Asset Management One

運 用 報 告 書（全体版）

第10期<決算日2020年４月13日>

ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）

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、「ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）」は、2020年４月13日に第10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。

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	ＤＩＡＭ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（ＥＴＦ）、短期金融資産等に投資する場合もあります。
	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（最適化法）・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。
	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。
運用方法	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（ＥＴＦ）、短期金融資産等(*)に投資する場合もあります。 （*）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、資産価値下落時では基準価額の下落を一定水準（下値目安値(*)）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等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。	

<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	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率							
	円	円	%	%	%	%	%	%	%	百万円
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
10期（2020年 4 月13日）	10,067	0	2.5	19.7	3.4	12.3	－	－	0.1	205

（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）。

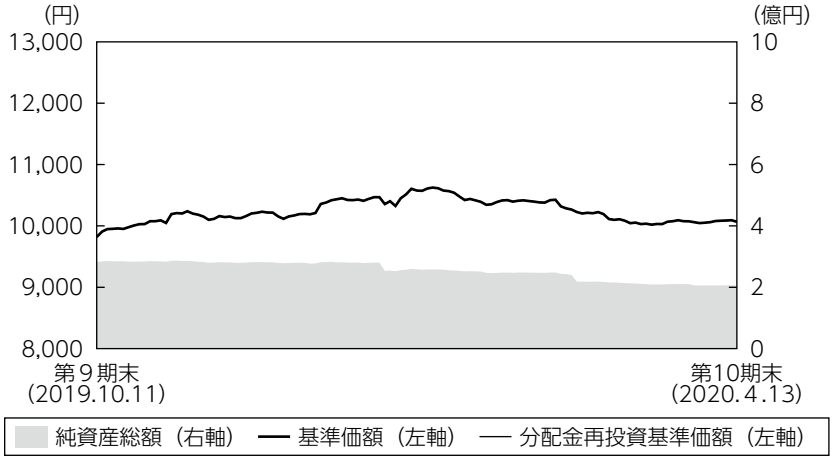
■当期中の基準価額の推移

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)組入比率	債券先物比率	投資信託受益証券、投資証券組入比率
		騰落率						
	円	%	%	%	%	%	%	%
(期　首) 2019　年　10　月　11　日	9,819	－	10.7	0.7	6.4	－	－	0.1
10　月　末	10,091	2.8	58.6	4.1	32.0	－	－	0.5
11　月　末	10,219	4.1	61.0	3.6	32.4	－	－	0.5
12　月　末	10,469	6.6	62.5	3.4	31.7	－	－	0.5
2020　年　1　月　末	10,393	5.8	29.7	2.2	14.2	－	－	0.3
2　月　末	10,227	4.2	10.0	0.8	6.5	－	－	0.1
3　月　末	10,075	2.6	4.9	0.8	4.0	－	－	0.0
(期　末) 2020　年　4　月　13　日	10,067	2.5	19.7	3.4	12.3	－	－	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10月12日から2020年４月13日まで）

基準価額等の推移



第10期首：　9,819円
第10期末：　10,067円
（既払分配金０円）
騰　落　率：　2.5%
（分配金再投資ベース）

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

基準価額の主な変動要因

株式市場は、米中貿易協議の進展期待から上昇傾向で推移していましたが、2020年に入ると、中国における新型コロナウイルス感染の広がりが警戒され、下落基調となりました。２月下旬以降は、欧米における新型コロナウイルスの感染拡大などを受け、国内外の金融市場が大きな混乱に見舞われたことから急落し、前期末比で株式市場は下落しました。基準価額の下落に応じて、合計資産比率を引き下げたことが奏功し、前期末比では基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内債券パッシブ・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	△10.6%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.3%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	△7.3%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	△4.5%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	△12.5%

投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇（価格は下落）しました。期初から2020年１月中旬にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きや、国内債券需給の緩みが意識されたことなどから、10年国債利回りは概ね上昇基調で推移しました。その後３月上旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念などを背景に上昇幅を縮小しました。３月中旬には、日本の大型経済対策に伴う国債増発懸念などを背景に利回りは上昇しました。

国内株式市場は期初から2020年１月前半にかけては、欧米中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し上昇しました。しかし、２月から３月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気や企業業績への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。期末にかけては、日銀のＥＴＦ（上場投資信託証券）購入や米国での大型経済対策の合意等を要因として小幅ながら上昇しました。

先進国債券市場では、米国債の利回りは低下（価格は上昇）、ドイツ債の利回りは上昇しました。米国債利回りは、米中貿易摩擦の激化やＦＲＢ（米連邦準備理事会）の政策金利の引き下げにより低下しましたが、期末にかけ新型肺炎の感染拡大による景気後退懸念と財政悪化懸念が高まったため、乱高下しました。ドイツ債利回りは、景気の減速やＥＣＢ（欧州中央銀行）の金融緩和により低下しましたが、期末にかけ新型肺炎の感染拡大に伴いユーロ圏各国が財政出動へ動くとの期待が高まったため、上昇しました。

米国株式市場は、米中貿易協議の進展期待から上昇傾向で推移していましたが、2020年に入ると、中東情勢の悪化懸念などから下落に転じ、更に中国における新型コロナウイルス感染の広がりが警戒され、下落基調となりました。２月下旬以降は、欧米における新型コロナウイルスの感染拡大などを受け、国内外の金融市場が大きな混乱に見舞われたことから急落し、前期末比で下落となりました。欧州株式市場もほぼ同様の動きとなり、各国市場は前期末比で概ね下落となりました。

新興国債券市場は大幅に下落しました。期首から2020年２月半ばにかけては、米中間の緊張緩和や米国の底堅い経済状況を背景に上昇しました。しかしその後は新型コロナウイルスの感染拡大により経済の急速な悪化が懸念されたことや、ＯＰＥＣ（石油輸出国機構）とロシアなど非加盟国との減産協議が決裂し原油価格が急落したことなどを背景に、流動性の低下を伴いながら市場は大幅に下落しました。米国長期金利は低下し、対米国債スプレッドは大幅に拡大しました。

新興国株式市場は前期末比で下落しました。期の前半は米中貿易摩擦の動向が注目され、通商協議の進展期待から堅調に推移しました。しかしながら、期末にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大によって長期的な景気低迷が意識されたことに加えて、ＯＰＥＣとロシアなど非加盟国との減産協議決裂により原油価格が下落したことなどから、投資家のリスク回避姿勢が強まり大幅な下落となりました。

為替市場では、2020年２月上旬までは、対米ドル、対ユーロでは、ボックス圏内の動きでした。しかし、２月下旬から世界的に新型コロナウイルスの感染が拡大し、世界景気悪化に対する懸念が高まったことなどから、リスク回避的な動きが強まり、円高が進みました。その後、長期金利の上昇に伴い円安が進む局面もありましたが、期末にかけて再び円高が進み、期を通して見ると、対米ドル、対ユーロで円高が進みました。

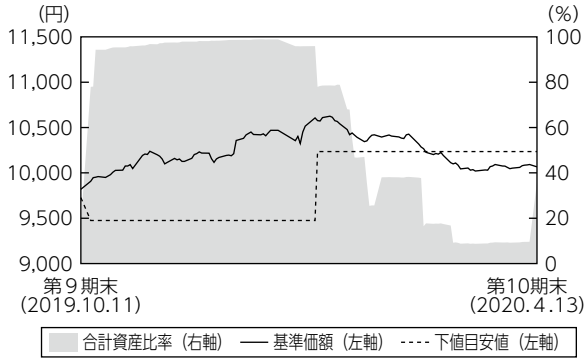
ポートフォリオについて

●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。１月上旬にかけて基準価額が上昇したため、合計資産比率を段階的に99％程度まで引き上げました。下値目安値変更後、合計資産比率を78％程度まで引き下げましたが、基準価額が下落したため、合計資産比率を９％程度まで引き下げ、期末頃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。

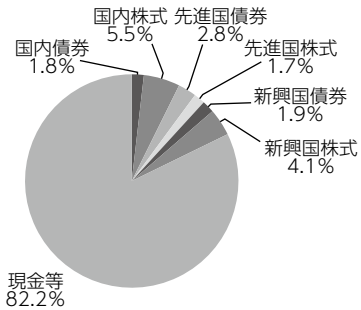
＜基準価額と合計資産比率の推移＞



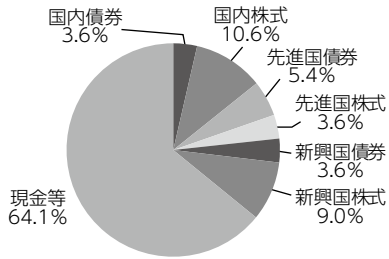
【運用状況】

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

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

●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した。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（１万口当たり）

項目	当期 2019年10月12日 ～2020年４月13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	776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、信託財産の成長を図ります。また、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したファンドパフォーマンスをめざします。

●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

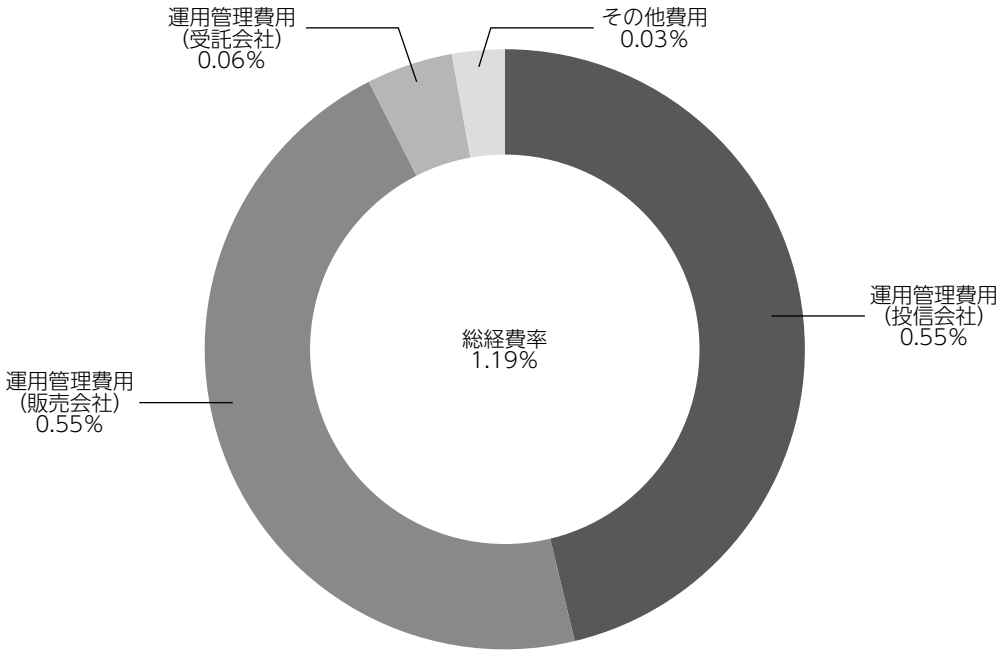
項目	第10期 (2019年10月12日 ～2020年４月13日)		項目の概要
	金額	比率	
(ａ) 信託報酬	60円	0.584%	(ａ) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,241円です。
(投信会社)	(28)	(0.278)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(28)	(0.278)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(3)	(0.028)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(ｂ) 売買委託手数料	1	0.006	(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)	(0.004)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(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	0.006	(ｃ) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.006)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(ｄ) その他費用	2	0.017	(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)	(0.014)	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)	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	63	0.612	

(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1.19％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10月12日から2020年４月13日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	22,271	29,500	20,486	27,080
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	35,856	89,800	32,268	85,400
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	23,237	44,000	21,607	41,380
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,403	30,400	7,500	29,900
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	14,690	29,700	13,440	28,280
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	70,916	76,600	62,146	74,680

■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	118,323,816千円	50,907,235千円	45,554,251千円
(b)期中の平均組入株式時価総額	235,867,788千円	322,781,389千円	39,231,519千円
(c)売買高比率(a)／(b)	0.50	0.15	1.16

(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10月12日から2020年４月13日まで）

【ＤＩＡＭ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】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	48,729	634	1.3	70,659	9,733	13.8

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					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	53,826	－	－	64,497	6	0.009

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		
	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	505	577	1,714

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	当期
	買付額
	百万円
株式	99

【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。

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

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

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	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,866	5,651	7,415
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	6,139	9,728	21,932
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,172	5,802	11,159
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,323	2,226	7,440
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2,583	3,833	7,416
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	10,606	19,375	18,529

■投資信託財産の構成

2020年４月13日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,415	3.6
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	21,932	10.6
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,159	5.4
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,440	3.6
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7,416	3.6
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	18,529	8.9
コール・ローン等、その他	133,569	64.4
投資信託財産総額	207,463	100.0

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

（注２）期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2020年４月13日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは115,189,424千円、98.1％、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは309,322,102千円、99.7％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは52,002,544千円、60.9％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは31,541,743千円、98.2％です。

（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年４月13日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝108.23円、１カナダ・ドル＝77.55円、１オーストラリア・ドル＝68.57円、１香港・ドル＝13.96円、１シンガポール・ドル＝76.41円、１ニュージーランド・ドル＝65.75円、１台湾・ドル＝3.60円、１イギリス・ポンド＝134.80円、１イスラエル・シュケル＝30.27円、１スイス・フラン＝112.02円、１トルコ・リラ＝16.11円、１デンマーク・クローネ＝15.84円、１ノルウェー・クローネ＝10.56円、１スウェーデン・クローナ＝10.88円、１メキシコ・ペソ＝4.62円、１フィリピン・ペソ＝2.14円、100チリ・ペソ＝12.91円、100コロンビア・ペソ＝2.82円、１カタール・リアル＝29.63円、１サウジアラビア・リアル＝28.84円、１インド・ルピー＝1.44円、１パキスタン・ルピー＝0.65円、100インドネシア・ルピア＝0.69円、１アラブ首長国連邦・ディルハム＝29.50円、１ブラジル・レアル＝21.18円、１チェコ・コルナ＝4.39円、100韓国・ウォン＝8.88円、１オフショア・人民元＝15.33円、１マレーシア・リンギット＝25.06円、１南アフリカ・ランド＝6.00円、１タイ・バーツ＝3.30円、１ポーランド・ズロチ＝25.99円、100ハンガリー・フォリント＝33.47円、１ユーロ＝118.27円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年４月13日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**207,463,930円**
コール・ローン等	133,569,220
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	7,415,508
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)	21,932,114
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	11,159,992
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	7,440,929
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	7,416,932
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	18,529,235
(B) 負債	**1,499,618**
未払信託報酬	1,494,435
その他未払費用	5,183
(C) 純資産総額(A－B)	**205,964,312**
元本	204,592,403
次期繰越損益金	1,371,909
(D) 受益権総口数	**204,592,403口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**10,067円**

(注) 期首における元本額は286,906,788円、当期中における追加設定元本額は3,492,125円、同解約元本額は85,806,510円です。

■損益の状況

当期　自2019年10月12日　至2020年４月13日

項目	当期
(A) 配当等収益	**△15,388円**
受取利息	1,292
支払利息	△16,680
(B) 有価証券売買損益	**6,462,535**
売買益	13,254,566
売買損	△6,792,031
(C) 信託報酬等	**△1,499,618**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**4,947,529**
(E) 前期繰越損益金	**△4,938,462**
(F) 追加信託差損益金	**1,362,842**
(配当等相当額)	(4,609,059)
(売買損益相当額)	(△3,246,217)
(G) 合計(D＋E＋F)	**1,371,909**
次期繰越損益金(G)	**1,371,909**
追加信託差損益金	1,362,842
(配当等相当額)	(4,610,237)
(売買損益相当額)	(△3,247,395)
分配準備積立金	11,271,271
繰越損益金	△11,262,204

(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	829,035円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	4,610,237
(d) 分配準備積立金	10,442,236
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	15,881,508
(f) １万口当たり当期分配対象額	776.25
(g) 分配金	0
(h) １万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきました。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日　2020年２月14日）

（計算期間　2019年２月15日～2020年２月14日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA－BPI総合 (ベンチマーク)		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
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
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
17期（2020年２月14日）	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	－	－	222,859

（注１）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
（注２）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません（以下同じ）。
（注３）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

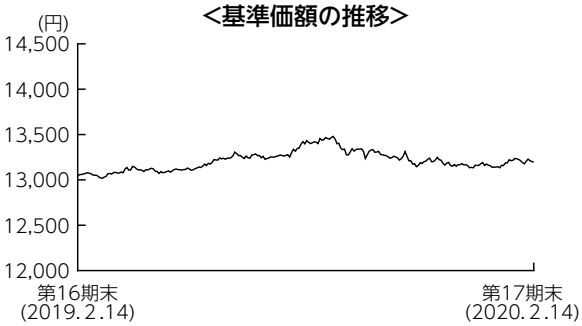
■当期中の基準価額と市況の推移

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

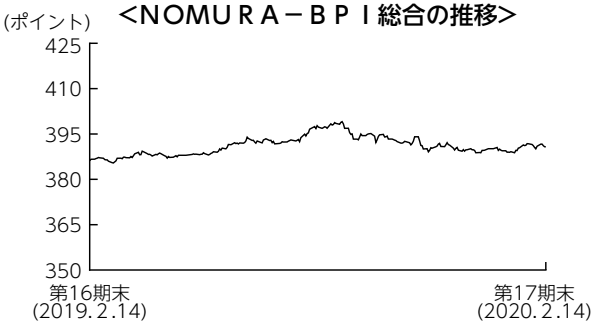
（注１）騰落率は期首比です。
（注２）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2019年２月15日から2020年２月14日まで）

<基準価額の推移>



<NOMURA－BPI総合の推移>



基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

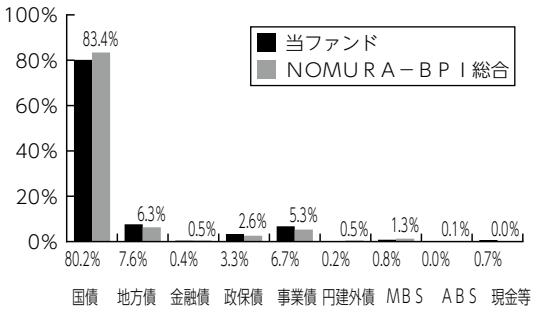
ポートフォリオについて

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

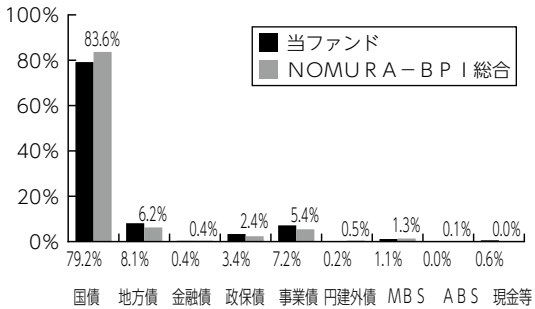
【運用状況】 （注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

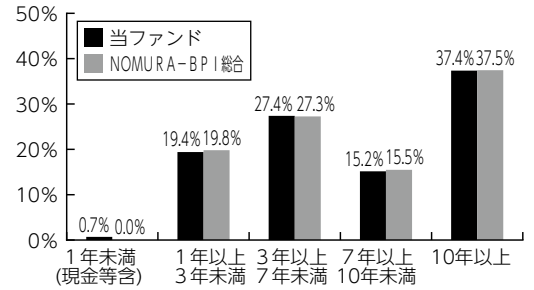


期末

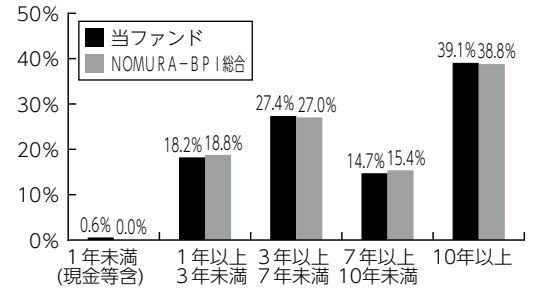


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA－BPI総合は、前期末比で1.2％上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で＋0.0％と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

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

■１万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■売買及び取引の状況（2019年２月15日から2020年２月14日まで）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	101,489,234	161,330,716 (－)
	地方債証券	1,154,420	5,193,999 (－)
	特殊債券	588,183	2,537,310 (190,215)
	社債券	821,439	5,064,157 (－)

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

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

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	104,053	8,065	7.8	174,126	18,207	10.5

