	253,228	25,044	石油・ガス・消耗燃料
LG DISPLAY CO LTD	250.72	228.49	495,823	49,036	電子装置・機器・部品
SK NETWORKS CO LTD	148.1	-	-	-	商社・流通業
CELLTRION INC	85.57	79.64	1,660,494	164,222	バイオテクノロジー
VIROMED CO LTD	-	11.9	317,135	31,364	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL GROUP	313.14	289.14	1,113,189	110,094	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	20.57	18	255,600	25,278	航空貨物・物流サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
<b>(韓国)</b>	百株	百株	千韓国・ウォン	千円			
CELLTRION PHARM INC	—	14.57	84,360	8,343			医薬品
LOTTE SHOPPING CO	12.27	10.03	183,047	18,103			複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	74.58	67.76	581,380	57,498			保険
AMOREPACIFIC CORP	34.95	31.23	724,536	71,656			パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	7.52	8.48	109,392	10,818			パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	28.77	28.77	101,701	10,058			消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	67.27	61.75	1,185,600	117,255			石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	8.7	8.58	274,989	27,196			食品
STX PAN OCEAN CO LTD	183.95	183.95	80,570	7,968			海運業
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	18.25	—	—	—			商業サービス・用品
LG INNOTEK CO LTD	14.4	14.4	186,480	18,442			電子装置・機器・部品
SK HOLDINGS CO LTD	34.4	30.8	828,520	81,940			コンプロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	419.35	380.76	1,757,207	173,787			銀行
MEDY-TOX INC	4.64	4.21	256,894	25,406			バイオテクノロジー
HYUNDAI WIA CORP	14.54	—	—	—			自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	68.72	66.02	243,283	24,060			航空宇宙・防衛
BNK FINANCIAL GROUP INC	300.24	249.23	181,439	17,944			銀行
HANMI PHARM CO LTD	6.9	6.53	281,116	27,802			医薬品
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	264.3	284.68	114,441	11,318			保険
FILA KOREA LTD	—	43.1	335,318	33,162			繊維・アパレル・贅沢品
CJ E&M CORP	19.5	—	—	—			メディア
E-MART CO LTD	22.47	18.78	333,345	32,967			食品・生活必需品小売り
DGB FINANCIAL GROUP INC	185.75	163.21	140,197	13,865			銀行
GS RETAIL CO LTD	24.82	24.82	101,141	10,002			食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	75.17	65.9	265,906	26,298			自動車部品
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	—	24.82	116,778	11,549			建設・土木
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	9.78	8.63	299,029	29,574			機械
BGF RETAIL CO LTD	8.54	6.31	146,392	14,478			食品・生活必需品小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	23.81	20.71	203,579	20,133			食品
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	37.35	27.63	96,290	9,523			保険
NETMARBLE CORP	27.66	22.91	310,430	30,701			娯楽
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD-RTS	123.01	—	—	—			機械
WOORI FINANCIAL GROUP INC	—	443.48	627,524	62,062			銀行
SAMSUNG SDS CO LTD	36.75	33.52	787,720	77,905			情報技術サービス
WOORI BANK	508.29	—	—	—			銀行
SAMSUNG C&T CORP	80.72	73.94	835,522	82,633			コンプロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	17.59	15.63	576,747	57,040			ライフサイエンス・ツール/サービス
PEARL ABBYSS CORP	—	5.34	100,071	9,897			娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	46.79	36.36	113,806	11,255			機械
SILLAJEN INC	53.78	53.19	344,671	34,087			バイオテクノロジー
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	34.9	44.6	317,106	31,361			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
小計	株数	株数	金額	金額			
	9,498.66	14,106.56	78,200,380	7,734,017			
	114銘柄	114銘柄	—	<12.6%>			
<b>(中国)</b>	百株	百株	千円	千円			
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	—	96	255	4,278			電気設備
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	—	263	180	3,019			コンピュータ・周辺機器
IFLYTEK CO LTD	—	64	223	3,749			ソフトウェア
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	—	23	209	3,515			医薬品
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	—	25	300	5,032			飲料
WULIANGYE YIBIN CO LTD	—	72	746	12,504			飲料
SUNING.COM CO LTD	—	295	411	6,902			専門小売り
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	799	318	5,343			電子装置・機器・部品
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	—	123	279	4,689			不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	—	57	327	5,489			家庭用耐久財
MIDEA GROUP CO LTD	—	80	424	7,106			家庭用耐久財
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	—	120	415	6,956			電子装置・機器・部品
PING AN BANK CO LTD	—	272	390	6,541			銀行