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うち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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	159,940,000	176,414,100	79.2	－	56.3	15.5	7.3
地方債証券	17,450,000	18,054,906	8.1	6.7	2.4	4.1	1.6
特殊債券	14,698,867	15,758,836	7.1	－	4.4	2.2	0.5
金融債券	800,000	800,829	0.4	－	－	0.0	0.3
普通社債券	10,181,000	10,545,134	4.7	0.1	1.1	3.1	0.5
合計	203,069,867	221,573,805	99.4	6.8	64.3	25.0	10.2

（注１）組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第２位を四捨五入しています。
（注２）無格付銘柄については、ＢＢ格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期末 利率	額面金額	評価額	償還年月日
（地方債証券）	%	千円	千円	
２５年度２回　横浜市公募公債	0.8880	400,000	411,976	2023/07/14
３７４回　大阪府公募公債	0.9380	300,000	309,600	2023/07/28
２５年度５回　千葉県公募公債	0.8400	200,000	205,852	2023/08/25
１２８回　共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	307,359	2023/11/24
７２６回　東京都公募公債	0.7300	400,000	411,076	2023/12/20
２５年度１１回　福岡県公募公債	0.6940	200,000	205,508	2024/02/26
２０８回　神奈川県公募公債	0.5510	300,000	307,050	2024/06/20
１回　兵庫県公募公債（１２年）	1.1000	300,000	314,259	2024/06/26
２６年度５回　埼玉県公募公債	0.6110	400,000	410,696	2024/07/29
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	0.5980	450,000	462,159	2024/09/20
２６年度１１回　京都府公募公債	0.4760	350,000	357,896	2024/12/19
１４２回　共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	508,275	2025/01/24
２６年度１７回　兵庫県公募公債	0.4600	200,000	204,372	2025/02/26
５回　東京都公募公債　２０年	2.1100	100,000	110,630	2025/03/19
１４４回　共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	409,184	2025/03/25
１４６回　共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	411,220	2025/05/23
１４８回　共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	514,485	2025/07/25
１回　静岡県公募公債　２０年	2.1800	100,000	112,072	2025/09/19
９回　東京都公募公債　２０年	2.4400	200,000	230,576	2026/06/19
１０回　東京都公募公債　２０年	2.3300	300,000	345,534	2026/09/18
４回　京都市公募公債　２０年	2.5100	100,000	116,363	2026/09/18
１６６回　共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	505,370	2027/01/25
２９年度４回　大阪市公募公債	0.1500	200,000	201,820	2027/09/21
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	0.2540	300,000	305,499	2028/09/20
第９１回　川崎市公募公債	0.1850	200,000	202,484	2028/09/20
３０年度１４回　北海道公募公債	0.1950	300,000	303,438	2028/12/28
３０年度１９回　愛知県公募公債	0.1150	200,000	200,996	2029/03/28
８回　静岡県公募公債　１５年	0.8280	200,000	214,750	2030/06/07
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	1.6350	300,000	353,565	2032/08/16
１４回　千葉県公募公債　２０年	1.1370	100,000	112,016	2033/04/15
１４回　埼玉県公募公債　２０年	1.5460	300,000	355,014	2034/05/08
１７回　北九州市公募公債　２０年	1.5290	100,000	118,039	2034/06/20
小計	－	17,450,000	18,054,906	－
（特殊債券）	%	千円	千円	
９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	100,000	102,181	2021/03/26
２４回　地方公共団体金融機構債券	1.2080	300,000	304,548	2021/05/28
１８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.2000	300,000	310,470	2021/08/30
１４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	400,000	407,636	2021/11/30
３６回　政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	306,246	2022/05/20
９６回　高速道路機構債	0.7960	700,000	714,196	2022/09/20
４４回　政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	410,020	2023/01/20
５５回　鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	512,865	2023/03/20
１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	509,015	2023/04/28
１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	515,305	2023/06/30
５０回　政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	515,975	2023/07/14
１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	340,688	2023/07/31
１１６回　高速道路機構債	0.7220	100,000	102,579	2023/09/20
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	558,444	2024/01/19

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

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

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

■投資信託財産の構成

2020年２月14日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	221,573,805	99.3
コール・ローン等、その他	1,482,460	0.7
投資信託財産総額	223,056,266	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年２月14日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**223,056,266,615円**
コール・ローン等	925,968,916
公社債(評価額)	221,573,805,885
未収利息	530,848,633
前払費用	25,643,181
(B) 負債	**196,906,000**
未払解約金	196,906,000
(C) 純資産総額(A－B)	**222,859,360,615**
元本	168,870,516,479
次期繰越損益金	53,988,844,136
(D) 受益権総口数	**168,870,516,479口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**13,197円**

(注１) 期首元本額 223,973,156,427円
追加設定元本額 120,614,812,838円
一部解約元本額 175,717,452,786円

(注２) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	21,184,712,153円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	69,986,260円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	68,506,951円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	18,787,911円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	987,848,234円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	253,839,832円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	25,260,802円
たわらノーロード　国内債券	10,015,397,101円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	644,889,238円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	198,546,011円
たわらノーロード　バランス（標準型）	329,055,628円
たわらノーロード　バランス（積極型）	41,366,056円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	14,261,260円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	422,619,412円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	415,409,126円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	104,078,457円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	8,657,075円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	5,579,866円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	8,704,630円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	9,632,593円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,871,083円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	243,993円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,054,492,139円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	6,915,364,061円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	9,496,684,077円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,799,837,596円
ＤＩＡＭ　ＤＣバランス30インデックスファンド	1,841,604,708円
ＤＩＡＭ　ＤＣバランス50インデックスファンド	2,047,028,967円
ＤＩＡＭ　ＤＣバランス70インデックスファンド	317,181,619円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	82,330,193円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	2,373,109,117円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	6,459,038円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国10）	3,565,751,861円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国20）	1,006,035,152円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国30）	214,761,880円
投資のソムリエ	6,982,653,969円
クルーズコントロール	1,214,453,782円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	663,342,952円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	3,041,421,611円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	354,073,730円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,228,781円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,760,959円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	7,262,628円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	522,448,330円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	5,526,677,877円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	4,843,326円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	3,778,447円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,877,007円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	9,781,550円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	191,589,421円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,735,395,954円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,293,364,512円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	723,181円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	610,771円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	708,717円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	498,022円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12（適格機関投資家限定）	1,002,734,258円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	10,109,222,296円
ＤＩＡＭワールドバランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	342,183,786円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	5,071,969,240円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドＩＩ（適格機関投資家限定）	5,050,603,156円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドＩＩＩ（適格機関投資家限定）	5,102,756,119円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドＩＶ（適格機関投資家限定）	5,076,506,178円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドＶ（適格機関投資家限定）	5,113,422,319円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	618,326,873円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド25ＶＡ	219,862,252円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド50ＶＡ	165,143,096円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド30ＶＡ	61,558,322円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド50ＶＡ	148,494,901円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド30ＶＡ	70,976,271円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド50ＶＡ	29,810,777円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定）	80,376,845円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	167,069,557円
ＤＩＡＭバランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,589,661,319円
ＤＩＡＭバランスファンド37.5ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,581,596,662円
ＤＩＡＭバランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,902,110,574円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ	528,103,309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）	243,077,089円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド30ＶＡ	2,833,060,371円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	252,830,217円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド55ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,003,137円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド35ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,261,134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）	2,634,815,087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）	74,826,164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）	541,115,349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）	933,900,682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）	2,409,352,967円
ＤＩＡＭ世界バランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	352,962,064円
ＤＩＡＭ国内バランス30ＶＡ（適格機関投資家限定）	110,662,909円
ＤＩＡＭバランス20ＶＡ（適格機関投資家限定）	256,171,767円
ＤＩＡＭバランス40ＶＡ（適格機関投資家限定）	739,037円
ＤＩＡＭバランス60ＶＡ（適格機関投資家限定）	410,778円
期末元本合計	168,870,516,479円

■損益の状況

当期　自2019年２月15日　至2020年２月14日

項目	当期
(A) 配当等収益	**2,279,859,711円**
受取利息	2,281,738,927
支払利息	△1,879,216
(B) 有価証券売買損益	**1,759,087,828**
売買益	3,410,195,048
売買損	△1,651,107,220
(C) 当期損益金(A＋B)	**4,038,947,539**
(D) 前期繰越損益金	**68,139,769,721**
(E) 解約差損益金	**△56,993,272,286**
(F) 追加信託差損益金	**38,803,399,162**
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	**53,988,844,136**
次期繰越損益金(G)	**53,988,844,136**

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日　2020年２月７日）

（計算期間　2019年２月８日～2020年２月７日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近５期の運用実績

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

（注１）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注２）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、株式会社東京証券取引所（㈱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、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱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、㈱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）。

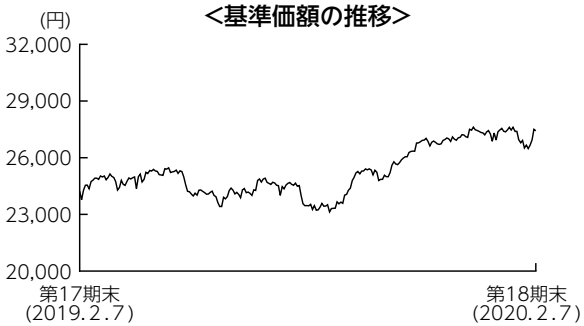
（注３）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

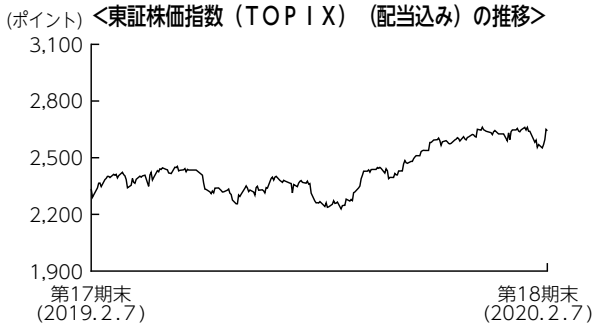
■当期中の基準価額と市況の推移

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

（注1）騰落率は期首比です。
（注2）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■**当期の運用経過**（2019年２月８日から2020年２月７日まで）





基準価額の推移

当期末の基準価額は27,423円となり、前期末比で13.2％上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種

期首（前期末）

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

期末

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

○組入上位10銘柄

期首（前期末）

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

期末

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で13.2％上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■１万口当たりの費用明細

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

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

■売買及び取引の状況（2019年２月８日から2020年２月７日まで）

(1) 株　式

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種　　類　　別		買　　建		売　　建	
		新規買付額	決　済　額	新規売付額	決　済　額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	106,543	104,700	－	－

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項　　目	当　　期
(a) 期中の株式売買金額	145,863,512千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	254,160,767千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.57

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年２月８日から2020年２月７日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	54,443	24	0.0	91,420	5,933	6.5

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	497	856	2,492

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	当期
	買付額
	百万円
株式	98

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	4,389千円
うち利害関係人への支払額（B）	17千円
（B）／（A）	0.4%

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	5.4	5.1	14,728
日本水産	166.5	146.5	89,218
マルハニチロ	24.1	21.2	55,035
カネコ種苗	4.6	4.5	5,998
サカタのタネ	20.2	17.4	60,639
ホクト	14	11.2	22,512
ホクリヨウ	2.3	2.3	1,805
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	35.9	30.1	4,244
日鉄鉱業	3.9	3.4	15,249
三井松島ホールディングス	6.9	5.7	6,606
国際石油開発帝石	668.6	587.5	633,031
石油資源開発	24	19.2	53,836
K&Oエナジーグループ	8	7.1	11,892
建設業（2.8%）			
ヒノキヤグループ	3.5	3.7	7,588
ショーボンドホールディングス	11.9	22.7	105,668
ミライト・ホールディングス	46.9	43.6	72,070
タマホーム	10.3	6.9	9,942
サンヨーホームズ	2.5	1.2	853
日本アクア	4.1	5.8	3,584
ファーストコーポレーション	4.6	4.5	2,691
ベステラ	3.2	2.5	2,920
ＴＡＴＥＲＵ	20.2	30.3	6,393
スペースバリューホールディングス	20.3	17.8	10,021
ダイセキ環境ソリューション	3.2	2.9	3,285
第一カッター興業	1.9	1.8	3,211
安藤・間	106.4	87.2	80,834
東急建設	48.8	42.9	33,933
コムシスホールディングス	59.1	51.9	165,042
ミサワホーム	13.1	－	－
ビーアールホールディングス	13.8	16	7,600
高松コンストラクショングループ	10.3	9.1	24,670
東建コーポレーション	5.1	4.5	35,100
ソネック	1.8	1.5	1,210
ヤマウラ	6.5	6.4	6,163
大成建設	136.8	112.8	503,652
大林組	412.3	338.1	428,034
清水建設	420.5	343.2	399,828
飛島建設	11.8	9.7	14,006
長谷工コーポレーション	171.9	130.9	195,564
松井建設	15.2	13.4	10,465
錢高組	1.8	1.4	5,635
鹿島建設	322.2	265.5	385,240
不動テトラ	9.4	8.9	15,290
大末建設	4.9	4	3,996
鉄建建設	8.3	7.3	20,564
西松建設	29.6	26	66,846
三井住友建設	99.1	81.7	52,778
大豊建設	9.3	7.6	21,150
前田建設工業	98.1	84.7	92,746
佐田建設	8.8	7.4	3,233
ナカノフドー建設	10.5	9.3	4,566
奥村組	22.6	18.4	53,433
東鉄工業	16.5	14.5	47,632
イチケン	2.6	2.4	4,336
富士ピー・エス	4.3	5	2,925
淺沼組	4.9	3.8	19,570
戸田建設	159.8	140.3	105,786
熊谷組	19.6	15.7	51,888
青木あすなろ建設	6.8	－	－
北野建設	2.9	2	5,090
植木組	1.8	1.5	3,957
矢作建設工業	18.8	14.9	12,814
ピーエス三菱	14.5	11.1	8,347
日本ハウスホールディングス	26.2	23.2	10,973
大東建託	49	40.5	524,880
新日本建設	16.4	14.4	13,392
ＮＩＰＰＯ	36.4	27.9	76,473
東亜道路工業	2.6	2.1	7,539
前田道路	43.1	35.8	132,281
日本道路	3.8	3.3	25,080
東亜建設工業	12.1	10.5	18,417
日本国土開発	－	19.8	12,137
若築建設	6.9	6.1	10,174
東洋建設	50.3	37.9	19,897
五洋建設	163.3	134	92,460
世紀東急工業	20.1	16.2	14,985
福田組	4.5	3.9	19,695
住友林業	97.5	85.7	141,319
日本基礎技術	14.4	11.4	4,582
巴コーポレーション	17.1	15.2	6,460
大和ハウス工業	380.8	334.5	1,204,200
ライト工業	26.4	19.4	30,458
積水ハウス	420.8	369.9	903,295
日特建設	11.8	8.9	7,698
北陸電気工事	6.7	5.8	6,722
ユアテック	22.1	19.4	13,153
四電工	2	1.7	4,610
中電工	17.6	13.7	35,072
関電工	62.6	48.1	50,697
きんでん	91.5	80.4	150,508
東京エネシス	14.2	11.2	10,057
トーエネック	3.8	3.4	12,750
住友電設	9.5	9.6	24,240
日本電設工業	23.5	18.6	44,007
協和エクシオ	53.8	51.3	144,153
新日本空調	11.7	9	19,260
九電工	27	23.8	76,993
三機工業	31.6	24.4	36,746
日揮ホールディングス	118.4	104.1	162,396
中外炉工業	3.9	3.7	6,352
ヤマト	12.4	10.8	8,953
太平電業	9.3	8.2	19,852
高砂熱学工業	34.6	29.4	57,947
三晃金属工業	1.5	1.4	3,733
朝日工業社	2.7	2.2	7,645
明星工業	24.9	21.8	18,355
大氣社	18.8	16.4	65,108
ダイダン	9.2	8.1	24,210
日比谷総合設備	13.1	10.9	21,255
東芝プラントシステム	29.7	－	－
フィル・カンパニー	－	1.4	5,607
ＯＳＪＢホールディングス	60.8	53.1	15,186
東洋エンジニアリング	16.2	14.2	8,406
千代田化工建設	99.1	－	－
レイズネクスト	24.7	18.2	25,534
食料品（3.8%）			
日本製粉	40.9	31.6	53,909
日清製粉グループ本社	139.1	122.3	236,283
日東富士製粉	0.8	0.7	4,410
昭和産業	11.4	10	31,150
鳥越製粉	11.1	9.7	8,099
中部飼料	15	13.3	22,889
フィード・ワン	83	72.9	13,632
東洋精糖	2.1	1.7	2,031
日本甜菜製糖	7	5.7	11,126
三井製糖	9.7	9.5	20,995
塩水港精糖	14.4	11.3	2,610
日新製糖	5.8	5.1	10,449
森永製菓	31	25.4	137,414
中村屋	3	2.8	11,424
江崎グリコ	36.9	32.1	157,290
名糖産業	5.9	5.2	7,342
井村屋グループ	5.2	4.6	8,960
不二家	6.9	6	13,728
山崎製パン	100.8	81.2	170,601
第一屋製パン	2.1	1.8	1,683
モロゾフ	2	1.8	9,090
亀田製菓	7.6	6.2	31,682
寿スピリッツ	13	10.4	71,968
カルビー	56.1	49.4	160,797
森永乳業	24.6	20	90,600
六甲バター	9	7.1	11,715
ヤクルト本社	91.3	74.5	427,630
明治ホールディングス	87.2	71.6	529,840
雪印メグミルク	29.6	26.1	68,042
プリマハム	17.3	16.9	45,139
日本ハム	53.2	41.4	198,099
林兼産業	4.3	3.7	2,660
丸大食品	13.3	11.6	25,566
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	11.1	8.7	23,298
柿安本店	－	3.8	12,369
伊藤ハム米久ホールディングス	79.3	69.8	49,627
サッポロホールディングス	45.1	36.9	99,740
アサヒグループホールディングス	257.9	226.6	1,158,379
キリンホールディングス	557.2	459	1,147,041
宝ホールディングス	92.2	81	81,486
オエノンホールディングス	35.2	28.7	11,307
養命酒製造	3.9	3.4	6,742
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	94.3	76	228,760
サントリー食品インターナショナル	82.4	72.4	341,728
ダイドーグループホールディングス	6.9	5.6	23,184
伊藤園	37.4	32.8	178,760
キーコーヒー	12.2	10.7	24,556
ユニカフェ	3.9	2.9	2,810
ジャパンフーズ	1.8	1.5	1,885
日清オイリオグループ	15.9	14	53,060
不二製油グループ本社	30.1	26.4	76,586
かどや製油	1.3	1.1	4,295
Ｊ－オイルミルズ	6.4	5.6	24,584
キッコーマン	81.3	77.9	444,809
味の素	271.9	239	467,603
キユーピー	68.6	60.3	135,916
ハウス食品グループ本社	47	40.5	147,825
カゴメ	49.4	41.1	117,217
焼津水産化学工業	6.1	5.3	5,469
アリアケジャパン	11.3	9.9	71,874
ピエトロ	1.6	1.4	2,298
エバラ食品工業	2.6	2.5	5,450
やまみ	－	0.5	1,077
ニチレイ	64	51.5	144,303
東洋水産	63.3	55.7	265,967
イートアンド	4.3	3.8	7,227
大冷	1.5	1.4	2,777
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3.3	5.9	7,085
日清食品ホールディングス	52.4	46	421,820
永谷園ホールディングス	6.6	5.3	11,649