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	—	790	440	7,374	資本市場
CHINA VANKE CO LTD	—	137	424	7,113	不動産管理・開発
WEICHAI POWER CO LTD	—	299	417	6,995	機械
GF SECURITIES CO LTD	—	227	378	6,345	資本市場
BYD CO LTD	—	75	468	7,843	自動車
BANK OF SHANGHAI CO LTD	—	209	266	4,473	銀行
PETROCHINA CO LTD	—	328	251	4,221	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	—	755	453	7,604	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	—	825	320	5,364	銀行
BANK OF CHINA LTD	—	745	300	5,031	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	—	513	301	5,055	石油・ガス・消耗燃料
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	—	315	1,128	18,916	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	—	195	1,647	27,609	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD	—	274	557	9,336	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	—	367	437	7,325	銀行
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	—	733.2	486	8,159	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD	—	109	329	5,520	自動車
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	—	18	1,713	28,719	飲料
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	—	792	512	8,588	銀行
CITIC SECURITIES CO LTD	—	316	769	12,901	資本市場
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	—	109	408	6,850	保険
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	—	265	444	7,452	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DAQIN RAILWAY CO LTD	—	301	255	4,288	陸運・鉄道
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	—	608	266	4,463	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	—	616	407	6,834	建設・土木
HAITONG SECURITIES CO LTD	—	360	520	8,718	資本市場
HUAXIA BANK CO LTD	—	232	201	3,382	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	—	104	320	5,365	食品
BANK OF BEIJING CO LTD	—	428	277	4,648	銀行
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	—	292	223	3,748	金属・鉱業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	—	165	702	11,775	建設資材
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	—	228	414	6,943	資本市場
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	—	204	289	4,851	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD	—	847	794	13,315	機械
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	—	102	658	11,031	医薬品
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	—	274	323	5,414	建設・土木
HUATAI SECURITIES CO LTD	—	236	514	8,626	資本市場
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	—	211	276	4,636	機械
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	—	110	330	5,530	医薬品
FOUNDER SECURITIES CO LTD	—	310	242	4,068	資本市場
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	—	39	297	4,979	ホテル・レストラン・レジャー
AVIC CAPITAL CO LTD	—	498	322	5,408	各種金融サービス
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	—	1,512	559	9,376	建設・土木
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	—	954	578	9,689	建設・土木
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	—	237	224	3,757	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	—	99	209	3,515	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AECC AVIATION POWER CO LTD	—	95	250	4,200	航空宇宙・防衛
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	—	160	249	4,183	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	—	532	383	6,419	資本市場
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	—	64	209	3,517	医薬品
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	—	80	241	4,043	金属・鉱業
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	—	240	218	3,660	食品・生活必需品小売り
AISINO CORP	—	64	180	3,022	ソフトウェア
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	—	665	586	9,830	旅客航空輸送業
ZHANGZHOU PIENZHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	—	18	212	3,562	医薬品
HENG TONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	—	81	178	2,987	通信機器
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	—	513	323	5,416	独立系発電事業者・エネルギー販売業者