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
一正蒲鉾	4.9	4	3,936
フジッコ	13.4	11.7	23,013
ロック・フィールド	13.4	11.7	17,386
日本たばこ産業	711.1	624.9	1,437,894
ケンコーマヨネーズ	6.9	6.1	15,213
わらべや日洋ホールディングス	8	7.1	13,837
なとり	6.9	6.1	10,620
イフジ産業	2.1	1.9	1,442
ピックルスコーポレーション	3	2.3	6,497
北の達人コーポレーション	48.4	37.7	24,391
ユーグレナ	48.9	46.2	41,949
ミヨシ油脂	5	4.4	5,337
理研ビタミン	5.8	5.1	20,884
繊維製品（0.6%）			
片倉工業	14.8	15.4	19,943
グンゼ	8	7.8	34,515
東洋紡	50.8	41.7	65,886
ユニチカ	35.2	31.2	10,951
富士紡ホールディングス	6.3	5.1	19,048
倉敷紡績	11.5	10.9	26,705
シキボウ	6.3	5.6	7,179
日本毛織	39.4	34.8	37,723
ダイトウボウ	19	17.8	2,937
トーア紡コーポレーション	5	4.1	2,177
ダイドーリミテッド	15	14.1	3,821
帝国繊維	13.5	11.8	29,677
帝人	98	86.2	179,985
東レ	932.2	764.7	556,778
サカイオーベックス	3	2.9	5,208
住江織物	3.2	2.3	5,713
日本フエルト	6.6	5.7	2,861
イチカワ	1.8	1.5	2,133
日東製網	1.4	1.2	2,040
アツギ	10	8.8	6,820
ダイニック	4.7	3.9	3,162
セーレン	29.5	26	41,756
ソトー	4.6	3.8	3,697
東海染工	1.8	1.4	1,590
小松マテーレ	19.7	17.3	14,359
ワコールホールディングス	35	27.5	82,637
ホギメディカル	14.9	12	43,440
レナウン	35	28.2	3,017
クラウディアホールディングス	2.9	2.9	1,403
ＴＳＩホールディングス	44.3	35.5	19,063
マツオカコーポレーション	3.9	3.1	5,986
ワールド	12.4	15	38,985
三陽商会	7.2	5.5	7,089
ナイガイ	4.6	4	1,756
オンワードホールディングス	72.3	63.5	39,941
ルックホールディングス	4.4	3.6	3,873
キムラタン	57.1	57.9	1,679
ゴールドウイン	10.9	19.2	127,680
デサント	29.3	20.6	36,606
キング	6.2	5	2,890
ヤマトインターナショナル	7.9	6.3	2,601
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	7.6	6.7	27,604
王子ホールディングス	541	441.3	270,516
日本製紙	57.5	46.7	86,908
三菱製紙	19.7	12	5,676
北越コーポレーション	79.7	70	36,890
中越パルプ工業	5.1	4.5	7,200
巴川製紙所	4.1	3.2	3,017
大王製紙	58.5	46.3	68,662
阿波製紙	3	2.8	1,570
レンゴー	124	99.9	90,609
トーモク	7.4	6.5	11,986
ザ・パック	9.1	8	33,320

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
化学（7.1%）			
クラレ	202.9	166.4	228,633
旭化成	855	700	770,000
共和レザー	7.5	5.8	4,576
昭和電工	79.8	75.2	207,176
住友化学	946	776	360,064
住友精化	5.8	4.7	14,781
日産化学	73.8	59.1	286,044
ラサ工業	4.3	3.8	5,703
クレハ	11.1	9.1	57,330
多木化学	3.4	3.1	14,089
テイカ	9.8	7.8	14,944
石原産業	23.2	19	18,373
片倉コープアグリ	3	3	3,735
日東エフシー	7.7	－	－
日本曹達	19	15.6	53,196
東ソー	185.7	163.3	280,549
トクヤマ	34.6	30.5	86,833
セントラル硝子	26.2	21.6	52,358
東亞合成	75.4	66.4	86,452
大阪ソーダ	12.9	10.8	32,227
関東電化工業	28.5	25.1	26,028
デンカ	47.2	38.6	117,730
信越化学工業	211.8	181.3	2,473,838
日本カーバイド工業	4.1	3.7	5,065
堺化学工業	7.9	6.8	15,762
第一稀元素化学工業	9.8	11.5	10,902
エア・ウォーター	98.5	90.2	140,982
大陽日酸	99	101.5	231,623
日本化学工業	4.1	3.3	9,639
東邦アセチレン	1.9	1.5	2,074
日本パーカライジング	65.6	53.3	63,107
高圧ガス工業	19.2	16.9	13,790
チタン工業	1.5	1.3	3,136
四国化成工業	20.2	16.3	21,369
戸田工業	2.6	2.4	5,176
ステラ　ケミファ	7	5.8	18,270
保土谷化学工業	4.2	4	18,100
日本触媒	20.2	16.4	102,172
大日精化工業	9.9	9.4	27,993
カネカ	32	27.3	96,096
三菱瓦斯化学	123.7	99.7	186,439
三井化学	109	96	252,864
ＪＳＲ	120.6	98.4	212,839
東京応化工業	20.6	18.2	86,177
大阪有機化学工業	11.1	9.8	17,806
三菱ケミカルホールディングス	803.4	706.2	560,157
ＫＨネオケム	18.3	18.6	45,253
ダイセル	186.7	144.5	151,436
住友ベークライト	20.8	16.6	68,973
積水化学工業	262.6	227.1	425,585
日本ゼオン	108.4	95.3	120,554
アイカ工業	36	31.7	114,754
宇部興産	60.6	53.3	119,178
積水樹脂	19.8	19	48,051
タキロンシーアイ	26	22.8	15,732
旭有機材	8.3	6	10,326
日立化成	55.5	48.9	225,184
ニチバン	6.3	5.6	9,979
リケンテクノス	32.9	26.7	12,896
大倉工業	6.2	5	8,815
積水化成品工業	17.8	14.2	10,124
群栄化学工業	2.9	2.4	5,892
タイガースポリマー	6.5	5.6	3,259
ミライアル	3.5	3.8	4,727
ダイキアクシス	4.3	3.8	3,321
ダイキョーニシカワ	25.4	22.2	17,959
竹本容器	4.3	3.8	3,423

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
森六ホールディングス	6.5	5.7	12,887
日本化薬	76.4	65.4	86,785
カーリットホールディングス	12.8	11.3	6,655
日本精化	9.7	8.6	11,429
扶桑化学工業	12.2	10.7	38,413
トリケミカル研究所	2.7	2.3	27,439
ＡＤＥＫＡ	59.3	48.7	80,744
日油	46.2	39.8	157,608
新日本理化	21.9	18	3,762
ハリマ化成グループ	10	8.8	9,944
花王	297.9	258.1	2,238,501
第一工業製薬	4.5	4	18,660
石原ケミカル	3.1	3	5,529
日華化学	4	3.7	3,193
ニイタカ	1.9	1.6	3,662
三洋化成工業	8	6.3	31,500
有機合成薬品工業	8.3	8.5	2,303
大日本塗料	13.7	12	13,980
日本ペイントホールディングス	99.1	87.2	475,240
関西ペイント	135	118.7	304,584
神東塗料	9.4	8.8	1,821
中国塗料	39.4	30.1	30,762
日本特殊塗料	9	8	11,240
藤倉化成	16.4	14.5	8,410
太陽ホールディングス	9.9	7.8	40,092
ＤＩＣ	54.4	44.7	133,206
サカタインクス	26.2	23.2	28,605
東洋インキＳＣホールディングス	25.4	22.4	57,836
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	9.4	8.4	8,610
富士フイルムホールディングス	254.8	206.7	1,121,967
資生堂	243.8	214.3	1,523,244
ライオン	171	140.2	297,083
高砂香料工業	8.5	6.8	16,578
マンダム	27.6	24.3	65,051
ミルボン	15.1	14.4	81,648
ファンケル	54.6	43.7	135,907
コーセー	20.8	20.3	301,861
コタ	5.8	5.7	8,498
シーボン	1.4	1.2	2,959
ポーラ・オルビスホールディングス	52.4	46	113,206
ノエビアホールディングス	7.7	10.3	55,208
アジュバンコスメジャパン	2.8	2.3	2,288
エステー	8.8	6.9	11,743
アグロ　カネショウ	5	3.4	4,913
コニシ	21.8	17.7	28,638
長谷川香料	14.6	14.4	32,688
星光ＰＭＣ	8.1	6.3	6,041
小林製薬	34.4	30.2	276,028
荒川化学工業	11.1	9.7	15,035
メック	8.5	7.4	12,683
日本高純度化学	3.2	3.1	8,363
タカラバイオ	32.1	28.2	68,159
ＪＣＵ	15.9	13.1	41,396
新田ゼラチン	7.7	6.7	4,502
ＯＡＴアグリオ	1.8	1.8	2,622
デクセリアルズ	31.6	27.8	25,909
アース製薬	9.3	8.2	49,282
北興化学工業	12.8	11.1	7,270
大成ラミック	3.7	3.3	9,464
クミアイ化学工業	50.7	44.7	40,051
日本農薬	29.4	19.4	11,310
アキレス	9	7.4	12,987
有沢製作所	19.3	17	17,442
日東電工	92.7	74.5	470,095
レック	13.1	11.5	12,604
三光合成	9.5	12.4	4,488
きもと	20.9	18.5	3,182
藤森工業	11	9.7	33,756

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
前澤化成工業	8.6	6.9	8,211
未来工業	6.6	5.8	12,325
ウェーブロックホールディングス	2.6	3.9	2,839
ＪＳＰ	7.1	6.3	12,537
エフピコ	10.1	11.8	80,358
天馬	8.6	7.1	14,590
信越ポリマー	22.1	19.4	19,458
東リ	30.7	27.1	8,238
ニフコ	49.1	39.6	115,592
バルカー	9.9	8.8	21,621
ユニ・チャーム	260.2	207.9	780,040
ショーエイコーポレーション	－	1.2	1,011
医薬品（6.3%）			
協和キリン	153.7	108.4	306,880
武田薬品工業	777.5	897.1	4,035,155
アステラス製薬	1,131.4	948.4	1,882,099
大日本住友製薬	91	79.9	153,168
塩野義製薬	160.6	137.9	933,996
田辺三菱製薬	128.3	－	－
わかもと製薬	14.3	13	3,354
あすか製薬	15.1	12.3	14,747
日本新薬	32.1	28.3	264,888
ビオフェルミン製薬	2	1.7	4,047
中外製薬	127.9	112.4	1,379,148
科研製薬	22.2	18.5	113,590
エーザイ	146.8	129	1,206,150
ロート製薬	62.9	55.3	180,554
小野薬品工業	289.9	247.6	666,167
久光製薬	36.2	28.5	166,155
持田製薬	9.3	15	65,550
参天製薬	232.6	200.8	421,680
扶桑薬品工業	4.2	3.8	7,543
日本ケミファ	1.6	1.4	3,696
ツムラ	38.1	33.5	103,347
日医工	30.1	30.6	41,187
キッセイ薬品工業	21.8	19.1	59,496
生化学工業	23.8	20.8	26,187
栄研化学	21.6	19	44,080
日水製薬	5.2	4.6	6,154
鳥居薬品	6.6	6.7	24,957
ＪＣＲファーマ	8.7	7.6	76,380
東和薬品	5.8	13.8	35,466
富士製薬工業	8.3	7.3	10,059
沢井製薬	25.1	22.1	163,319
ゼリア新薬工業	24.3	19.6	41,846
第一三共	351.1	308.5	2,523,530
キョーリン製薬ホールディングス	27	23.8	52,955
大幸薬品	5.4	4.4	17,358
ダイト	7.1	6.3	23,751
大塚ホールディングス	233.7	205.4	1,045,896
大正製薬ホールディングス	27.4	22.7	188,410
ペプチドリーム	61.2	54.6	294,840
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	104.2	92.1	7,091
昭和シェル石油	113.5	－	－
ニチレキ	15.8	12.7	17,665
ユシロ化学工業	6.4	6	8,466
ビーピー・カストロール	4.4	3.9	5,733
富士石油	29.7	29	6,583
ＭＯＲＥＳＣＯ	4.5	4	5,672
出光興産	95.1	121.3	343,885
ＪＸＴＧホールディングス	2,063.9	1,621.8	783,329
コスモエネルギーホールディングス	35.5	31.2	67,922
ゴム製品（0.7%）			
横浜ゴム	71.2	62.4	118,185
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	63	61.9	87,588
ブリヂストン	377.1	331.4	1,329,576
住友ゴム工業	110.2	96.9	121,028

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
藤倉コンポジット	10.9	9.5	4,199
オカモト	8.6	6.5	25,610
フコク	5.5	4.7	3,313
ニッタ	13.9	12.1	39,627
住友理工	23.9	20.9	18,412
三ツ星ベルト	16.2	14.2	27,888
バンドー化学	23.5	19	16,074
ガラス・土石製品（0.8%）			
日東紡績	18.3	16	76,960
ＡＧＣ	121.4	106.6	385,892
日本板硝子	58.6	51.5	30,797
石塚硝子	1.6	1.9	5,038
日本山村硝子	5.2	4.5	5,553
日本電気硝子	53.1	43.3	95,173
オハラ	4.8	4.3	5,413
住友大阪セメント	24.7	20.4	92,616
太平洋セメント	77.4	68.1	207,024
日本ヒューム	12.4	10.8	8,769
日本コンクリート工業	26.6	23.4	6,645
三谷セキサン	5.7	5	19,575
アジアパイルホールディングス	17.3	15.3	8,858
東海カーボン	111.4	112.9	115,948
日本カーボン	5.8	5.5	21,092
東洋炭素	7.2	6.3	13,532
ノリタケカンパニーリミテド	7.3	5.9	26,520
ＴＯＴＯ	94.4	77	385,770
日本碍子	149.7	131.6	251,092
日本特殊陶業	103.5	83.9	165,031
ダントーホールディングス	9.4	8	920
ＭＡＲＵＷＡ	4.3	4.2	34,020
品川リフラクトリーズ	3.2	2.9	9,004
黒崎播磨	2.5	2.1	13,797
ヨータイ	10.7	8.6	5,891
イソライト工業	6.3	5.5	3,272
東京窯業	15.7	13.8	4,388
ニッカトー	5.5	4.9	3,312
フジミインコーポレーテッド	11	9.6	29,616
クニミネ工業	4.2	4.4	5,988
エーアンドエーマテリアル	2.6	1.8	2,793
ニチアス	33.6	29.5	80,918
ニチハ	17	15	41,655
鉄鋼（0.7%）			
日本製鉄	563.9	477.3	740,769
神戸製鋼所	222	195.1	98,330
中山製鋼所	16.8	14.9	7,375
合同製鐵	5.8	5.7	16,809
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	327.7	287.9	388,089
東京製鐵	64.9	52	44,148
共英製鋼	13.7	12	22,920
大和工業	25.8	22.6	59,189
東京鐵鋼	5	4.4	6,564
大阪製鐵	8	5.7	9,279
淀川製鋼所	16.4	14.4	28,900
丸一鋼管	43	34.6	109,682
モリ工業	3.7	3.2	9,632
大同特殊鋼	19.8	17.4	78,648
日本高周波鋼業	4.6	4.2	1,818
日本冶金工業	100.3	8.9	19,108
山陽特殊製鋼	15.2	7.6	10,830
愛知製鋼	6.8	6	21,390
日立金属	130.8	114.8	205,492
日本金属	2.8	2.4	2,044
大平洋金属	8.1	7.2	16,430
新日本電工	72.6	69.2	11,902
栗本鐵工所	6.2	5.3	11,617
虹　技	1.8	1.6	2,128
日本鋳鉄管	1.3	1.1	1,652
三菱製鋼	9.1	8	8,664

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
日亜鋼業	17.2	15.7	5,118
日本精線	1.8	1.7	6,443
エンビプロ・ホールディングス	2.5	4.1	3,054
シンニッタン	19	16.6	7,685
新家工業	2.7	2.4	3,496
非鉄金属（0.7%）			
大紀アルミニウム工業所	19.9	17.5	12,302
日本軽金属ホールディングス	330.6	270	57,780
三井金属鉱業	32.8	28.8	77,443
東邦亜鉛	6.7	5.5	10,752
三菱マテリアル	80.1	70.5	203,463
住友金属鉱山	166.1	136.3	438,204
ＤＯＷＡホールディングス	28.4	27	109,890
古河機械金属	20	19	26,410
エス・サイエンス	53.7	47.6	2,189
大阪チタニウムテクノロジーズ	14.1	11.1	15,218
東邦チタニウム	21.8	19.1	16,597
ＵＡＣＪ	18.5	16.2	37,632
ＣＫサンエツ	2.3	1.9	6,308
古河電気工業	35	33.1	86,357
住友電気工業	453.6	398.6	605,074
フジクラ	146.4	128.7	48,906
昭和電線ホールディングス	14.1	12.3	16,740
東京特殊電線	1.6	1.6	4,049
タツタ電線	24.1	21.1	12,491
カナレ電気	2	1.7	3,117
平河ヒューテック	5	4	5,636
リョービ	14.9	13.2	24,195
アーレスティ	14.9	14	7,378
アサヒホールディングス	22.9	18.7	51,200
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	6.9	6	8,316
宮地エンジニアリンググループ	3.8	3.3	6,890
トーカロ	31.3	29.6	36,230
アルファ	4.3	3.8	5,069
ＳＵＭＣＯ	134.1	127.7	225,773
川田テクノロジーズ	2.7	2.1	13,944
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2.5	3.1	9,017
信和	－	4.6	5,069
東洋製罐グループホールディングス	77.2	67.9	133,695
ホッカンホールディングス	6.2	5.9	11,623
コロナ	6.8	5.9	6,136
横河ブリッジホールディングス	22.6	19.9	45,431
駒井ハルテック	2.4	1.9	3,556
高田機工	1	0.9	2,540
三和ホールディングス	125.3	102.3	124,294
文化シヤッター	35.8	31.5	27,405
三協立山	16.8	14.8	22,140
アルインコ	9.7	7.8	9,180
東洋シヤッター	3	2.5	1,687
ＬＩＸＩＬグループ	179.1	157.4	294,967
日本フイルコン	9.4	8.3	4,407
ノーリツ	27	22.1	30,807
長府製作所	12.4	10.8	25,498
リンナイ	21.7	20.7	162,909
ダイニチ工業	6.4	5.7	3,978
日東精工	16.7	14.7	8,952
三洋工業	1.5	1.4	2,809
岡部	24.6	21.6	19,094
ジーテクト	13.5	13.3	21,200
中国工業	1.9	－	－
東プレ	22.6	19.9	34,566
高周波熱錬	23.5	20.5	18,716
東京製綱	7.4	7.6	8,641
サンコール	6.9	6.1	3,287
モリテックスチール	9.5	8.4	3,217
パイオラックス	19.4	15.7	30,976
エイチワン	12	10.5	7,518

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
日本発条	120.9	114.3	107,099
中央発條	1.4	1.2	3,578
アドバネクス	1.6	1.3	2,242
立川ブラインド工業	5.4	4.7	6,044
三益半導体工業	9.5	8.4	20,344
機械（5.1%）			
日本ドライケミカル	3.4	2.7	4,749
日本製鋼所	36.7	32.3	69,380
三浦工業	52.6	46.1	195,003
タクマ	44.2	36.1	45,161
ツガミ	27.1	22	23,188
オークマ	15.4	12.4	64,852
東芝機械	13.7	12	40,560
アマダホールディングス	187.2	135.5	159,483
アイダエンジニアリング	33.7	27.9	25,444
滝澤鉄工所	3.9	3.3	4,484
ＦＵＪＩ	36.3	45.8	84,638
牧野フライス製作所	14.2	12.4	53,258
オーエスジー	59.7	49.3	94,705
ダイジェット工業	1.4	1.2	1,716
旭ダイヤモンド工業	31.8	27.9	17,019
ＤＭＧ森精機	76.7	67.4	110,333
ソディック	26.4	25.1	22,037
ディスコ	16.4	14.5	383,815
日東工器	6.6	5.8	14,871
日進工具	3.7	3.2	9,193
パンチ工業	8.5	9.8	4,635
冨士ダイス	5.4	4.6	3,330
豊和工業	6.7	5.9	4,867
ＯＫＫ	5	4.4	2,736
石川製作所	2.9	2.5	4,057
東洋機械金属	8.8	7.5	3,945
津田駒工業	2.6	2	2,274
エンシュウ	3.2	2.5	3,107
島精機製作所	16.7	17.1	37,431
オプトラン	11.9	11.9	35,819
ＮＣホールディングス	3.8	3.3	2,247
イワキ	－	5.1	6,262
フリュー	9.7	10.4	12,282
ヤマシンフィルタ	21.1	23.2	18,003
日阪製作所	15	13.2	12,500
やまびこ	23.6	20.7	23,039
平田機工	5.7	5	32,800
ペガサスミシン製造	11.4	10.7	5,157
マルマエ	3.3	4.4	4,452
タツモ	3.9	5	6,315
ナブテスコ	66.7	62.8	200,646
三井海洋開発	12.9	11.3	23,560
レオン自動機	12	10.5	15,456
ＳＭＣ	35.9	33.9	1,720,425
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9.2	9.3	4,780
ホソカワミクロン	4.3	3.8	19,342
ユニオンツール	5.2	4	12,160
オイレス工業	16.9	13.8	22,273
日精エー・エス・ビー機械	3.5	3.6	14,148
サトーホールディングス	14.6	15.2	47,956
技研製作所	8.5	9.4	45,825
日本エアーテック	3.8	3.4	2,954
カワタ	2.5	3.2	3,184
日精樹脂工業	10.2	9	8,694
オカダアイヨン	4.2	3.4	4,229
ワイエイシイホールディングス	4.9	4.6	3,026
小松製作所	555.5	488.3	1,171,187
住友重機械工業	70.2	61.7	178,991
日立建機	49.1	43.1	130,377
日工	3.4	14.8	11,988
巴工業	5.2	4.6	10,248
井関農機	12.3	10.8	16,405
ＴＯＷＡ	10.4	10.9	12,131
丸山製作所	2.6	2.2	3,405
北川鉄工所	5.5	4.8	10,651
ローツェ	5.3	4.7	19,575
タカキタ	4.4	3.7	2,086
クボタ	658.2	572.1	1,024,917
荏原実業	3.5	2.7	5,526
三菱化工機	4.3	3.8	7,695
月島機械	24.3	19.9	28,835
帝国電機製作所	8.6	8.9	12,513
東京機械製作所	4.7	4.7	1,701
新東工業	29.1	25.5	23,511
澁谷工業	10.7	9.4	29,375
アイチコーポレーション	21.2	18.7	13,669
小森コーポレーション	33.2	27.3	27,163
鶴見製作所	9.6	8.4	15,531
住友精密工業	2	1.6	5,208
日本ギア工業	－	3.5	1,396
酒井重工業	2.3	2	5,508
荏原製作所	54.4	44.6	156,323
石井鐵工所	1.9	1.4	3,960
酉島製作所	12.6	10.9	9,777
北越工業	12.7	11.1	14,718
ダイキン工業	167.5	137.4	2,245,803
オルガノ	4.5	3.9	28,821
トーヨーカネツ	4.6	4.7	10,415
栗田工業	66.4	58.3	203,758
椿本チエイン	16	15.4	54,362
大同工業	5.8	5.2	4,201
木村化工機	10.2	9	5,454
アネスト岩田	19.1	16.7	17,401
ダイフク	67.4	55.1	380,741
サムコ	3.4	3	5,988
加藤製作所	6.3	5.9	9,823
油研工業	2.2	1.7	2,915
タダノ	59.2	52	55,536
フジテック	44.6	39.2	69,776
ＣＫＤ	34.1	30	57,300
キトー	9.3	8.2	14,013
平和	34.2	30.1	68,266
理想科学工業	10.9	9.5	17,888
ＳＡＮＫＹＯ	30.7	24	92,040
日本金銭機械	13.6	11.9	10,091
マースグループホールディングス	7.7	6.8	13,525
フクシマガリレイ	7.5	6.6	27,687
オーイズミ	5	4.6	2,580
ダイコク電機	5.6	5	7,865
竹内製作所	20.5	18.1	35,530
アマノ	35.1	28.3	85,324
ＪＵＫＩ	17	15	12,030
サンデンホールディングス	14.9	14.2	9,372
蛇の目ミシン工業	11.2	10.1	4,161
マックス	18.9	16.4	34,177
グローリー	34	27.6	88,182
新晃工業	11.4	10	17,640
大和冷機工業	17.6	15.6	18,345
セガサミーホールディングス	121.8	107	169,381
日本ピストンリング	4.5	4	5,920
リケン	5.6	5	18,350
ＴＰＲ	16.5	14.5	27,332
ツバキ・ナカシマ	18.5	22	29,480
ホシザキ	35.8	31.5	332,640
大豊工業	10	8.9	6,470
日本精工	252	203	193,053
ＮＴＮ	263.7	249.6	74,630
ジェイテクト	117.7	103.4	125,010
不二越	11.4	10	42,700
日本トムソン	36.4	31.9	14,897
ＴＨＫ	76.5	62.7	182,519
ユーシン精機	9.5	8.4	7,786
前澤給装工業	4.8	3.9	8,919
イーグル工業	15.1	13.3	13,193
前澤工業	9.1	7.1	2,811
日本ピラー工業	12.4	10.9	17,352
キッツ	49.7	43.8	34,076
マキタ	149.3	140.6	605,986
日立造船	97.1	85.6	36,551
三菱重工業	205.6	180.7	724,426
ＩＨＩ	94.3	77.6	222,712
スター精密	21.1	16.6	23,688
電気機器（14.6%）			
日清紡ホールディングス	68.1	71.8	73,738
イビデン	75.1	66	178,992
コニカミノルタ	268.1	235.6	165,155
ブラザー工業	159.9	131.6	305,312
ミネベアミツミ	227.8	200.1	448,824
日立製作所	552.4	518.1	2,211,768
三菱電機	1,227	1,078.2	1,759,622
富士電機	79.6	65	233,675
東洋電機製造	4.8	4.3	6,467
安川電機	142.2	116.1	458,595
シンフォニア テクノロジー	17	14	17,626
明電舎	24.3	19.8	41,085
オリジン	3.3	3	4,617
山洋電気	5.9	5.2	28,600
デンヨー	11.3	9.2	19,660
東芝テック	15.3	13.5	59,332
芝浦メカトロニクス	2.2	1.9	6,944
マブチモーター	33.9	29.9	120,048
日本電産	147.7	129.7	1,931,881
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.6	6.5	2,762
トレックス・セミコンダクター	4.2	6.2	9,405
東光高岳	6.2	6	7,152
ダブル・スコープ	17.8	16.7	12,909
宮越ホールディングス	4.6	4	3,584
ダイヘン	13.5	11.8	42,657
田淵電機	16.5	－	－
ヤーマン	17.7	15.6	10,654
ＪＶＣケンウッド	89.9	88	21,912
ミマキエンジニアリング	11	9.6	4,963
第一精工	5.1	4	9,680
日新電機	28.8	25.3	30,815
大崎電気工業	24.4	21.4	13,524
オムロン	130.3	96.7	661,428
日東工業	19.6	15.8	36,545
ＩＤＥＣ	16.4	15.6	31,200
正興電機製作所	－	2.5	2,842
不二電機工業	1.3	1.2	1,490
ジーエス・ユアサ コーポレーション	44.1	36	80,820
サクサホールディングス	3	2.5	5,137
メルコホールディングス	5.1	3.8	10,389
テクノメディカ	2.8	2.4	4,958
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	－	1.7	1,662
日本電気	158.8	130.9	655,809
富士通	118.3	103.9	1,321,088
沖電気工業	53.2	43.9	61,460
岩崎通信機	5.8	4.8	3,988
電気興業	6.4	5.2	19,058
サンケン電気	14.3	11.7	34,304
ナカヨ	2.3	1.9	3,157
アイホン	7	6.1	10,729
ルネサスエレクトロニクス	127	514.9	383,085
セイコーエプソン	152.2	133.8	230,403
ワコム	88.9	72.4	28,815
アルバック	24.5	19.8	80,091
アクセル	5	4.5	3,753

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
ＥＩＺＯ	11.3	8.4	33,054
ジャパンディスプレイ	290.1	312	23,088
日本信号	31.2	27.4	39,538
京三製作所	26.3	25.2	14,288
能美防災	16.2	14.3	35,750
ホーチキ	7.7	7.9	11,699
星和電機	4.1	5.4	3,191
エレコム	11.1	11.7	50,017
パナソニック	1,401.8	1,231.9	1,522,628
シャープ	121.8	124.7	192,910
アンリツ	79	69.5	149,355
富士通ゼネラル	37.4	29.3	72,898
ソニー	822.6	681.6	5,334,201
ＴＤＫ	64.2	52	627,640
帝国通信工業	5.4	4.7	5,870
タムラ製作所	47.2	36	23,256
アルプスアルパイン	127.7	95.5	191,764
池上通信機	3.9	3.5	3,888
パイオニア	204.5	－	－
日本電波工業	11.2	9.8	4,753
鈴木	6.1	5.8	4,547
日本トリム	2.4	1.4	6,167
ローランド ディー. ジー.	6.3	5.9	12,000
フォスター電機	14.4	11.3	18,543
クラリオン	10.7	－	－
ＳＭＫ	3.4	2.8	8,764
ヨコオ	8.8	6.9	20,838
ティアック	8.6	8	1,592
ホシデン	36.1	29.5	37,229
ヒロセ電機	17.5	16.7	232,965
日本航空電子工業	28.2	24.7	50,412
ＴＯＡ	13.3	11.5	12,420
マクセルホールディングス	26.4	23.3	34,181
古野電気	15.8	13.9	15,429
ユニデンホールディングス	3.7	3	6,306
スミダコーポレーション	10.4	8.3	9,777
アイコム	6.8	6	15,990
リオン	5.6	4.5	14,917
本多通信工業	10.5	9.4	5,094
船井電機	12.5	10.9	7,662
横河電機	122.8	98.9	197,008
新電元工業	4.4	3.8	13,338
アズビル	79.2	68	204,680
東亜ディーケーケー	6.1	5.3	5,469
日本光電工業	54.1	44.6	155,654
チノー	4.3	3.7	5,154
共和電業	13	11.3	4,892
日本電子材料	4.7	4.3	4,588
堀場製作所	24.3	21.3	153,573
アドバンテスト	83.6	80.2	453,130
小野測器	5.7	4.2	2,553
エスペック	10.9	9.5	22,600
キーエンス	60.2	97.7	3,743,864
日置電機	6.4	5.6	23,072
シスメックス	95.6	77	631,554
日本マイクロニクス	19.8	18.8	24,289
メガチップス	9.7	10	18,290
OBARA GROUP	7.1	5.6	20,608
澤藤電機	1.5	1.3	2,802
原田工業	3.8	5.1	5,100
コーセル	17	13.2	15,272
イリソ電子工業	11.2	9.1	39,084
オプテックスグループ	21.6	17.6	27,385
千代田インテグレ	5.1	5	10,630
アイ・オー・データ機器	5.1	4	4,172
レーザーテック	25.1	47.3	259,677
スタンレー電気	86.9	75.8	234,601
岩崎電気	4.8	4.2	6,997

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
ウシオ電機	74.5	62.6	101,036
岡谷電機産業	8.8	8.5	3,162
ヘリオス テクノ ホールディング	11.3	9.9	4,405
エノモト	2.6	3.3	4,319
日本セラミック	12.5	10.9	27,489
遠藤照明	6.3	5.4	3,812
古河電池	8.8	7.6	5,806
双信電機	5.9	5.4	2,386
山一電機	8.9	7.9	15,191
図研	7.9	7	18,487
日本電子	24.2	21.2	77,698
カシオ計算機	108.5	95.4	193,757
ファナック	116.6	102.4	2,139,648
日本シイエムケイ	31.2	25.4	13,716
エンプラス	5.5	5.5	16,885
大真空	4.5	4	7,084
ローム	59.3	47.8	410,124
浜松ホトニクス	88.1	77.3	376,064
三井ハイテック	13.6	11.9	20,396
新光電気工業	41.1	36.2	48,942
京セラ	187.1	151.7	1,111,657
太陽誘電	54.6	47.9	167,650
村田製作所	128.8	316.7	2,096,554
ユーシン	19.4	－	－
双葉電子工業	20	17	22,865
北陸電気工業	4.6	4.3	5,022
ニチコン	38.6	36.6	35,062
日本ケミコン	8.8	8.2	14,546
ＫＯＡ	18.6	16.2	20,250
市光工業	18.4	16.1	11,157
小糸製作所	73.6	64.6	321,708
ミツバ	22.6	19.9	15,064
SCREENホールディングス	21.3	18.7	122,672
キヤノン電子	11.3	11.3	23,843
キヤノン	660.6	580.4	1,716,823
リコー	369	274.3	342,600
象印マホービン	22.9	31.6	72,206
MUTOHホールディングス	1.6	1.4	2,438
東京エレクトロン	81.9	71.9	1,750,765
輸送用機器（7.6%）			
トヨタ紡織	42.9	31.4	52,783
芦森工業	2.6	2.2	3,018
ユニプレス	23.8	20.9	30,305
豊田自動織機	99.3	87.3	545,625
モリタホールディングス	21.4	18.9	33,207
三櫻工業	15.5	13.7	14,371
デンソー	270.2	237.4	1,075,184
東海理化電機製作所	32.3	28.4	54,698
三井E＆Sホールディングス	44.3	39	37,167
川崎重工業	95.5	83.9	191,375
名村造船所	36.8	34.7	8,744
サノヤスホールディングス	16.3	13.2	2,349
日本車輌製造	4.5	4	12,340
三菱ロジスネクスト	14.6	14.3	22,880
近畿車輌	1.9	1.6	2,579
日産自動車	1,447.3	1,271.6	758,000
いすゞ自動車	387.9	312.4	356,292
トヨタ自動車	1,367.5	1,203.1	9,458,772
日野自動車	153.2	134.6	142,003
三菱自動車工業	454.2	399	169,575
エフテック	8.7	7.5	5,505
レシップホールディングス	4.5	4.4	3,022
GMB	2.5	2	1,612
ファルテック	2.1	1.9	2,050
武蔵精密工業	28.9	24	32,112
日産車体	24	21.1	22,387
新明和工業	57.1	29.1	39,023
極東開発工業	24.4	20	29,720

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
日信工業	22.4	21.9	49,056
トピー工業	10.1	8.9	16,278
ティラド	4.5	3.9	7,203
曙ブレーキ工業	67.3	59.3	13,994
タチエス	20.8	17.6	24,992
ＮＯＫ	65.9	57.9	91,366
フタバ産業	34.1	30.1	20,016
ＫＹＢ	12.8	12	36,720
大同メタル工業	19.9	20.7	14,117
プレス工業	60.8	53.5	20,169
ミクニ	15.5	13.7	4,699
太平洋工業	25.7	22.5	30,555
ケーヒン	28.2	24.8	64,033
河西工業	15	14.5	12,020
アイシン精機	101.1	88.7	335,286
マツダ	385.1	317.2	289,286
今仙電機製作所	11.4	10	9,030
本田技研工業	1,035.2	849	2,426,017
スズキ	224.5	213.7	1,094,357
ＳＵＢＡＲＵ	381	334.7	950,882
安永	5.9	5.2	6,193
ヤマハ発動機	173.2	140.6	295,822
ショーワ	29	25.4	58,039
ＴＢＫ	14.8	12.9	6,011
エクセディ	16.6	14.7	34,104
豊田合成	39.7	34.8	85,990
愛三工業	19.2	16.9	12,168
盟和産業	1.9	1.6	1,740
日本プラスト	9.6	8.4	5,812
ヨロズ	11.5	10.1	14,705
エフ・シー・シー	22.1	17.6	39,564
シマノ	49.5	40.4	727,200
テイ・エス テック	28.5	25	78,875
ジャムコ	6.2	5.4	7,759
精密機器（2.4%）			
テルモ	173.6	305.1	1,202,399
クリエートメディック	4.2	3.6	3,888
日機装	39.7	32.3	44,251
日本エム・ディ・エム	7	6.2	12,499
島津製作所	157.9	128.8	390,908
ＪＭＳ	11.1	9.2	8,050
クボテック	2.6	2.8	1,145
長野計器	9.6	7.8	7,332
ブイ・テクノロジー	2.9	5	25,150
東京計器	7.7	6.9	7,024
愛知時計電機	1.6	1.3	5,609
インターアクション	6.5	5.8	15,433
オーバル	11.7	9.8	2,489
東京精密	22.2	19.5	78,975
マニー	14.9	42.9	123,981
ニコン	213.8	174.4	233,347
トプコン	65.8	54.3	69,829
オリンパス	182.8	596.7	1,231,588
理研計器	10.9	9.5	21,755
タムロン	10.9	8.7	20,584
ＨＯＹＡ	247.1	215.3	2,190,677
シード	5.2	4.6	4,793
ノーリツ鋼機	9.7	7.2	11,124
エー・アンド・デイ	11.2	9.8	9,898
朝日インテック	52	91.6	291,288
シチズン時計	134.2	126.3	68,075
リズム時計工業	4.1	3.4	3,107
大研医器	9.8	7.5	5,167
メニコン	16.8	14.8	78,144
シンシア	1.9	1.1	749
松風	6.2	4.9	9,770
セイコーホールディングス	19	15.2	41,100
ニプロ	84.9	74.7	99,052