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
BANK OF JIANGSU CO LTD	—	324	242	4,067	銀行
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	—	248	291	4,879	資本市場
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	—	240	319	5,357	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,976.2 73銘柄	30,039	503,453	<0.8%>
(マレーシア)	百株	百株	千円	千円	
AMMB HOLDINGS BHD	1,902	1,345	597	16,153	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	434	375	395	10,691	食品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	4,847	4,651	2,348	63,533	銀行
DIGI.COM BHD	3,591	2,887	1,351	36,547	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	878.2	1,014.2	690	18,682	運送インフラ
RHB BANK BHD	680.8	777.8	450	12,181	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	700	632	625	16,907	コンピュータリット
TOP GLOVE CORP BHD	—	1,338	608	16,467	ヘルスケア機器・用品
GAMUDA BHD	1,946	1,946	599	16,212	建設・土木
GENTING BHD	2,482	2,117	1,428	38,653	ホテル・レストラン・レジャー
YTL CORP BHD	5,191.1	2,837.1	320	8,672	総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	202.56	202.56	384	10,410	銀行
HONG LEONG BANK BHD	630.08	624.08	1,248	33,762	銀行
IJM CORP BHD	3,455.6	2,303.6	511	13,833	建設・土木
IOI CORP BHD	2,402.13	1,872.13	842	22,788	食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	555	445	1,099	29,732	食品
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	—	128	444	12,028	飲料
MALAYAN BANKING BHD	4,437.75	3,662.75	3,296	89,169	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	861	884	353	9,564	銀行
MISC BHD	1,400.8	902.8	604	16,361	海運業
NESTLE MALAYSIA BHD	58	48	701	18,969	食品
PPB GROUP BHD	478	475.6	893	24,160	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	314	196	488	13,222	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	732	604	1,071	28,983	ガス
GENTING MALAYSIA BHD	3,019	2,986	919	24,877	ホテル・レストラン・レジャー
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	147	147	528	14,306	タバコ
TELEKOM MALAYSIA BHD	1,325	1,034	313	8,474	各種電気通信サービス
SP SETIA BHD	1,785	1,367	307	8,319	不動産管理・開発
TENAGA NASIONAL BHD	3,566.5	3,046.5	3,674	99,383	電力
UMW HOLDINGS BHD	390	—	—	—	自動車
QL RESOURCES BHD	—	538	370	10,012	食品
DIALOG GROUP BHD	3,298.44	3,205.44	1,000	27,052	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	3,038.3	2,762.3	6,242	168,867	銀行
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,487.8	—	—	—	総合公益事業
AIRASIA GROUP BHD	1,479	1,479	366	9,921	旅客航空輸送業
SIME DARBY BERHAD	2,327	2,296	514	13,911	コンピュータリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,454	1,171	553	14,982	ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD	2,697	2,746	1,134	30,677	無線通信サービス
MAXIS BHD	1,886	2,384	1,318	35,661	無線通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,362	2,331	2,079	56,243	化学
SAPURA ENERGY BHD	3,192	—	—	—	エネルギー設備・サービス
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,405	—	—	—	メディア
IHH HEALTHCARE BHD	2,117	2,137	1,181	31,966	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FGV HOLDINGS BHD	1,264	—	—	—	食品
WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,300	1,092	406	10,988	運送インフラ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	1,531	1,240	559	15,127	金属・鋳業
SIME DARBY PROPERTY BHD	2,327	2,327	255	6,923	不動産管理・開発
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,628	2,161	1,104	29,870	食品
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	1,745.48	1,745.48	228	6,185	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	85,950.54 46銘柄	70,464.34 44銘柄	44,415	1,201,450 <2.0%>