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
その他製品（2.2%）			
中本パックス	3.4	2.8	4,631
スノーピーク	4.5	5.1	5,298
パラマウントベッドホールディングス	14.1	11.4	52,611
トランザクション	6.7	6.9	7,741
粧美堂	3.5	3.2	1,270
ニホンフラッシュ	5.2	5	13,760
前田工繊	13.6	11.8	26,432
永大産業	16.4	14.3	4,876
アートネイチャー	13.1	11.5	8,487
バンダイナムコホールディングス	126.8	111.5	701,892
アイフィスジャパン	2.7	2.8	2,038
共立印刷	20.8	18.4	3,091
ＳＨＯＥＩ	5.8	5.2	28,288
フランスベッドホールディングス	17.4	15.3	14,504
パイロットコーポレーション	21.4	17.5	78,487
萩原工業	6.8	6	9,966
トッパン・フォームズ	26.3	23.2	28,327
フジシールインターナショナル	27.4	24.2	52,441
タカラトミー	51.4	48.3	56,849
廣済堂	11.4	7.5	7,830
エステールホールディングス	3.5	2.8	1,971
アーク	46.7	41.5	3,776
タカノ	4.9	4.2	3,486
プロネクサス	10.5	9.3	11,206
ホクシン	7.7	7.2	1,130
ウッドワン	4	3.5	4,000
大建工業	9.3	7.2	13,701
凸版印刷	173.2	152.2	336,362
大日本印刷	172.9	141.1	433,882
図書印刷	11.5	－	－
共同印刷	3.9	3.4	10,121
ＮＩＳＳＨＡ	25.1	22.1	23,249
光村印刷	1	0.9	1,498
TAKARA & COMPANY	6.4	5.2	8,996
アシックス	121.9	89	142,578
ツツミ	3.9	3.4	7,650
小松ウオール工業	3.8	3.4	7,524
ヤマハ	73	64.2	364,014
河合楽器製作所	3.8	3.4	11,356
クリナップ	11.5	10.1	7,029
ピジョン	74.2	65.2	259,822
オリバー	－	2.2	7,546
兼松サステック	0.8	0.7	1,283
キングジム	10.2	9	8,091
リンテック	29.2	25.6	63,385
イトーキ	22.6	22.9	11,335
任天堂	75.5	66.1	2,677,050
三菱鉛筆	20.2	17.7	29,789
タカラスタンダード	25.4	22.2	41,358
コクヨ	58.9	51.7	86,028
ナカバヤシ	12.3	10.7	6,805
グローブライド	5.9	4.8	11,731
オカムラ	42.9	37.6	41,059
美津濃	12.2	9.8	27,557
電気・ガス業（1.5%）			
東京電力ホールディングス	979.5	860.8	388,220
中部電力	375.4	330	517,440
関西電力	500.7	408.6	533,835
中国電力	169.6	149.1	225,141
北陸電力	120.1	98.6	87,359
東北電力	287.4	269.6	284,967
四国電力	110.5	97.2	90,882
九州電力	252.9	222.3	204,738
北海道電力	114.8	101	52,318
沖縄電力	22.7	20	41,820
電源開発	97.7	85.9	217,842
エフオン	7.3	5.1	3,901
イーレックス	21.3	15.3	26,285
レノバ	12.7	17.8	20,523
東京瓦斯	240.7	207.5	509,723
大阪瓦斯	238	209.3	404,995
東邦瓦斯	60.7	53	226,045
北海道瓦斯	6.6	5.8	9,744
広島ガス	25.5	22.4	8,086
西部瓦斯	13.9	12.1	29,645
静岡ガス	37.7	30.6	29,345
メタウォーター	5.9	5.2	22,204
陸運業（4.3%）			
ＳＢＳホールディングス	12.2	9.3	17,725
東武鉄道	129.4	113.7	432,060
相鉄ホールディングス	42.2	34.5	100,153
東急	333.3	271.9	531,292
京浜急行電鉄	168.1	138.5	289,326
小田急電鉄	196.6	160.3	390,490
京王電鉄	68.6	56	349,440
京成電鉄	92	75.1	307,159
富士急行	16.7	14.7	53,508
新京成電鉄	3.1	2.8	6,860
東日本旅客鉄道	218.2	189.8	1,850,550
西日本旅客鉄道	110	96.1	891,904
東海旅客鉄道	109.9	89.7	1,987,303
西武ホールディングス	156.3	144.7	263,064
鴻池運輸	19.6	17.1	27,018
西日本鉄道	34	29.9	78,427
ハマキョウレックス	9.4	8.3	28,884
サカイ引越センター	6.5	5.7	35,397
近鉄グループホールディングス	116.1	102.1	594,222
阪急阪神ホールディングス	155	136.2	591,108
南海電気鉄道	51.9	48.4	135,326
京阪ホールディングス	51.8	45.5	227,500
神戸電鉄	3	2.4	9,552
名古屋鉄道	93.1	83.9	274,353
山陽電気鉄道	9	7.3	16,016
日本通運	45.6	36.1	221,654
ヤマトホールディングス	203.7	179	352,630
山九	32.3	28.4	161,596
丸運	6.2	5.9	1,911
丸全昭和運輸	9.4	8.3	24,543
センコーグループホールディングス	64.1	56.3	50,163
トナミホールディングス	2.8	2.4	12,528
ニッコンホールディングス	44.2	36.5	94,973
日本石油輸送	1.4	1.1	3,432
福山通運	14.9	13.1	50,173
セイノーホールディングス	87	76.5	112,761
エスライン	3.1	3.1	3,239
神奈川中央交通	2.9	2.5	10,075
日立物流	25.6	18.8	60,912
丸和運輸機関	6.1	10.8	25,153
C&Fロジホールディングス	11.9	10.3	13,348
九州旅客鉄道	97.6	91.1	330,693
ＳＧホールディングス	109.8	107.2	258,459
海運業（0.2%）			
日本郵船	97.1	85.4	153,549
商船三井	69	64.6	168,864
川崎汽船	35.8	31.4	47,162
ＮＳユナイテッド海運	6.4	5.6	11,228
明治海運	12.1	10.2	3,712
飯野海運	55	48.1	17,941
共栄タンカー	0.8	1.8	1,683
乾汽船	10.4	5.9	7,262
空運業（0.5%）			
日本航空	212.8	183.8	582,094
ＡＮＡホールディングス	212.5	186.6	645,449
パスコ	2.3	1.9	4,187
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	3.3	2.9	23,113
日新	10	8.8	14,528
三菱倉庫	40.2	32.4	94,316
三井倉庫ホールディングス	14.3	11.6	21,750
住友倉庫	43.7	37.5	56,362
澁澤倉庫	6.5	5.6	12,572
東陽倉庫	20.5	18.5	6,012
日本トランスシティ	25.7	22.5	11,047
ケイヒン	2.2	1.8	2,408
中央倉庫	6.9	6.2	7,278
川西倉庫	2.3	1.8	1,873
安田倉庫	9.7	8.4	9,382
ファイズホールディングス	－	2.2	1,023
東洋埠頭	3.3	3.1	4,380
宇徳	10.1	8.7	4,724
上組	71.8	58.5	141,043
サンリツ	2.9	2.3	1,616
キムラユニティー	3.2	2.8	3,166
キユーソー流通システム	3	2.5	4,997
近鉄エクスプレス	22	21.6	39,614
東海運	6.3	5.8	1,664
エーアイテイー	7.5	7.2	7,113
内外トランスライン	3.8	3.6	4,644
日本コンセプト	3.2	3.3	5,200
情報・通信業（9.0%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	13.4	10	42,150
クロスキャット	－	2.8	3,539
システナ	43	37.7	63,147
デジタルアーツ	6.5	5.2	29,068
日鉄ソリューションズ	18	15.9	52,072
キューブシステム	6.4	5.6	4,362
エイジア	2.4	1.9	2,958
コア	5.1	4.5	6,426
ソリトンシステムズ	6.8	4.6	5,828
ソフトクリエイトホールディングス	5.2	4.6	8,234
ＴＩＳ	40.1	35.3	250,277
ネオス	4.1	4.3	3,173
電算システム	4.6	4.1	11,533
グリー	83.1	64.9	31,930
コーエーテクモホールディングス	24.6	21.6	68,148
三菱総合研究所	4.7	4.6	21,183
ボルテージ	2.4	1.9	969
電算	1.3	1.2	2,691
ＡＧＳ	6.8	5.9	5,032
ファインデックス	10.1	9	11,007
ヒト・コミュニケーションズ	2.8	－	－
ブレインパッド	2.6	2.1	12,075
ＫＬａｂ	21.4	20.4	16,748
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16	12.7	12,509
イーブックイニシアティブジャパン	2	1.5	2,634
ネクソン	306.6	301.2	497,281
アイスタイル	30.6	27.3	12,285
エムアップ	4.2	3.1	9,293
エイチーム	7.5	7.2	6,955
エニグモ	－	7.5	6,802
テクノスジャパン	10.1	8.3	4,332
ｅｎｉｓｈ	4.2	4.7	2,608
コロプラ	34.3	34.7	32,895
オルトプラス	7.3	7.9	7,102
ブロードリーフ	59.7	52.5	33,180
クロス・マーケティンググループ	3.3	4.9	1,768
デジタルハーツホールディングス	5.4	5.6	5,420
システム情報	－	5.4	5,437
メディアドゥホールディングス	3.5	3.4	10,931
じげん	12.8	26.2	13,466
ブイキューブ	6.3	6.5	4,147
エンカレッジ・テクノロジ	－	1.7	1,496
サイバーリンクス	1.9	1.6	1,832
ディー・エル・イー	7.5	7.9	1,540
フィックスターズ	11.5	11.2	17,080
CARTA HOLDINGS	6.4	5.1	5,502

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
オプティム	2.7	2.8	13,020
セレス	4	3.5	4,140
ＳＨＩＦＴ	－	2.8	22,876
ベリサーブ	1.1	－	－
ティーガイア	12.1	9.4	24,120
セック	2	1.5	5,887
日本アジアグループ	12.8	11.1	4,184
豆蔵ホールディングス	8.1	7.2	13,550
テクマトリックス	8.6	7.4	21,186
プロシップ	3.6	3.1	4,231
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	290.2	25.5	53,626
GMOペイメントゲートウェイ	19.8	17.4	127,890
ザッパラス	5.9	5.6	2,156
システムリサーチ	1.6	2.9	5,594
インターネットイニシアティブ	19.6	15.6	50,700
さくらインターネット	14.4	11.3	7,356
ヴィンクス	4.1	3	3,375
GMOクラウド	2.7	1.9	4,921
ＳＲＡホールディングス	6.4	5.6	15,372
MINORIソリューションズ	2.4	－	－
システムインテグレータ	3.4	3.4	3,097
朝日ネット	10.1	7.5	5,385
ｅＢＡＳＥ	3.7	6.3	11,050
アバント	3.2	7.5	7,912
アドソル日進	4.3	3.8	9,610
フリービット	7.9	6.3	5,600
コムチュア	6.7	11.8	28,508
サイバーコム	2.2	1.8	3,697
アステリア	5.9	6.4	3,673
アイル	－	3.8	7,311
マークラインズ	4.2	5.3	10,838
メディカル・データ・ビジョン	10.6	8.1	7,290
ｇｕｍｉ	13.9	13.6	10,132
ショーケース	2.6	2.4	1,706
モバイルファクトリー	3.3	2.3	4,179
テラスカイ	0.7	3.8	11,970
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5.3	4.7	8,149
ＰＣＩホールディングス	2.2	2.1	5,210
パイプドＨＤ	2	1.3	2,509
アイビーシー	2	1.9	2,707
ネオジャパン	2.3	1.9	2,354
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	0.7	0.9	2,310
ランドコンピュータ	1.4	1.6	1,865
ダブルスタンダード	0.7	1.3	5,635
オープンドア	5.9	5.2	6,994
マイネット	3.9	3.5	2,411
アカツキ	4.3	3.8	20,102
ベネフィットジャパン	0.6	0.8	1,412
Ubicomホールディングス	2.2	2.3	3,521
ＬＩＮＥ	36.6	24.2	130,196
カナミックネットワーク	1.9	6.4	4,358
ノムラシステムコーポレーション	0.9	2.3	1,166
チェンジ	1.5	2.1	7,833
シンクロ・フード	5.1	4.6	2,534
オークネット	6.3	6.5	8,040
セグエグループ	－	1.7	1,490
エイトレッド	－	1.3	1,808
AOI TYO HOLDINGS	13.1	10.7	7,639
マクロミル	21.3	18.9	19,202
ビーグリー	2.3	2	2,576
オロ	1.1	2.8	9,800
テモナ	－	1.3	725
ニーズウェル	－	1.2	992
サインポスト	－	1.6	3,208
ソルクシーズ	5.1	4.5	4,072
フェイス	4.2	3.8	3,081
プロトコーポレーション	－	9.5	13,414
ハイマックス	1.5	1.2	2,365
野村総合研究所	76.5	149.9	409,826
サイバネットシステム	9.9	7.5	6,135
ＣＥホールディングス	3.2	6.1	3,013
日本システム技術	2	1.7	2,342
インテージホールディングス	15.4	13.3	12,089
東邦システムサイエンス	3.7	2.9	2,633
ソースネクスト	46.4	50.2	24,849
インフォコム	4.9	11.5	34,845
ＨＥＲＯＺ	－	0.5	2,670
ラクスル	－	5.6	20,804
ＦＩＧ	10.6	11.6	3,480
システムサポート	－	0.9	2,337
イーソル	－	3.8	9,245
アルテリア・ネットワークス	9.9	11.7	23,341
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	－	2.4	4,106
フォーカスシステムズ	8	6.5	6,838
クレスコ	3.7	6.5	12,200
フジ・メディア・ホールディングス	124.9	101.9	157,129
オービック	41.8	36.7	575,456
ジャストシステム	17.1	17.2	99,072
ＴＤＣソフト	10.5	9.3	9,030
Ｚホールディングス	785.1	1,452.9	634,917
トレンドマイクロ	64.2	47	284,350
ＩＤホールディングス	3.4	4.1	6,490
日本オラクル	24.4	21.4	211,218
アルファシステムズ	4	3.3	9,603
フューチャー	16.3	12.7	23,863
CAC Holdings	9.1	6.8	10,159
ＳＢテクノロジー	5.1	3.8	9,222
トーセ	3.3	2.9	2,726
オービックビジネスコンサルタント	12.4	10.8	47,250
伊藤忠テクノソリューションズ	54.9	48.2	161,229
アイティフォー	14.6	12.9	10,203
東計電算	1.8	1.5	6,442
エックスネット	2.3	1.6	1,545
大塚商会	65.1	57.2	291,148
サイボウズ	14.1	12.3	25,694
ソフトブレーン	9.5	6.2	3,546
電通国際情報サービス	7.4	6.5	30,745
デジタルガレージ	23.5	19.1	81,079
イーエムシステムズ	9.7	14.9	13,737
ウェザーニューズ	4.1	3.6	14,058
ＣＩＪ	9.5	7.9	6,904
ビジネスエンジニアリング	1.1	1.2	4,068
日本エンタープライズ	12.7	10.8	2,862
WOWOW	5.7	5.1	13,851
スカラ	9.7	7.5	5,670
インテリジェント ウェイブ	－	4	3,096
IMAGICA GROUP	10.2	9	4,626
ネットワンシステムズ	42.7	40.3	77,617
システムソフト	29.1	26.3	2,630
アルゴグラフィックス	5.1	9	35,820
マーベラス	18.4	16.1	11,414
エイベックス	20.7	18.2	23,587
日本ユニシス	37.6	33	126,060
兼松エレクトロニクス	6.5	5.7	20,605
東京放送ホールディングス	79.8	64.4	135,368
日本テレビホールディングス	110.5	88.3	137,218
朝日放送グループホールディングス	12.1	10.5	7,896
テレビ朝日ホールディングス	33.1	29.1	63,292
スカパーＪＳＡＴホールディングス	92	69.6	33,756
テレビ東京ホールディングス	9.9	8.7	21,341
日本ＢＳ放送	4.2	3.6	4,478
ビジョン	3.8	9.9	13,988
スマートバリュー	－	3.1	2,563
USEN-NEXT HOLDINGS	4.6	4	7,148
ワイヤレスゲート	5.3	5	3,985
コネクシオ	8.6	6	9,450
日本通信	102.6	81.8	18,895
クロップス	2.3	1.9	1,664
日本電信電話	823.5	1,414.3	4,031,462
ＫＤＤＩ	1,061.1	788.5	2,689,573
ソフトバンク	957.3	961.6	1,457,785
光通信	14.2	10.9	295,717
ＮＴＴドコモ	864.6	781.6	2,451,097
エムティーアイ	14.1	10.2	7,221
GMOインターネット	43.8	41.7	89,363
ファイバーゲート	－	2	2,584
アイドママーケティングコミュニケーション	2.5	3.2	1,955
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	35.1	28.5	52,212
学研ホールディングス	4.1	3.6	25,560
ゼンリン	24	21.1	33,422
昭文社	5.4	5	1,900
インプレスホールディングス	9.7	8.8	1,689
アイネット	6.8	5.4	8,694
松竹	7.9	7	106,260
東宝	79.2	63.2	265,756
東映	5.1	4	61,920
エヌ・ティ・ティ・データ	320.7	281.7	416,634
ピー・シー・エー	1.6	1.3	5,785
ビジネスブレイン太田昭和	2.1	1.8	5,202
ＤＴＳ	13.5	23.7	55,126
スクウェア・エニックス・ホールディングス	56	45.1	232,716
シーイーシー	12.9	11.3	24,069
カプコン	51.6	49.9	163,921
アイ・エス・ビー	2.4	2	3,918
ジャステック	7	6.7	7,323
ＳＣＳＫ	31.8	24.4	149,572
日本システムウエア	4	3.5	8,330
アイネス	15.2	10.4	18,106
ＴＫＣ	10.1	9	50,760
富士ソフト	18	13.6	62,832
ＮＳＤ	19.7	34.8	65,110
コナミホールディングス	49.3	38.5	169,015
福井コンピュータホールディングス	4	4.2	14,112
ＪＢＣＣホールディングス	9.5	7.1	15,030
ミロク情報サービス	12	9.3	26,709
ソフトバンクグループ	503.2	839.5	4,251,228
卸売業（5.0%）			
ホウスイ	0.9	0.9	846
高千穂交易	4.7	4.1	4,805
伊藤忠食品	2.9	2.4	12,480
エレマテック	5.6	9.9	10,355
ＪＡＬＵＸ	3.4	3.1	7,402
あらた	6.7	8.5	39,525
トーメンデバイス	1.9	1.6	6,368
東京エレクトロン デバイス	4.4	3.9	10,288
フィールズ	10.5	8.2	4,682
双日	667.4	586.6	208,829
アルフレッサ ホールディングス	134.3	118	280,486
横浜冷凍	31.7	29.9	29,571
神栄	1.6	1.5	1,194
ラサ商事	6.5	5.6	5,264
ラクーンホールディングス	7.1	5.1	4,166
アルコニックス	12.8	11.2	14,907
神戸物産	18.3	36.6	159,942
あい ホールディングス	17.2	15.2	28,484
ディーブイエックス	4.2	3.8	3,587
ダイワボウホールディングス	11	9.1	58,149
マクニカ・富士エレホールディングス	33.5	25.3	45,109
ラクト・ジャパン	2.7	4	17,060
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22.9	20	21,300
八洲電機	9.5	8.3	7,660
メディアスホールディングス	6.7	6	4,920
レスターホールディングス	7.7	11.1	21,101
ジューテックホールディングス	2.7	2.3	2,674

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
大光	3	4.6	3,091
OCHIホールディングス	3.4	3.1	4,637
TOKAIホールディングス	63.9	56.2	57,492
黒谷	2	1.9	955
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1.9	1.8	1,476
三洋貿易	6.1	10.6	14,087
ビューティガレージ	1.8	1.7	3,728
ウイン・パートナーズ	7.8	7.6	8,648
ミタチ産業	2.9	3.2	2,323
シップヘルスケアホールディングス	25.1	17	86,700
明治電機工業	3.9	3.4	5,168
デリカフーズホールディングス	2.2	3.9	2,800
スターティアホールディングス	2.4	2.4	1,896
コメダホールディングス	27.7	23.2	51,341
アセンテック	－	0.8	1,988
富士興産	4.6	3.3	2,316
協栄産業	1.4	1.2	1,744
小野建	10.6	9.6	13,180
南陽	2.5	2.1	3,897
佐鳥電機	9	7.9	6,975
エコートレーディング	2.6	2.3	1,324
伯東	8.3	6.5	8,469
コンドーテック	9.4	8.3	9,785
中山福	6.6	6.2	3,224
ナガイレーベン	17.4	15.4	37,545
三菱食品	13.4	11.6	37,062
松田産業	8.9	7.8	12,347
第一興商	18	15.8	84,688
メディパルホールディングス	130.5	114.6	285,468
ＳＰＫ	2.5	2.2	5,902
萩原電気ホールディングス	4.5	4	10,240
アズワン	8.7	6.9	66,171
スズデン	4.3	3.7	5,320
尾家産業	3.4	3.1	4,144
シモジマ	7.4	6.5	7,592
ドウシシャ	11.4	10.1	16,998
小津産業	2.6	2.3	4,232
高速	7.3	6.3	7,774
たけびし	4.3	3.5	5,148
リックス	2.7	2.3	3,877
丸文	10.7	9.4	6,063
ハピネット	10.1	8.9	12,050
橋本総業ホールディングス	2.4	2.1	3,876
日本ライフライン	37.9	31.4	46,597
タカショー	6.1	5.4	2,543
エクセル	4.5	3.1	4,947
マルカ	4	3.8	8,200
ＩＤＯＭ	40.7	28.7	16,646
進和	7.1	6.3	14,357
エスケイジャパン	2.9	2.2	987
ダイトロン	5.5	4.5	8,577
シークス	15.3	13.5	17,536
田中商事	3.7	3.4	2,482
オーハシテクニカ	6.8	5.9	9,971
白銅	4	3.9	6,056
伊藤忠商事	845.4	742.8	1,996,646
丸紅	1,191.9	1,105.3	893,635
高島	2	1.6	3,155
長瀬産業	68	59.8	91,075
蝶理	7.7	6.8	15,177
豊田通商	134.9	118.5	450,892
三共生興	20.7	16	9,408
兼松	48.3	39.6	54,370
ツカモトコーポレーション	2.2	1.8	2,070
三井物産	995.7	933.4	1,849,065
日本紙パルプ商事	6.9	6	24,300
日立ハイテクノロジーズ	36.7	36.9	295,938
カメイ	15.8	13.9	16,429
東都水産	1.8	1.3	3,849
OUGホールディングス	2.1	1.6	4,336
スターゼン	4.5	3.9	17,628
山善	47.2	41.4	43,304
椿本興業	2.7	1.9	7,809
住友商事	714.7	670	1,139,335
内田洋行	5.5	4.5	30,735
三菱商事	848	745.2	2,175,984
第一実業	5.5	5.2	19,344
キヤノンマーケティングジャパン	34.5	30.4	84,116
西華産業	6.8	6	7,854
佐藤商事	10.9	8.8	8,404
菱洋エレクトロ	12.3	10.8	19,980
東京産業	12.1	9.6	5,865
ユアサ商事	12.4	10.1	35,754
神鋼商事	2.7	2.7	6,782
小林産業	7	6.3	1,801
阪和興業	21	19.9	54,824
正栄食品工業	6.4	6.8	26,418
カナデン	11.7	8.6	11,653
菱電商事	9.6	7.6	12,714
フルサト工業	6.7	5.9	10,112
岩谷産業	26.7	23.6	86,612
すてきナイスグループ	5	4.6	5,920
昭光通商	4.4	3.5	2,502
ニチモウ	1.9	1.7	3,456
極東貿易	3.8	3.1	6,668
イワキ	14.5	14	7,238
三愛石油	32.4	26.1	31,554
稲畑産業	29	23.4	36,199
ＧＳＩクレオス	3.2	2.5	3,105
明和産業	11.4	9.8	5,958
クワザワ	－	3.8	2,546
ワキタ	25.8	22.6	23,843
東邦ホールディングス	35.8	34.1	80,919
サンゲツ	36.5	29.2	55,918
ミツウロコグループホールディングス	17.5	15.7	19,468
シナネンホールディングス	5	4.4	9,380
伊藤忠エネクス	26.6	23.5	22,795
サンリオ	37.3	29.8	66,126
サンワ　テクノス	7.3	7.5	7,080
リョーサン	13.4	11.7	29,987
新光商事	11.4	16.7	14,462
トーホー	5.5	4.8	8,793
三信電気	10	5.7	9,957
東陽テクニカ	14	12.2	13,383
モスフードサービス	15.9	14	43,190
加賀電子	12.1	10.6	25,185
ソーダニッカ	12.7	10.8	7,030
立花エレテック	9	7.9	14,472
フォーバル	5.3	4.7	5,593
ＰＡＬＴＡＣ	21.8	17	92,140
三谷産業	14.4	14.2	5,012
太平洋興発	4.9	4.1	3,275
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2.8	1.9	6,868
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	0.8	1,697
国際紙パルプ商事	21.2	25.2	7,207
ヤマタネ	6.1	5.3	8,278
丸紅建材リース	1.1	1	1,903
日鉄物産	8.7	7.5	36,450
泉州電業	4.1	3.3	10,246
トラスコ中山	25.1	22.1	57,658
オートバックスセブン	48	39.4	63,906
モリト	8.9	7.8	6,263
加藤産業	18.9	16.6	59,843
北恵	2.3	2	1,836
イノテック	8.3	6.3	7,276
イエローハット	11.4	20.1	35,175
ＪＫホールディングス	11.1	9.6	7,344
日伝	10	9.6	19,641
北沢産業	9.2	7.8	2,121
杉本商事	6.6	5.7	11,451
因幡電機産業	17.1	30.2	83,321
パイテックホールディングス	5.4	－	－
東テク	4.1	3.5	9,607
ミスミグループ本社	151.3	133	374,395
アルテック	8.7	8.6	2,347
タキヒヨー	3.8	3.1	6,001
蔵王産業	2.1	2.1	3,114
スズケン	55.1	45	201,825
ジェコス	8.5	7.3	7,927
グローセル	11.2	9.4	4,267
小売業（4.5%）			
ローソン	30.6	26.8	171,252
サンエー	9.2	8.9	41,162
カワチ薬品	9.4	8.3	18,475
エービーシー・マート	18.9	16.6	119,852
ハードオフコーポレーション	4.8	4.2	3,444
アスクル	12.7	11.1	39,793
ゲオホールディングス	18.4	19.1	23,875
アダストリア	16.7	14.7	31,399
ジーフット	7.4	6.4	4,019
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1.5	1.5	1,005
くら寿司	7.1	5.5	32,120
キャンドゥ	5.7	5.1	8,583
パルグループホールディングス	6.2	5.4	18,360
エディオン	51.1	48.8	51,776
サーラコーポレーション	24.5	21.6	13,629
ワッツ	4.1	4.8	3,009
ハローズ	4.6	4	11,320
フジオフードシステム	－	9	15,921
あみやき亭	2.7	2.2	7,755
ひらまつ	24.1	19.6	5,370
大黒天物産	2.8	2.5	9,075
ハニーズホールディングス	11.8	9.4	13,084
ファーマライズホールディングス	2.7	2.5	1,647
アルペン	9.3	8.2	15,662
ハブ	3.9	3.1	3,248
クオールホールディングス	17.7	15.6	23,524
ジンズホールディングス	8.1	5.6	43,568
ビックカメラ	64.5	62.9	74,725
ＤＣＭホールディングス	65.1	57.3	60,909
ペッパーフードサービス	9.5	8.5	8,058
ＭｏｎｏｔａＲＯ	76.3	75.5	212,608
東京一番フーズ	2.5	2.7	1,674
ＤＤホールディングス	2.7	4.2	7,018
きちりホールディングス	3.1	2.9	2,259
アークランドサービスホールディングス	8.9	7.8	15,834
Ｊ．フロント　リテイリング	154.5	126.8	170,672
ドトール・日レスホールディングス	21.2	16.9	35,743
マツモトキヨシホールディングス	50	43.9	194,696
ブロンコビリー	6.3	5.5	14,613
ＺＯＺＯ	130.6	73	131,911
トレジャー・ファクトリー	3.7	3.2	2,784
物語コーポレーション	3.4	2.7	24,354
ココカラファイン	13.6	11.1	62,826
三越伊勢丹ホールディングス	225.9	185.6	157,388
Ｈａｍｅｅ	3.1	3.3	5,610
ウエルシアホールディングス	32	31.6	199,712
クリエイトＳＤホールディングス	17.7	17.8	51,317
丸善ＣＨＩホールディングス	14.5	12.4	4,563
ミサワ	2.4	2.1	1,409
ティーライフ	1.6	1.4	1,278
エー・ピーカンパニー	2.3	2	1,278
チムニー	3.8	3.3	7,761
シュッピン	8.1	7.2	7,718

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
ネクステージ	18.6	15.2	16,248
ジョイフル本田	35.4	31.1	42,855
鳥貴族	4	3.5	8,925
キリン堂ホールディングス	4.8	4.2	7,564
ホットランド	6.3	7.1	9,251
すかいらーくホールディングス	112.6	119	245,616
ＳＦＰホールディングス	－	4.5	10,111
綿半ホールディングス	4.5	4	7,804
ヨシックス	2	1.7	4,807
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	35.2	30.9	30,312
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.9	4.9	3,155
ＢＥＥＮＯＳ	2.8	4	5,100
あさひ	10	8	10,792
日本調剤	4.3	3.3	12,490
コスモス薬品	5.3	4.7	117,970
トーエル	5.8	5.2	4,284
オンリー	2.2	1.8	1,429
セブン&アイ・ホールディングス	506.6	415.4	1,814,051
薬王堂	5.2	－	－
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32.6	28.6	67,467
ツルハホールディングス	26.2	23.1	313,236
サンマルクホールディングス	9.5	8.4	18,740
フェリシモ	2.7	2.3	2,288
トリドールホールディングス	14.9	13.2	35,204
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	10.7	9.6	4,992
ウイルプラスホールディングス	1.1	1.6	1,456
ＪＭホールディングス	4.6	5.4	12,630
サツドラホールディングス	2	1.5	2,820
デファクトスタンダード	0.7	－	－
アレンザホールディングス	6.5	5.3	5,353
串カツ田中ホールディングス	－	1.6	3,780
パロックジャパンリミテッド	9.7	7.3	7,248
クスリのアオキホールディングス	12	9.5	66,690
力の源ホールディングス	3.4	4.8	4,944
スシローグローバルホールディングス	13.3	11.6	113,680
ＬＩＸＩＬビバ	10.2	10.5	23,425
メディカルシステムネットワーク	12.9	10.3	5,191
はるやまホールディングス	5.5	4.5	3,955
ノジマ	21.6	18.9	43,791
カッパ・クリエイト	16.9	14.9	22,156
ライトオン	10.2	8	4,792
ジーンズメイト	3.7	3.4	1,016
良品計画	17.1	141	263,952
三城ホールディングス	15.1	11.5	3,967
アドヴァン	18.6	16.2	20,930
アルビス	4.6	4	8,936
コナカ	15.7	12.5	5,100
ハウス　オブ　ローゼ	1.5	1.3	2,204
Ｇ－７ホールディングス	3.5	6.2	15,276
イオン北海道	12.3	10.7	8,923
コジマ	17.7	18.3	9,497
ヒマラヤ	3.9	3.5	2,901
コーナン商事	15.9	15.1	37,463
エコス	4.5	3.9	6,704
ワタミ	15.9	12.5	16,162
マルシェ	3.3	2.9	2,273
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	72.5	233.4	470,067
西松屋チェーン	26.5	23.3	22,694
ゼンショーホールディングス	57	50.9	122,770
幸楽苑ホールディングス	7.6	6.7	13,004
ハークスレイ	2.7	2	2,494
サイゼリヤ	19.9	17.5	44,135
ＶＴホールディングス	41	44.1	19,977
魚力	3.4	3	4,821
ポプラ	3.1	2.8	1,430
フジ・コーポレーション	2.5	2.9	6,148
ユナイテッドアローズ	13.9	11.1	31,956
ハイデイ日高	15.9	15.3	31,043
京都きもの友禅	7.7	7	2,373
コロワイド	40.2	35.3	78,366
ピーシーデポコーポレーション	16	14.1	7,896
壱番屋	8.6	7.4	42,994
トップカルチャー	4.6	3.9	1,294
ＰＬＡＮＴ	2.9	2.8	1,582
スギホールディングス	26.5	21.2	117,872
薬王堂ホールディングス	－	4.6	10,363
ヴィア・ホールディングス	14.8	13.1	8,803
スクロール	18.6	16.3	5,900
ヨンドシーホールディングス	13.5	10.8	26,784
ファミリーマート	33.8	84.9	212,844
木曽路	14.8	13.9	41,769
ＳＲＳホールディングス	14.3	12.5	13,175
千趣会	21.9	19.2	9,388
タカキュー	9.2	8.6	1,599
ケーヨー	22.4	21.8	12,164
上新電機	14.3	12.5	28,912
日本瓦斯	19.6	16.8	61,236
ロイヤルホールディングス	21.4	18.6	44,993
東天紅	0.8	0.8	1,017
いなげや	13.6	13.2	19,892
島忠	27.3	20	65,900
チヨダ	12.7	11.1	16,772
ライフコーポレーション	9.2	8.1	22,113
リンガーハット	14.9	13.1	32,619
ＭｒＭａｘＨＤ	16.6	14.6	6,978
テンアライド	11.5	9.8	4,380
ＡＯＫＩホールディングス	24.2	21.2	22,493
オークワ	17.2	16.6	25,564
コメリ	18.7	16.4	39,064
青山商事	21.1	21.9	30,922
しまむら	14.1	12.3	101,967
はせがわ	6.1	5.3	2,120
高島屋	94.7	77.4	93,499
松屋	24.3	21.4	16,692
エイチ・ツー・オー　リテイリング	62.1	50.3	50,853
近鉄百貨店	4.7	4	14,440
パルコ	11.7	10.2	18,849
丸井グループ	102.3	97.3	232,255
アクシアル　リテイリング	10	8.8	34,056
井筒屋	6.4	5.8	1,421
イオン	465.1	408.7	958,197
イズミ	24.5	21.6	77,112
平和堂	24.5	21.5	42,462
フジ	14.6	12.9	24,355
ヤオコー	13.8	12	69,720
ゼビオホールディングス	14.6	12.9	15,531
ケーズホールディングス	125.5	102.5	144,627
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7.1	5.5	3,371
日産東京販売ホールディングス	18.2	15.9	4,436
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4.7	5.2	10,634
ナルミヤ・インターナショナル	－	1.8	2,201
総合メディカルホールディングス	10.5	9.3	23,696
ブックオフグループホールディングス	6.4	6.2	6,237
アインホールディングス	16.2	13.1	91,700
元気寿司	3.4	2.7	8,410
ヤマダ電機	368	323.6	189,953
アークランドサカモト	20.5	16.6	20,484
ニトリホールディングス	52.4	46	809,600
グルメ杵屋	8.8	7.5	9,067
愛眼	9.7	8.3	2,116
ケーユーホールディングス	6.2	5.5	5,109
吉野家ホールディングス	42.3	34.9	89,972
松屋フーズホールディングス	5.8	5.1	24,505
サガミホールディングス	16.2	14.2	19,894
関西スーパーマーケット	9.2	8.9	9,238
王将フードサービス	8.9	7.8	51,324
プレナス	13.6	11.9	23,919
ミニストップ	9	7.9	12,829
アークス	22.7	21.7	43,638
パローホールディングス	26.1	23.5	46,788
藤久	0.9	0.9	648
ベルク	5.9	5.2	31,824
大　庄	6.5	5.7	9,547
ファーストリテイリング	16.2	14.2	830,984
サンドラッグ	45.4	40	149,800
サックスバー　ホールディングス	10.2	9	7,731
ヤマザワ	2.4	2	3,380
やまや	2.1	2.1	4,735
ベルーナ	29.6	22.7	14,709
銀行業（5.6％）			
島根銀行	2.7	2.1	1,365
じもとホールディングス	82.1	72.2	7,581
めぶきフィナンシャルグループ	628.6	552.6	138,702
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16.3	14.4	18,561
九州フィナンシャルグループ	198.5	174.5	81,666
ゆうちょ銀行	343.1	301.3	315,461
富山第一銀行	29.2	25.4	8,458
コンコルディア・フィナンシャルグループ	770.7	625.3	273,256
西日本フィナンシャルホールディングス	77.4	72.5	53,505
関西みらいフィナンシャルグループ	56.8	62.4	38,313
三十三フィナンシャルグループ	10.4	9.9	16,077
第四北越フィナンシャルグループ	21	18.5	50,412
新生銀行	88.8	78	134,862
あおぞら銀行	67.5	63.3	196,230
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,428.8	7,320.8	4,241,671
りそなホールディングス	1,328	1,167	544,288
三井住友トラスト・ホールディングス	237.9	201	823,899
三井住友フィナンシャルグループ	853	735.5	2,908,167
千葉銀行	428.7	365.7	228,562
群馬銀行	242	209	76,494
武蔵野銀行	18	15.8	27,792
千葉興業銀行	33.3	29.2	10,482
筑波銀行	50.4	44.4	9,590
七十七銀行	37.9	35.9	60,778
青森銀行	9.4	8.3	22,858
秋田銀行	7.7	6.8	13,878
山形銀行	13.7	11.9	17,695
岩手銀行	8.5	6.9	18,126
東邦銀行	108.2	95.1	24,250
東北銀行	6.3	5.1	5,293
みちのく銀行	7.7	6.8	9,676
ふくおかフィナンシャルグループ	98.3	89.5	178,821
静岡銀行	304.5	263.3	207,480
十六銀行	16.2	13.4	30,337
スルガ銀行	123.7	108.8	47,219
八十二銀行	218.9	256.7	110,381
山梨中央銀行	15	12.3	12,915
大垣共立銀行	19.1	21	48,384
福井銀行	10.3	9.1	15,233
北國銀行	12.9	10.9	34,662
清水銀行	5	4.4	9,332
富山銀行	2.3	2	4,382
滋賀銀行	24.2	21.3	57,211
南都銀行	14.2	17.6	46,622
百五銀行	108.8	95.7	32,155
京都銀行	43.4	38	173,470
紀陽銀行	42.9	37.6	61,250
ほくほくフィナンシャルグループ	80.6	70.7	75,861
広島銀行	178.5	157.1	85,148
山陰合同銀行	71.8	63	39,627
中国銀行	78.1	91.5	93,970
鳥取銀行	4.3	3.7	4,876
伊予銀行	160.3	151.7	87,379
百十四銀行	12.9	11.3	23,345

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
四国銀行	17.3	16.1	15,520
阿波銀行	19.4	17.3	41,502
大分銀行	7.4	6.1	15,701
宮崎銀行	8	7	17,465
佐賀銀行	7.3	6.4	10,067
十八銀行	7.4	–	–
沖縄銀行	11.1	9.7	35,405
琉球銀行	27.9	24.6	27,232
セブン銀行	408.8	355.3	116,538
みずほフィナンシャルグループ	16,445.7	14,451.2	2,378,667
高知銀行	4.5	4	3,368
山口フィナンシャルグループ	151.1	132.8	90,702
長野銀行	4.1	3.5	5,425
名古屋銀行	9.8	8.6	28,896
北洋銀行	182.3	160.2	35,884
愛知銀行	4.4	3.9	13,338
中京銀行	5	4.4	9,966
大光銀行	4	3.7	6,167
愛媛銀行	16.9	14.9	16,837
トマト銀行	4.8	4.1	4,288
京葉銀行	53.4	45.3	26,817
栃木銀行	62.7	51.4	10,999
北日本銀行	3.9	3.4	7,432
東和銀行	21.2	18.7	15,521
福島銀行	10.5	10.4	2,444
大東銀行	5.8	5.6	3,589
トモニホールディングス	93.5	82.3	30,780
フィデアホールディングス	117.8	103.6	13,157
池田泉州ホールディングス	128.5	122.8	24,068
証券、商品先物取引業（0.8%）			
ＦＰＧ	38.7	32.8	33,292
マーキュリアインベストメント	4.7	4.7	3,431
ＳＢＩホールディングス	144.2	118.8	294,742
日本アジア投資	10.5	9.3	2,576
ジャフコ	19.8	16.3	81,418
大和証券グループ本社	971.1	853.2	484,020
野村ホールディングス	2,129.4	1,871.3	1,050,922
岡三証券グループ	103.1	90.6	37,508
丸三証券	35.9	31.5	16,821
東洋証券	43.4	38.2	5,806
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	144.3	122	43,432
光世証券	2.9	2.5	1,512
水戸証券	35.1	30.8	7,114
いちよし証券	25.4	19.8	12,375
松井証券	59.3	60.7	54,751
だいこう証券ビジネス	5	5.2	3,614
マネックスグループ	113	80.3	20,717
カブドットコム証券	90.4	–	–
極東証券	16.2	14.3	11,211
岩井コスモホールディングス	12.4	10	13,050
藍澤證券	22.7	19.1	14,248
マネーパートナーズグループ	14.2	11.5	2,702
スパークス・グループ	–	36.8	10,377
小林洋行	3.4	3.2	870
保険業（2.3%）			
かんぽ生命保険	45.7	37.6	70,876
ＳＯＭＰＯホールディングス	213.3	200	854,200
アニコム　ホールディングス	9.4	8.8	36,036
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	316.5	278	1,036,662
ソニーフィナンシャルホールディングス	99.4	87.4	231,959
第一生命ホールディングス	684.7	601.8	1,065,787
東京海上ホールディングス	438.8	380.3	2,362,803
Ｔ＆Ｄホールディングス	374.2	317.8	409,644
アドバンスクリエイト	2.8	2.4	4,425
その他金融業（1.2%）			
全国保証	34.1	30	134,550
ジェイリース	2.6	3	1,158
イントラスト	3.4	3.8	2,956

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
日本モーゲージサービス	1.6	2.1	4,162
ＣＡＳＡ	4.1	3.7	5,601
アルヒ	11	16.9	27,276
プレミアグループ	2.5	5.8	11,820
クレディセゾン	84.7	74.5	138,123
芙蓉総合リース	13.9	11.1	80,142
みずほリース	22.7	16.4	56,088
東京センチュリー	24.4	21.4	113,634
日本証券金融	53.3	46.8	24,195
アイフル	184.4	162.3	50,962
リコーリース	9.5	8.4	36,078
イオンフィナンシャルサービス	77.2	65.1	115,682
アコム	243.2	213.7	112,619
ジャックス	13.4	11.7	31,379
オリエントコーポレーション	327.1	287.8	47,487
日立キャピタル	28.6	25.1	80,445
アプラスフィナンシャル	58.7	51.2	4,608
オリックス	807.5	665.2	1,290,488
三菱ＵＦＪリース	273.1	269.9	193,518
九州リースサービス	5.9	5	3,045
日本取引所グループ	326.8	305.3	623,422
イー・ギャランティ	11.3	11.4	15,846
アサックス	4.9	5.5	3,982
ＮＥＣキャピタルソリューション	5	4.3	10,689
不動産業（2.5%）			
いちご	153.9	135.3	57,231
日本駐車場開発	145.8	117.2	17,697
スター・マイカ・ホールディングス	–	5.5	9,449
ヒューリック	252.6	227.1	309,764
三栄建築設計	4.9	4.3	6,471
スター・マイカ	5.5	–	–
野村不動産ホールディングス	80.6	64.5	177,246
三重交通グループホールディングス	24.6	21.5	12,900
サムティ	16.7	15.1	28,478
ディア・ライフ	15.4	13.7	8,329
コーセーアールイー	3.7	3.2	1,987
エー・ディー・ワークス	171.5	201.8	5,852
日本商業開発	7.5	6.7	11,537
プレサンスコーポレーション	19.1	17.4	23,403
ユニゾホールディングス	18.3	16	89,120
ＴＨＥグローバル社	5.5	5.5	2,519
ハウスコム	–	1.4	2,223
日本管理センター	7.9	7	9,646
サンセイランディック	3.2	3.2	2,844
エストラスト	1.6	1.4	1,234
フージャースホールディングス	27	21.2	14,946
オープンハウス	19.7	30.9	93,781
東急不動産ホールディングス	325.4	289.3	231,440
飯田グループホールディングス	101	88.7	167,465
イーグランド	1.8	1.7	1,456
ムゲンエステート	8.5	7.3	5,088
ビーロット	2	2.4	4,404
ファーストブラザーズ	3.3	2.4	2,935
ハウスドゥ	4.5	5.9	7,734
シーアールイー	4	2.7	3,107
プロパティエージェント	1.1	1.6	1,851
ケイアイスター不動産	3.2	3.4	6,558
アグレ都市デザイン	1.5	1.5	784
グッドコムアセット	2.2	2.4	5,246
ジェイ・エス・ビー	0.4	1.1	5,841
テンポイノベーション	–	2.4	2,212
グローバル・リンク・マネジメント	–	1.7	1,037
パーク２４	70.6	57.1	158,452
パラカ	3.1	2.8	5,695
三井不動産	642.2	524.5	1,583,990
三菱地所	847.9	745.2	1,626,026
平和不動産	23	19.5	66,787
東京建物	132.2	116.3	207,944