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
BIDVEST GROUP LTD	358.98	334.72	7,312	58,644	コングロマリット
CLICKS GROUP LTD	-	224.23	4,127	33,101	食品・生活必需品小売り
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	443.26	453.11	3,274	26,258	専門小売り
DISCOVERY LTD	352.4	358.24	5,261	42,194	保険
REDEFINE PROPERTIES LTD	5,100	5,458.11	5,436	43,598	エクイティ不動産投資信託 (REITs)
GOLD FIELDS LTD	972.28	699.36	3,746	30,046	金属・鉱業
REMGRO LTD	563.29	506.21	9,895	79,365	各種金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	220	198.73	3,606	28,927	専門小売り
MMI HOLDINGS LTD	1,114.71	808.77	1,429	11,461	保険
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	3,222.27	2,898.26	7,144	57,296	エクイティ不動産投資信託 (REITs)
EXXARO RESOURCES LTD	253.4	248.46	4,186	33,576	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	38.5	37.04	5,218	41,855	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	151.37	114.38	1,189	9,540	保険
MTN GROUP LTD	1,784.39	1,626.78	16,677	133,755	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	477.74	405.22	7,308	58,614	金属・鉱業
TELKOM SA SOC LTD	315.88	220.8	1,851	14,848	各種電気通信サービス
FIRSTRAND LTD	3,533.55	3,195.17	21,554	172,868	各種金融サービス
PSG GROUP LTD	155.46	149.38	4,075	32,682	各種金融サービス
NASPERS LTD	460.1	416.43	150,750	1,209,016	インターネット販売・通信販売
CORONATION FUND MANAGERS LTD	267	-	-	-	資本市場
NEDBANK GROUP LTD	220.7	387.61	10,486	84,097	銀行
NETCARE LTD	1,067.07	1,054.65	2,539	20,367	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PICK'N PAY STORES LTD	433.75	312.55	2,306	18,496	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	706.97	611.74	5,040	40,426	各種金融サービス
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	62	50.42	3,781	30,327	金属・鉱業
SAPPI LTD	562.31	538.82	3,544	28,430	紙製品・林産品
SASOL LTD	584.19	537.28	25,489	204,422	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	469.66	433.8	7,755	62,195	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	259.11	234.11	4,891	39,233	専門小売り
BRAIT SE	370.6	-	-	-	資本市場
STANDARD BANK GROUP LTD	1,355.46	1,235.96	24,756	198,545	銀行
SPAR GROUP LTD/THE	218.08	200.38	4,117	33,024	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	991.54	880.09	4,121	33,054	複合小売り
IMPERIAL HOLDINGS LTD	167.74	-	-	-	販売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	411.88	345.76	3,664	29,388	医薬品
ABSA GROUP LTD	758.62	698.64	11,385	91,313	銀行
TIGER BRANDS LTD	162.62	159.65	4,240	34,009	食品
SANLAM LTD	1,486.83	1,713.29	13,603	109,100	保険
INVESTEC LTD	293.12	295.37	2,779	22,291	資本市場
KUMBA IRON ORE LTD	53.27	53.27	2,410	19,330	金属・鉱業
PIONEER FOODS LTD	155	-	-	-	食品
MONDI LTD	115.2	108.66	3,383	27,138	紙製品・林産品
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	1,358.45	1,371.82	3,841	30,805	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
RMI HOLDINGS	638.4	555.7	1,992	15,977	保険
VODACOM GROUP PTY LTD	640.73	626.12	7,500	60,152	無線通信サービス
SIBANYE GOLD LTD	1,720	-	-	-	金属・鉱業
NEPI ROCKCASTLE PLC	375.46	329.83	3,928	31,510	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	-	4,758.87	11,107	89,079	保険
REINET INVESTMENTS SCA	-	139.93	3,208	25,732	資本市場
MULTICHOICE GROUP LTD	-	407.24	5,161	41,397	メディア
FORTRESS REIT LTD-A	1,029.5	1,029.5	1,975	15,844	エクイティ不動産投資信託 (REITs)
FORTRESS REIT LTD-B	953.02	-	-	-	総合公益事業
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	2,678.66	-	-	-	家庭用耐久財
BID CORP LTD	356.89	323.21	9,772	78,373	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	株数	452,832	3,631,720	
	銘柄数<比率>	銘柄	-	<5.9%>	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL	277	220	4,862	17,114	銀行
BERLI JUCKER PCL NVDR	1,355	1,236	6,365	22,406	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	3,480	3,480	6,716	23,641	銀行
ROBINSON PCL-NVDR	643	388	2,250	7,921	複合小売り