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
ダイビル	35.6	27.4	38,442
京阪神ビルディング	21.7	17.2	25,765
住友不動産	272	239.1	1,006,371
テーオーシー	27.7	20.9	19,855
東京楽天地	1.9	1.4	8,540
レオパレス２１	149.3	139.4	45,862
スターツコーポレーション	16.4	14.5	39,222
フジ住宅	15.4	12.4	8,543
空港施設	14.4	10.8	5,950
明和地所	6.7	5.9	3,681
ゴールドクレスト	9.5	8.4	16,447
エスリード	4.7	4.2	8,177
日神グループホールディングス	17.8	15.7	8,697
日本エスコン	21.9	19.2	17,683
タカラレーベン	56.6	48.7	24,398
ＡＶＡＮＴＩＡ	6.8	6	6,012
イオンモール	60.6	53.3	101,270
毎日コムネット	–	2.2	2,054
ファースト住建	4.6	4.6	5,754
ランド	492.6	589.5	6,484
カチタス	13.5	13.2	57,816
トーセイ	16.6	14.7	21,226
穴吹興産	1.3	2.2	3,839
サンフロンティア不動産	16.7	14.7	19,845
エフ・ジェー・ネクスト	10.5	9.3	11,104
インテリックス	3.5	3.1	2,256
ランドビジネス	6.2	4.3	3,220
日本社宅サービス	–	2.8	3,068
グランディハウス	10.6	8.3	4,257
日本空港ビルデング	38.6	34	187,000
サービス業（5.2%）			
日本工営	7.8	6.9	25,047
ＬＩＦＵＬＬ	40.7	36	20,988
ジェイエイシーリクルートメント	9.4	6.9	11,861
日本Ｍ＆Ａセンター	87.3	77.8	297,974
メンバーズ	4	3.1	5,164
中広	1.1	1.1	606
ＵＴグループ	–	12.1	31,798
アイティメディア	–	3.1	3,295
タケエイ	12.2	9.9	10,692
Ｅ・Ｊホールディングス	1.5	1.2	2,104
ビーネックスグループ	5.6	11.3	12,825
コシダカホールディングス	31.3	24.8	38,564
アルトナー	2.2	2.5	2,115
パソナグループ	14.3	11.1	15,873
ＣＤＳ	2.9	2.5	3,817
リンクアンドモチベーション	21.6	22.7	12,598
ＧＣＡ	12	12.4	11,656
エス・エム・エス	43.1	32	75,008
サニーサイドアップグループ	–	2.3	2,467
パーソルホールディングス	117.3	103	224,334
リニカル	6.6	5	5,445
クックパッド	36.7	36.1	11,876
エスクリ	3.2	3.3	2,554
アイ・ケイ・ケイ	5.8	5.1	3,768
学情	4.7	3.7	8,839
スタジオアリス	5.8	5.2	9,916
シミックホールディングス	6.5	5.7	9,792
エプコ	–	1.6	2,208
ＮＪＳ	2.6	2.2	3,984
綜合警備保障	46.6	41	234,110
カカクコム	88.3	77.1	237,468
アイロムグループ	4.5	3.7	5,979
セントケア・ホールディング	6.4	6.7	3,202
サイネックス	1.8	1.7	1,166
ルネサンス	6.5	5.7	10,014
ディップ	18.9	14.5	53,287
オプトホールディング	7.1	5.6	9,077

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
新日本科学	15.9	11.2	7,033
ツクイ	27.6	24.3	14,045
キャリアデザインセンター	3	2.7	3,310
ベネフィット・ワン	16.2	28.2	56,823
エムスリー	246.9	227.1	717,636
ツガ・グローバルホールディング	7.5	6.7	3,906
ブラス	0.8	0.8	642
アウトソーシング	61.8	59	58,705
ウェルネット	11.9	9.8	6,967
ワールドホールディングス	3.2	3.5	5,992
ディー・エヌ・エー	63.2	50.5	77,416
博報堂DYホールディングス	163	143.3	230,283
ぐるなび	16.6	18	15,588
タカミヤ	12.2	11	6,743
ジャパンベストレスキューシステム	9.3	6.9	6,575
ファンコミュニケーションズ	32.2	28.4	13,546
ライク	4.6	4.1	8,019
ビジネス・ブレークスルー	4.9	4.4	1,760
エスプール	－	19.9	16,954
WDBホールディングス	5.3	4.7	12,925
ティア	5.4	6.1	3,684
ＣＤＧ	1	1.1	1,548
バリューコマース	7.8	5.8	15,549
インフォマート	64.3	112.9	99,803
ＪＰホールディングス	33.5	32.4	10,335
エコナックホールディングス	22.2	18.8	2,838
ＥＰＳホールディングス	17.6	15.5	21,002
レッグス	2.9	2.5	3,937
ブレステージ・インターナショナル	22	38.6	39,951
アミューズ	7.1	5.6	15,870
ドリームインキュベータ	3.5	3.2	5,635
クイック	7.2	6.4	9,516
ＴＡＣ	6.8	6.7	1,413
ケネディクス	103	98	57,036
電通グループ	142.9	106.2	388,692
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.5	4	4,084
ぴあ	3.3	2.9	13,006
イオンファンタジー	3.8	4	9,696
シーティーエス	13.3	11.6	8,096
ネクシィーズグループ	3.7	3.6	5,770
みらかホールディングス	32.9	28.9	87,422
アルプス技研	10.2	9.1	19,383
サニックス	20.5	18.1	5,792
ダイオーズ	2.8	2	2,758
日本空調サービス	13.4	10.8	8,121
オリエンタルランド	138.6	109.5	1,605,270
ダスキン	31.6	26.4	80,784
明光ネットワークジャパン	14.8	12.1	11,567
ファルコホールディングス	6.5	5.7	12,323
秀英予備校	2.5	2.3	1,051
田谷	2.1	2	1,272
ラウンドワン	36.3	28.8	30,441
リゾートトラスト	49.6	47.2	83,449
ビー・エム・エル	15.1	13.3	42,227
ワタベウェディング	1.9	1.6	864
りらいあコミュニケーションズ	21.2	18.7	27,788
リソー教育	59.5	47.1	17,662
早稲田アカデミー	1.6	3.4	3,678
ユー・エス・エス	143.3	115.4	231,492
東京個別指導学院	4.2	3.7	2,641
サイバーエージェント	72.3	59.3	259,437
楽天	546.6	480.2	419,694
クリーク・アンド・リバー社	6.8	5.3	5,575
テー・オー・ダブリュー	11.2	9	8,361
山田コンサルティンググループ	－	5	7,390
セントラルスポーツ	4.4	3.9	11,973
フルキャストホールディングス	11.8	10.3	25,544
エン・ジャパン	12.8	18.4	85,560

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
リソルホールディングス	1.3	1	4,255
テクノプロ・ホールディングス	23.6	20.7	160,425
アトラ	2.3	2.3	731
インターワークス	2.3	1.9	1,035
アイ・アールジャパンホールディングス	3.8	4.2	25,620
ＫｅｅＰｅｒ技研	3.9	3.9	4,917
ファーストロジック	2.3	2.3	1,389
三機サービス	1.9	2.1	2,230
Ｇｕｎｏｓｙ	7.2	7.1	8,889
デザインワン・ジャパン	2.3	2	612
イー・ガーディアン	5.5	5.2	10,826
リブセンス	6.3	6.7	1,943
ジャパンマテリアル	32.1	31.7	51,956
ベクトル	14.3	12.9	15,763
ウチヤマホールディングス	5.9	5.2	2,631
チャーム・ケア・コーポレーション	－	7.5	6,787
ライクキッズ	2.5	2.4	2,056
キャリアリンク	4.3	3.4	1,989
ＩＢＪ	7.8	7	8,890
アサンテ	4.7	4.2	8,211
Ｎ・フィールド	7.5	7.1	4,409
バリューＨＲ	2.5	2	6,080
M&Aキャピタルパートナーズ	3	7.3	28,141
ライドオンエクスプレスホールディングス	4.8	3.9	7,335
ＥＲＩホールディングス	3.3	3	2,391
アピスト	1.9	1.6	4,214
シグマクシス	5.5	7	12,964
ウィルグループ	7.5	6.7	7,376
エスクロー・エージェント・ジャパン	16.1	14.5	3,175
日本ビューホテル	3.8	－	－
リクルートホールディングス	839.9	738	3,335,760
エラン	8	6.1	10,553
土木管理総合試験所	5.1	4.5	1,917
ネットマーケティング	－	3.8	3,792
日本郵政	961.1	844.5	870,257
ベルシステム24ホールディングス	19.6	17.2	27,124
鎌倉新書	8.6	7.6	13,026
ＳＭＮ	－	1.6	1,408
一蔵	1.5	1.1	759
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2.7	3.6	10,090
グローバルキッズCOMPANY	1.4	1.5	1,191
エアトリ	3.3	4.6	7,433
アトラエ	2.3	2.7	10,233
ストライク	3	3.9	20,358
ソラスト	28.5	28.4	32,972
セラク	2.6	3.3	4,217
インソース	3.9	5	16,325
ベイカレント・コンサルティング	6.2	6.2	51,398
Orchestra Holdings	－	2	2,392
アイモバイル	2.8	3.3	2,293
キャリアインデックス	4	4.2	1,575
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4.7	3.4	4,399
船場	2.1	1.7	1,762
グレイステクノロジー	3.2	4.7	14,476
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6.9	10.8	26,470
フルテック	1.3	1.2	1,422
グリーンズ	2.6	3.9	3,634
ツナググループ・ホールディングス	1	1.2	882
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	－	2.2	1,630
ソウルドアウト	－	1.6	3,478
MS&Consulting	－	1.4	1,568
日総工産	2.9	6.8	5,718
キューピーネットホールディングス	5.9	4.3	10,311
ＲＰＡホールディングス	－	5.8	6,119
スプリックス	3.3	3.5	3,941
マネジメントソリューションズ	－	1.1	3,982
アドバンテッジリスクマネジメント	4.6	5.2	4,680
リログループ	64.1	56.3	171,996

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
東祥	7.2	6.4	13,836
エイチ・アイ・エス	20.9	16	42,672
ラックランド	2.3	2.1	4,653
共立メンテナンス	17.8	17	77,860
イチネンホールディングス	12.3	11.5	17,342
建設技術研究所	8	7.1	17,366
スペース	7.6	6.7	8,220
長　大	4.7	3.8	4,742
燦ホールディングス	2.6	4.5	7,650
スバル興業	0.7	0.6	5,682
東京テアトル	4.6	4.1	5,629
タナベ経営	2.3	1.9	2,447
ナガワ	3.3	3.3	22,968
よみうりランド	2.6	2.2	9,779
東京都競馬	7.6	6.7	21,105
常磐興産	4.8	4.2	7,123
カナモト	17.4	16.8	47,107
東京ドーム	43.8	41.8	43,555
西尾レントオール	12	10.5	31,657
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	63	69	2,139
トランス・コスモス	13	9.8	28,586
乃村工藝社	27.3	44.2	57,902
藤田観光	4.7	4.5	12,325
KNT－CTホールディングス	6.3	6.4	8,499
日本管財	12.6	11	21,307
トーカイ	11.3	10	28,110
白洋舎	1.3	1.1	3,098
セコム	124.4	109.3	1,066,002
セントラル警備保障	5.6	5	29,800
丹青社	22.2	19.5	24,960
メイテック	14.8	12.7	79,756
応用地質	12.6	11.1	15,784
船井総研ホールディングス	24.3	21.3	68,905
進学会ホールディングス	5.2	4.1	2,099
オオバ	9.3	8.1	6,285
いであ	2.3	1.9	4,081
学究社	4	3.1	4,532
ベネッセホールディングス	43	34.3	107,016
イオンディライト	14.4	12.7	48,895
ナック	7.4	5.7	6,526
ニチイ学館	16.7	14.7	22,402
ダイセキ	19.6	17.2	51,600
ステップ	4.4	3.8	6,456
	千株	千株	千円
合計 株数・金額	142,571.8	127,662.7	263,153,477
合計 銘柄数<比率>	2,113銘柄	2,151銘柄	<97.6%>

（注１）銘柄欄の（　）内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。
（注２）合計欄の<　>内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。
（注３）評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
国内	TOPIX	百万円 6,514	百万円 －

■投資信託財産の構成

2020年２月７日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	263,153,477	95.7
コール・ローン等、その他	11,850,991	4.3
投資信託財産総額	275,004,469	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年２月７日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**275,805,961,791円**
コール・ローン等	11,473,389,265
株式(評価額)	263,153,477,450
未収入金	140,926,920
未収配当金	415,029,156
差入委託証拠金	623,139,000
(B) 負債	**6,045,704,260**
未払金	5,048,362,260
未払解約金	193,592,000
差入委託証拠金代用有価証券	803,750,000
(C) 純資産総額(A－B)	**269,760,257,531**
元本	98,370,254,055
次期繰越損益金	171,390,003,476
(D) 受益権総口数	**98,370,254,055口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**27,423円**

(注１) 期首元本額 115,232,523,115円
追加設定元本額 39,816,140,869円
一部解約元本額 56,678,409,929円

(注２) 期末における元本の内訳

ＯｎｅＤＣ　国内株式インデックスファンド	13,753,125,332円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	2,300,256,155円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,872,943円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	5,009,685円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	7,743,904円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,418,134円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	18,818,754円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	10,586,919円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	545,594,662円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	324,239,506円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	10,938,893円
たわらノーロード　バランス（標準型）	67,669,431円
たわらノーロード　バランス（積極型）	103,376,978円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	439,198円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	31,315,589円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	98,543,681円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	66,484,262円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	135,912,579円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	193,848円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	830,832円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,814,864円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,287,993円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,036,718円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	36,349,147,451円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	994,502,045円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,256,411,336円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,366,803,245円
ＤＩＡＭＤＣ　バランス30インデックスファンド	348,375,776円
ＤＩＡＭＤＣ　バランス50インデックスファンド	1,182,324,299円
ＤＩＡＭＤＣ　バランス70インデックスファンド	1,119,029,562円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	38,945,261円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	1,120,067,435円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	25,180,737円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国10）	307,430,970円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国20）	239,536,588円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国30）	419,353,751円
投資のソムリエ	8,729,703,223円
クルーズコントロール	410,638,853円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	829,749,325円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	261,682,155円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	316,105,471円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	412,795円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	2,507,282円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	7,001,423円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	474,307,956円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	5,017,761,432円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	5,883,416円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	4,725,965円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,914,158円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	13,386,629円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	35,525,818円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,093,711,974円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	217,750,260円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	900,539円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	766,807円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	889,213円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	197,398円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12（適格機関投資家限定）	97,721,972円
ＤＩＡＭワールドバランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,537,910円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	748,659,317円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	42,276,864円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	90,882,753円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	205,217,487円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,081,740円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,099,169円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,085,281円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,090,446円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,577,334円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,241,538円
ＤＩＡＭバランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	856,834,056円
ＤＩＡＭバランスファンド37.5ＶＡ（適格機関投資家限定）	856,427,853円
ＤＩＡＭバランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,443,533,162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）	174,658,821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）	48,206,798円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	469,721,881円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	125,441,570円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド55ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,312,004円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド35ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,583,091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）	490,063,850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）	37,551,836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）	134,171,540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）	347,374,438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）	876,490,927円
ＤＩＡＭ世界バランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,451,662円
ＤＩＡＭ国内バランス30ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,728,407円
ＤＩＡＭバランス20ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,986,618円
ＤＩＡＭバランス40ＶＡ（適格機関投資家限定）	104,317円
ＤＩＡＭバランス60ＶＡ（適格機関投資家限定）	121,717円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ(1212)（適格機関投資家限定）	380,720,505円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ(1303)（適格機関投資家限定）	1,210,952,937円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ(1306)（適格機関投資家限定）	1,605,155,025円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ(1309)（適格機関投資家限定）	65,047,821円
期末元本合計	98,370,254,055円

(注３) 担保資産
代用として担保を提供している資産は次の通りです。
株式 1,965,500,000円

■損益の状況

当期　自2019年２月８日　至2020年２月７日

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日　2020年２月21日）

（計算期間　2019年２月22日～2020年２月21日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月10日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 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（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	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
13期（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
17期（2020年２月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	－	130,803

（注１）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

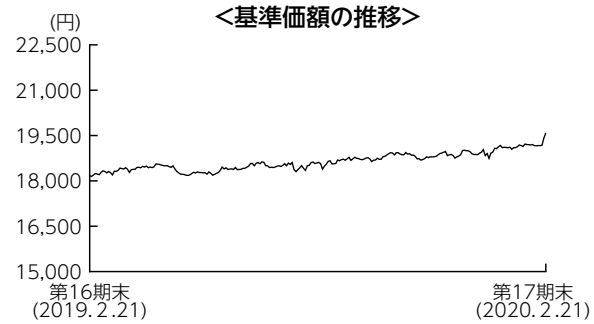
（注４）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

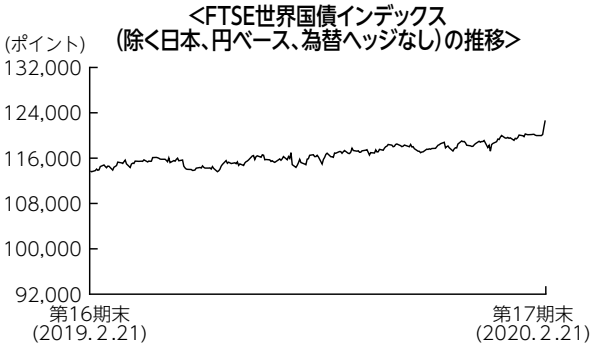
■当期中の基準価額と市況の推移

年　月　日	基準価額		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)(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)	円	%	ポイント	%	%	%
2019年2月21日	18,170	－	113,733.36	－	98.1	－
2月末	18,204	0.2	113,937.65	0.2	98.1	－
3月末	18,446	1.5	115,474.58	1.5	97.9	－
4月末	18,395	1.2	115,213.50	1.3	97.4	－
5月末	18,249	0.4	114,188.44	0.4	98.1	－
6月末	18,486	1.7	115,685.41	1.7	97.5	－
7月末	18,542	2.0	115,950.32	1.9	97.6	－
8月末	18,666	2.7	116,876.64	2.8	97.5	－
9月末	18,755	3.2	117,408.61	3.2	97.5	－
10月末	18,937	4.2	118,313.83	4.0	97.6	－
11月末	18,947	4.3	118,546.99	4.2	97.4	－
12月末	19,033	4.7	118,980.17	4.6	96.6	－
2020年1月末	19,188	5.6	120,069.31	5.6	96.8	－
(期末) 2020年2月21日	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	－

(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■**当期の運用経過**（2019年２月22日から2020年２月21日まで）





基準価額の推移

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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

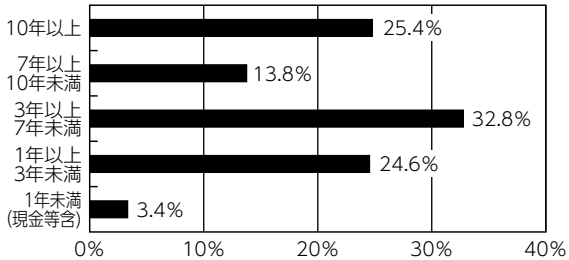
ベンチマークであるＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