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	1,927	1,739	22,520	79,270	銀行
TRUE CORP PCL NVDR	10,307.55	10,747.55	5,588	19,672	各種電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL NVDR	712	621	11,892	41,860	銀行
TMB BANK PCL -NVDR	10,100	10,100	2,100	7,394	銀行
IRPC PCL NVDR	10,655	10,609	6,047	21,285	石油・ガス・消耗燃料
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	2,559	1,720	2,769	9,747	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	131	131	3,812	13,418	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	2,932	3,115	7,943	27,960	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL	1,113	1,019	19,615	69,047	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	3,587.2	3,805.2	5,860	20,627	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	442	442	3,458	12,174	電子装置・機器・部品
PTT PCL	1,094	9,960	48,306	170,037	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	2,613	1,626	3,040	10,702	食品
LAND AND HOUSES PCL NVDR	-	2,639	2,850	10,032	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL NVDR	116.5	338.5	15,638	55,048	建設資材
KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	249	-	-	-	電子装置・機器・部品
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	4,556	4,064	27,838	97,991	運送インフラ
SIAM CEMENT PCL FOREIGN	295	-	-	-	建設資材
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	1,231	1,076	20,605	72,531	銀行
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	1,390	1,192	9,089	31,993	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	4,114	3,813	9,627	33,889	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	389	324	5,783	20,357	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	2,368.1	2,276.1	8,535	30,044	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR	1,189	983	7,077	24,913	石油・ガス・消耗燃料
GLOW ENERGY PCL NVDR	540	540	4,927	17,344	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CP ALL PCL NVDR	5,231	4,812	37,172	130,847	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	5,448	5,313	6,163	21,694	陸運・鉄道
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	1,343.45	1,329.45	17,415	61,303	石油・ガス・消耗燃料
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	1,740.22	1,709.22	8,289	29,179	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,395.08	2,172.08	15,258	53,711	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	1,180	1,180	6,254	22,014	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	7,407	7,678	7,908	27,837	運送インフラ
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	-	342	3,420	12,038	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	-	594	3,059	10,768	消費者金融
小計	株数 95,110.1 銘柄数 <2.2%>	株数 103,334.1 銘柄数 <2.2%>	380,063	1,337,823	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
BANK MILLENNIUM SA	526.47	497.82	476	14,111	銀行
MBANK	15.95	13.83	609	18,065	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	25.96	25.96	168	4,998	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	141.9	142.94	1,532	45,387	金属・鉱業
BANK PEKAO SA	157.27	158.87	1,827	54,115	銀行
ORANGE POLSKA SA	586	586	288	8,557	各種電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	317.67	286.43	2,947	87,300	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA	1.3	1.31	1,120	33,195	繊維・アパレル・贅沢品
SANTANDER BANK POLSKA SA	38.88	35.15	1,411	41,812	銀行
CD PROJEKT RED SA	75.17	60.15	1,209	35,811	娯楽
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	997.25	845.54	3,355	99,378	銀行
CCC SA	33.09	27.63	645	19,134	繊維・アパレル・贅沢品
GRUPA LOTOS SA	94.8	93.85	808	23,934	石油・ガス・消耗燃料
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	1,671.92	1,650.76	1,020	30,217	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA	228.1	234.95	611	18,107	メディア
GRUPA AZOTY SA	38.53	-	-	-	化学

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			期		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	811	705.29	689	20,426	電力
TAURON POLSKA ENERGIA SA	893.18	—	—	—	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	651.15	538.42	2,304	68,257	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	61.7	53.8	323	9,585	金属・鉱業
ALIOR BANK SA	94.05	90.07	539	15,980	銀行
DINO POLSKA SA	60.68	47.09	582	17,239	食品・生活必需品小売り
PLAY COMMUNICATIONS SA	152.28	—	—	—	無線通信サービス
小計	株数 7,674.3	株数 6,095.86	外貨建金額 22,471	邦貨換算金額 665,616	
	銘柄数 23銘柄	銘柄数 20銘柄		<1.1%>	
(ハンガリー)	百株	百株	千ハンガリー・フォリント	千円	
RICHTER GEDEON NYRT	148.3	131.04	75,937	30,086	医薬品
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	337.62	349.34	114,793	45,481	石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT	255.55	214.83	281,856	111,671	銀行
小計	株数 741.47	株数 695.21	外貨建金額 472,587	邦貨換算金額 187,239	
	銘柄数 3銘柄	銘柄数 3銘柄		<0.3%>	
(ユーロ・ギリシャ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PIRAEUS BANK S.A	250	—	—	—	銀行
ALPHA BANK A.E.	1,540.71	1,257.32	182	23,030	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE	6,600.69	—	—	—	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.	52.17	40.89	77	9,838	建設資材
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	254.9	220.51	270	34,170	各種電気通信サービス
FF GROUP	31.3	31.3	7	950	繊維・アパレル・贅沢品
EUROBANK ERGASIAS	1,941	—	—	—	銀行
MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	—	58.47	124	15,739	石油・ガス・消耗燃料
OPAP SA	200	198.46	185	23,498	ホテル・レストラン・レジャー
JUMBO SA	104.2	115.02	185	23,498	専門小売り
小計	株数 10,974.97	株数 1,921.97	外貨建金額 1,033	邦貨換算金額 130,726	
	銘柄数 9銘柄	銘柄数 7銘柄		<0.2%>	
合計	株数 2,382,094.46	株数 2,324,818.12	外貨建金額 —	邦貨換算金額 58,119,723	
	銘柄数 837銘柄	銘柄数 963銘柄		<94.4%>	

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

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

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

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

## (2) 外国新株予約権証券

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			期		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	証券	証券	千タイ・バーツ	千円	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	—	59,033	67	238	
合計	証券数 —	証券数 59,033	外貨建金額 —	邦貨換算金額 238	
	銘柄数 —銘柄	銘柄数 1銘柄		<0.0%>	

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

### (3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		期末
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(トルコ) EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	千口 231.071	千口 -	千トルコ・リラ -	千円 -	千円 -
小計	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率
(メキシコ) FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D CEMEX SAB DE CV FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 203.9 1,546.875 322.6	千口 184.4 1,485.375 326.1	千メキシコ・ペソ 33,477 13,724 8,951	千円 199,193 81,662 53,261	千円 -
小計	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率
(南アフリカ) HYPROP INVESTMENTS LTD FORTRESS REIT LTD-B RESILIENT REIT LTD	千口 29.707 - 28.6	千口 22.174 57.784 28.6	千南アフリカ・ランド 1,646 606 1,605	千円 13,204 4,865 12,874	千円 -
小計	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率
合計	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率	口数・金額 銘柄・比率

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

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

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

### (4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当期		期末
		買建	売建	額
外国	MINI MSCI EMG MKT	百万円 2,724		百万円 -

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

### ■投資信託財産の構成

2019年4月18日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	率
株式	千円 58,119,723		94.2%
新株予約権証券	238		0.0
投資信託受益証券、投資証券	365,061		0.6
コール・ローン等、その他	3,232,502		5.2
投資信託財産総額	61,717,526		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、61,510,889千円、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4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.04円、1香港・ドル=14.28円、1台湾・ドル=3.63円、1イギリス・ポンド=146.09円、1トルコ・リラ=19.44円、1メキシコ・ペソ=5.95円、1フィリピン・ペソ=2.17円、100チリ・ペソ=16.93円、100コロンビア・ペソ=3.55円、1カタール・リアル=30.69円、1インド・ルピー=1.63円、1パキスタン・ルピー=0.80円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.55円、1ブラジル・レアル=28.42円、1チェコ・コルナ=4.93円、100韓国・ウォン=9.89円、1オフショア・人民元=16.76円、1マレーシア・リンギット=27.05円、1南アフリカ・ランド=8.02円、1タイ・バーツ=3.52円、1ポーランド・ズロチ=29.62円、100ハンガリー・フォリント=39.62円、1ユーロ=126.50円です。



■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年4月18日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	61,997,526,658円
コ ー ル ・ 口 ン 等	1,860,304,809
株 式(評価額)	58,119,723,394
新 株 予 約 権 証 券(評価額)	238,966
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	280,855,976
投 資 証 券(評価額)	84,206,023
未 収 入 金	395,867,286
未 収 配 当 金	106,206,557
差 入 委 託 証 拠 金	1,150,123,647
(B) 負 債	462,215,896
未 払 金	300,572,896
未 払 解 約 金	161,643,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	61,535,310,762
元 本	50,190,897,430
次 期 繰 越 損 益 金	11,344,413,332
(D) 受 益 権 総 口 数	50,190,897,430口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	12,260円

(注1) 期首元本額	54,278,179,845円	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,087,195円
追加設定元本額	37,610,929,316円	マネックス資産設計ファンド エボリューション	453,215,866円
一部解約元本額	41,698,211,731円	DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	322,361,801円
(注2) 期末における元本の内訳		DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	287,554,676円
DIAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>	4,469,397,794円	DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	570,061,430円
DIAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	497,639,634円	投資のソムリエ	7,790,159,816円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	3,316,467円	クルーズコントロール	1,134,187,407円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	11,116,546円	投資のソムリエ<DC年金>	794,559,986円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	13,466,899円	DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	247,104,657円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,486,742円	クルーズコントロール<DC年金>	794,812円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	30,019,978円	DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	18,102,848円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	17,894,922円	DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	56,295,543円
たわらノーロード 新興国株式	4,693,236,793円	投資のソムリエ<DC年金> リスク抑制型	186,431,702円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,745,232,327円	ダイナミック・ナビゲーション	1,713,505円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	295,037,515円	リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,843,208,568円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,803,077円	ワールドアセットバランス (基本コース)	1,641,892,969円
たわらノーロード バランス (標準型)	7,560,261円	ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	6,277,274,398円
たわらノーロード バランス (積極型)	15,098,973円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	2,640,706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)	175,580円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	2,310,127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)	10,838,161円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	1,309,203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)	32,241,674円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	4,477,478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)	22,721,778円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	274,183,673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)	56,609,773円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,252,317円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	127,493円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	596,693円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	509,106円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	596,693円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	376,542円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	596,693円
		エマージング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用)	2,882,007,336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)	5,109,239,057円
		DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	7,325,772,240円
		期末元本合計	50,190,897,430円

## ■損益の状況

当期 自2018年4月19日 至2019年4月18日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		1,399,686,680円
受 取 配 当 金		1,365,680,284
受 取 利 息		24,098,969
そ の 他 収 益		10,186,857
支 払 利 息		△279,430
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		△1,501,450,165
売 買 益		5,926,629,433
売 買 損		△7,428,079,598
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益		△375,977,187
取 引 益		674,386,014
取 引 損		△1,050,363,201
(D) そ の 他 費 用		△81,267,514
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)		△559,008,186
(F) 前 期 繰 越 損 益 金		12,165,560,917
(G) 解 約 差 損 益 金		△6,180,451,083
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金		5,918,311,684
(I) 合 計(E + F + G + H)		11,344,413,332
次 期 繰 越 損 益 金(I)		11,344,413,332

(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。