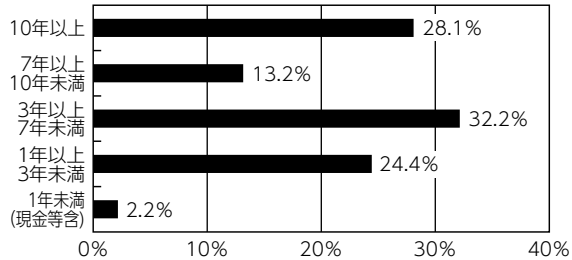
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

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

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で7.9％上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■１万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) その他費用	2円	0.012%
(保管費用)	(2)	(0.012)
(その他)	(0)	(0.000)
合計	2	0.012

（注）金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「１万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（18,642円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については７ページ（１万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2019年２月22日から2020年２月21日まで）

公社債

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

（注）金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

（注1）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注2）組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,141	127,937	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,670	2,198	246,491	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	2,090	2,464	276,266	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	5,180	5,344	599,195	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	770	896	100,453	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	2,400	2,548	285,754	2049/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.1250	11,000	11,108	1,245,397	2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,498	504,322	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	6,110	6,376	714,906	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,720	2,867	321,496	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,210	3,927	440,366	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,690	2,840	318,421	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	4,290	4,306	482,793	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	4,680	5,194	582,348	2028/08/15
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	3,980	4,005	449,038	2022/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,757	197,046	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	4,380	4,419	495,453	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	3,680	3,726	417,721	2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	3,120	3,188	357,434	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,273	254,834	2023/08/31
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	1,210	1,213	136,050	2022/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	1,095	122,848	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,440	2,427	272,116	2024/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,410	1,531	171,659	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	8,840	8,935	1,001,814	2021/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,930	3,028	339,491	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	3,100	3,101	347,676	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,250	5,300	594,279	2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	840	884	99,167	2023/09/30
US T N/B 1.5 09/15/22	国債証券	1.5000	750	752	84,348	2022/09/15
US T N/B 1.5 09/30/21	国債証券	1.5000	5,120	5,125	574,608	2021/09/30
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,920	2,086	233,967	2025/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	3,690	3,889	436,050	2023/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,350	2,376	266,484	2026/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	6,000	6,673	748,202	2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	1,111	124,626	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	900	1,209	135,598	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	2,290	2,749	308,278	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,110	1,567	175,716	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	2,110	2,423	271,683	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	760	925	103,748	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	2,620	3,515	394,077	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,640	3,074	344,689	2047/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	1,630	1,965	220,386	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	2,220	2,633	295,258	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	4,690	4,878	546,909	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	410	584	65,525	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,330	4,359	488,736	2048/11/15

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

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	1,520	1,711	127,029	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	1,670	2,120	157,348	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	1,980	2,145	159,213	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	2,010	2,425	179,994	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	1,710	1,966	145,970	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	2,820	3,381	250,929	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,130	1,602	118,923	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	850	1,170	86,859	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,740	1,925	142,877	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,200	1,374	102,011	2030/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	720	946	70,214	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	530	644	47,800	2035/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	1,180	1,321	98,048	2022/07/15
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	2,080	2,392	177,546	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,330	1,511	112,141	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,560	1,819	134,996	2029/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	890	927	68,866	2022/11/21
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券	2.0000	1,770	1,811	134,421	2021/12/21
小計	－	－	27,560	32,336	2,399,708	－
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	730	823	65,903	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	420	483	38,690	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	380	437	35,066	2042/04/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	340	354	28,402	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	210	217	17,396	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	200	221	17,712	2029/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	200	213	17,062	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	550	586	46,927	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	1,600	1,664	133,300	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	412	33,018	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	480	572	45,836	2033/09/01
小計	－	－	5,480	5,986	479,318	－
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	1,540	2,254	325,670	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,280	1,965	283,925	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	990	1,995	288,250	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	580	680	98,318	2049/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,610	1,974	285,167	2025/03/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4.0000	1,040	1,114	160,977	2022/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,130	1,700	245,625	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	820	838	121,090	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,110	1,573	227,233	2032/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,450	1,604	231,722	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	1,120	1,968	284,348	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,020	1,273	183,998	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	1,130	1,785	257,902	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	890	1,780	257,218	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	900	960	138,739	2026/07/22

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	460	781	94,447	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	670	1,004	121,476	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	350	357	43,178	2023/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	1,420	1,511	182,745	2021/09/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	330	643	77,778	2117/09/20
AUSTRIA 09/20/22	国債証券	0.0000	470	477	57,767	2022/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	540	596	72,076	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	580	625	75,686	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	640	701	84,885	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	750	815	98,569	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	180	262	31,776	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	740	822	99,484	2022/11/22
小計	－	－	11,670	14,712	1,779,149	－
合計	－	－	－	－	127,972,430	－

■投資信託財産の構成

2020年２月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	127,972,430	97.7
コール・ローン等、その他	3,017,425	2.3
投資信託財産総額	130,989,855	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第２位を四捨五入しています。
（注２）当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、130,489,048千円、99.6％です。
（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年２月21日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝112.11円、１カナダ・ドル＝84.60円、１オーストラリア・ドル＝74.21円、１シンガポール・ドル＝80.07円、１イギリス・ポンド＝144.44円、１デンマーク・クローネ＝16.19円、１ノルウェー・クローネ＝12.03円、１スウェーデン・クローナ＝11.42円、１メキシコ・ペソ＝5.95円、１マレーシア・リンギット＝26.75円、１南アフリカ・ランド＝7.42円、１ポーランド・ズロチ＝28.27円、１ユーロ＝120.93円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年２月21日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**130,989,855,521円**
コール・ローン等	2,138,894,536
公社債(評価額)	127,972,430,109
未収利息	869,632,019
前払費用	8,898,857
(B) 負債	**185,938,200**
未払解約金	185,938,200
(C) 純資産総額(A－B)	**130,803,917,321**
元本	66,784,593,799
次期繰越損益金	64,019,323,522
(D) 受益権総口数	**66,784,593,799口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**19,586円**

(注１) 期首元本額 108,789,722,301円
追加設定元本額 14,409,786,591円
一部解約元本額 56,414,915,093円

(注２) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	8,874,003,827円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（安定型）	5,775,654円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（中立型）	22,123,281円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（積極型）	25,741,467円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	80,085,833円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	83,655,608円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	35,465,308円
たわらノーロード 先進国債券	6,509,607,053円
たわらノーロード 先進国債券＜ラップ向け＞	149,495,926円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	479,712,374円
たわらノーロード バランス（堅実型）	11,707,903円
たわらノーロード バランス（標準型）	55,613,057円
たわらノーロード バランス（積極型）	11,564,861円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	1,913,072円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	134,211,407円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	176,522,766円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	60,240,852円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	36,378,986円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	68,332円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,616,898円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	4,040,132円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,282,053円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,349,638円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	5,832,006,477円
Ｏｎｅ ＤＣ 先進国債券インデックスファンド	639,979円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	585,714,796円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,821,374,172円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,899,253,523円
ＤＩＡＭ ＤＣバランス30インデックスファンド	367,533,477円
ＤＩＡＭ ＤＣバランス50インデックスファンド	797,283,999円
ＤＩＡＭ ＤＣバランス70インデックスファンド	632,041,626円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	20,946,445円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	607,750,277円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	22,230,425円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）	125,271,635円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）	89,691,387円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）	147,541,325円
クルーズコントロール	1,255,331,264円
ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	109,167,362円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	177,161,233円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,269,534円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,786,439円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	7,504,090円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	38,912,796円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	120,359,994円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	139,662円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,165,889,077円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12（適格機関投資家限定）	818,056円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	6,588,503,236円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	3,322,079,347円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,199,859,662円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	6,073,392,201円
ＤＩＡＭワールドバランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	71,552,724円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	255,255円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	606,183,336円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	455,700,977円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,453,454円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	68,261,200円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,577,030円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,136,190円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,431,781円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	76,799,804円
ＤＩＡＭバランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,762,682,039円
ＤＩＡＭバランスファンド37.5ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,924,647,331円
ＤＩＡＭバランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,376,447,915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）	604,894,639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）	234,213,008円
ＤＩＡＭ 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）	2,604,999,197円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	639,500,550円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド55ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,781,172円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド35ＶＡ（適格機関投資家限定）	91,625,774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）	449,766,733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）	644,060,493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）	1,151,182,638円
ＤＩＡＭ世界バランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	73,750,748円
ＤＩＡＭバランス20ＶＡ（適格機関投資家限定）	44,525,537円
ＤＩＡＭバランス40ＶＡ（適格機関投資家限定）	364,076円
ＤＩＡＭバランス60ＶＡ（適格機関投資家限定）	170,414円
期末元本合計	66,784,593,799円

■損益の状況

当期　自2019年２月22日　至2020年２月21日

項目	当期
(A) 配当等収益	**3,956,180,646円**
受取利息	3,956,709,728
支払利息	△529,082
(B) 有価証券売買損益	**7,416,281,605**
売買益	12,399,227,471
売買損	△4,982,945,866
(C) その他費用	**△19,454,538**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**11,353,007,713**
(E) 前期繰越損益金	**88,880,284,980**
(F) 解約差損益金	**△48,712,391,980**
(G) 追加信託差損益金	**12,498,422,809**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**64,019,323,522**
次期繰越損益金(H)	**64,019,323,522**

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日　2020年２月17日）

（計算期間　2019年２月16日～2020年２月17日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（ベンチマーク）		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期(2016年２月15日)	23,909	△17.1	764,772.48	△16.9	96.1	1.2	242,694
15期(2017年２月15日)	30,270	26.6	971,437.64	27.0	95.6	1.7	278,963
16期(2018年２月15日)	33,302	10.0	1,070,930.74	10.2	95.7	2.2	284,448
17期(2019年２月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689
18期(2020年２月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420

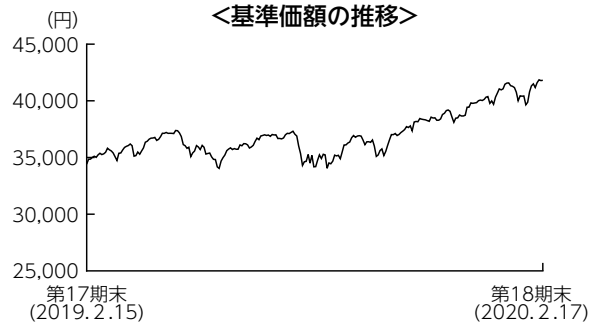
（注１）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。
（注２）ベンチマークはＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。
（注３）ＭＳＣＩコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．に帰属します。また、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。
（注４）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

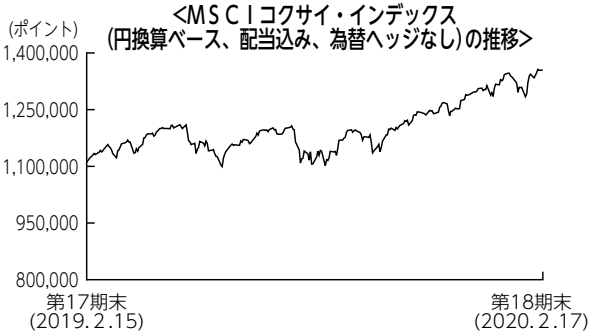
■当期中の基準価額と市況の推移

年　月　日	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)(ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2019年2月15日	34,418	－	1,111,144.35	－	95.3	2.0
2月末	35,326	2.6	1,141,179.46	2.7	95.4	2.0
3月末	35,574	3.4	1,149,447.69	3.4	95.6	1.7
4月末	37,169	8.0	1,201,500.33	8.1	96.0	1.1
5月末	34,824	1.2	1,125,763.75	1.3	95.4	1.9
6月末	36,077	4.8	1,166,661.32	5.0	95.7	1.5
7月末	37,059	7.7	1,198,358.28	7.8	95.6	1.6
8月末	35,209	2.3	1,139,763.28	2.6	94.8	2.2
9月末	36,342	5.6	1,176,490.64	5.9	95.1	2.0
10月末	37,786	9.8	1,221,956.80	10.0	95.0	2.2
11月末	39,192	13.9	1,268,768.91	14.2	95.3	1.9
12月末	40,378	17.3	1,307,005.29	17.6	95.9	1.4
2020年1月末	40,429	17.5	1,309,282.33	17.8	94.8	2.7
(期末) 2020年2月17日	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7

(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■**当期の運用経過**（2019年２月16日から2020年２月17日まで）





基準価額の推移

当期末の基準価額は41,812円となり、前期末比で21.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場において、米ドルやユーロなどの通貨に対して円高となったことはマイナスに寄与したものの、米国のハト派的な金融政策や米中貿易協議の進展期待などから、米国や欧州などの株式市場が力強く上昇し、基準価額は上昇しました。

投資環境

外国株式市場は、米国が金融引き締めを急がない姿勢を示したことなどから2019年４月下旬にかけて堅調に推移しました。その後方向感の定まらない展開となりましたが、10月中旬以降は米中貿易協議への進展期待から上昇傾向となりました。2020年に入ると、中東情勢の悪化懸念や新型肺炎の感染拡大などから一時下落する場面があったものの、前期末比で大きく上昇しました。欧州市場では英国やイタリアの政局混乱など不安要因はありましたが、前期末比で上昇しました。

為替市場では、米中貿易摩擦の緩和期待などから2019年４月後半にかけて対円で米ドルが買われる展開となりましたが、その後は米国の金利低下見通しなどから米ドル安に転じました。９月以降は米中対立の緩和期待や、米国の追加利下げ観測の後退などから米ドル高となったものの、前期末比では米ドル安円高となりました。ユーロは域内の景気減速懸念や、低金利環境の長期化観測などからユーロ安円高となりました。

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

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

期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.3%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.9
3	銀行	7.3
4	資本財	6.7
5	メディア・娯楽	6.1
6	ヘルスケア機器・サービス	4.9
7	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.9
8	小売	4.8
9	食品・飲料・タバコ	4.6
10	エネルギー	4.5

（注１）比率は純資産総額に対する割合です。
（注２）業種は各決算日時点でのＧＩＣＳ（世界産業分類基準）によるものです。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で21.9％上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額	当期 比率
(a) 売買委託手数料	1円	0.002%
(株式)	(0)	(0.001)
(先物・オプション)	(0)	(0.001)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)
(投資証券)	(0)	(0.000)
(b) 有価証券取引税	1	0.004
(株式)	(1)	(0.004)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)
(投資証券)	(0)	(0.000)
(c) その他費用	13	0.034
(その他)	(13)	(0.034)
合計	15	0.040

（注）金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「１万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（37,077円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については７ページ（１万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2019年２月16日から2020年２月17日まで）

(1) 株　式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	20,597.12 (944.38)	148,036 (△3,748)	52,364.81	408,490
		百株	千カナダ・ドル	百株	千カナダ・ドル
	カナダ	3,511.18 (△1,155.8)	13,919 (△390)	8,023.97	30,759
		百株	千オーストラリア・ドル	百株	千オーストラリア・ドル
	オーストラリア	4,492.22 (439.83)	8,156 (515)	12,399.51	21,352
		百株	千香港・ドル	百株	千香港・ドル
	香港	8,847 (969.27)	25,910 (−)	18,974.5	64,320
		百株	千シンガポール・ドル	百株	千シンガポール・ドル
	シンガポール	1,711 (−)	1,203 (−)	11,375.4	3,530
		百株	千ニュージーランド・ドル	百株	千ニュージーランド・ドル
	ニュージーランド	1,097.05 (−)	672 (−)	912.87	698
		百株	千イギリス・ポンド	百株	千イギリス・ポンド
	イギリス	16,501.3 (174,827.16)	11,324 (△314)	218,837.93	27,695
		百株	千イスラエル・シュケル	百株	千イスラエル・シュケル
	イスラエル	1,257.5 (−)	2,010 (−)	2,354.7	2,750
		百株	千スイス・フラン	百株	千スイス・フラン
	スイス	850.1 (375.47)	6,472 (△480)	2,677.98	19,579
		百株	千デンマーク・クローネ	百株	千デンマーク・クローネ
	デンマーク	212.77 (17.54)	9,890 (−)	709.27	27,146
		百株	千ノルウェー・クローネ	百株	千ノルウェー・クローネ
	ノルウェー	291.8 (74.45)	5,929 (−)	1,353.09	15,917
		百株	千スウェーデン・クローナ	百株	千スウェーデン・クローナ
	スウェーデン	559.9 (243.67)	8,994 (−)	2,928.51	42,541
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ　アイルランド	341.42 (−)	146 (−)	832.18	854
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ　オランダ	1,455.84 (−)	6,992 (−)	1,907.64	8,296
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ　ベルギー	162.34 (−)	1,541 (−)	361.48	2,387
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ　ルクセンブルグ	131.92 (−)	234 (−)	334.29	573
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ　フランス	1,262.54 (71.83)	7,234 (△12)	4,011.97	19,883
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ　ドイツ	1,335.84 (54)	6,531 (△409)	3,740.17	17,458
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ　ポルトガル	− (−)	− (−)	526.32	314

			買付		売付	
			株数	金額	株数	金額
			百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
外国	ユーロ	スペイン	1,815.36 (13,153.66)	2,268 (△1)	20,677.83	5,748
			百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
		イタリア	4,152.7 (−)	2,024 (−)	11,344.16	3,994
			百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
		フィンランド	499.72 (252.94)	739 (−)	1,374.73	1,699
			百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
		オーストリア	8.13 (−)	38 (△35)	68.57	280

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	− (−)	− (−)	0.998 (−)	152 (−)
BOSTON PROPERTIES INC	− (−)	− (−)	1.282 (−)	165 (−)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17.771 (−)	747 (−)	− (−)	− (−)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	− (−)	− (−)	17.307 (−)	158 (−)
PROLOGIS INC	− (7.863)	− (−)	6.948 (−)	584 (−)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	− (−)	− (−)	1.862 (−)	389 (−)
EQUINIX INC	0.553 (−)	306 (−)	0.995 (−)	554 (−)
DUKE REALTY TRUST	− (−)	− (−)	5.676 (−)	183 (−)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2.731 (−)	334 (−)	6.682 (−)	879 (−)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.47 (−)	149 (−)	1.048 (−)	326 (−)
EQUITY RESIDENTIAL	5.493 (−)	432 (−)	10.6 (−)	825 (−)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	11.666 (−)	378 (−)	10.781 (−)	347 (−)
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.579 (−)	153 (−)	2.078 (−)	475 (−)
WELLTOWER INC	2.255 (−)	198 (−)	3.465 (−)	302 (−)
LIBERTY PROPERTY TRUST	− (△11.649)	− (−)	− (−)	− (−)
THE MACERICH COMPANY	− (−)	− (−)	9.014 (−)	240 (−)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8.128 (6.813)	974 (−)	1.315 (−)	159 (−)
HOST HOTELS & RESORTS INC	− (−)	− (−)	8.885 (−)	151 (−)
MID AMERICA	− (−)	− (−)	1.424 (−)	169 (−)
REALTY INCOME CORP	2.065 (−)	151 (−)	5.19 (−)	382 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
REGENCY CENTERS CORP	7.479 (−)	483 (−)	9.099 (−)	590 (−)
UDR INC	4.195 (−)	188 (−)	3.508 (−)	157 (−)
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.846 (−)	631 (−)	7.04 (−)	1,105 (−)
PUBLIC STORAGE	− (−)	− (−)	1.533 (−)	370 (−)
SUN COMMUNITIES INC	8.681 (−)	1,108 (−)	1.263 (−)	159 (−)
VENTAS INC	3.913 (−)	259 (−)	4.652 (−)	329 (−)
VORNADO REALTY TRUST	2.506 (−)	148 (−)	5.38 (−)	331 (−)
WEYERHAEUSER CO	− (−)	− (−)	6.078 (−)	148 (−)
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.161 (−)	226 (−)	4.785 (−)	497 (−)
DIGITAL REALTY TRUST INC	− (−)	− (−)	2.783 (−)	338 (−)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	39.953 (−)	829 (−)	− (−)	− (−)
VEREIT INC	12.782 (−)	123 (−)	23.607 (−)	226 (−)
AMERICAN TOWER CORP	2.719 (−)	577 (−)	7.003 (−)	1,510 (−)
WP CAREY INC	1.702 (−)	150 (−)	3.811 (−)	334 (−)
INVITATION HOMES INC	11.957 (−)	342 (−)	− (−)	− (−)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	− (−)	− (−)	19.124 (−)	373 (−)
VICI PROPERTIES INC	34.2 (−)	841 (−)	− (−)	− (−)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	− (−)	− (−)	6.221 (−)	202 (−)
CANADIAN APT PPTYS REIT	7.819 (−)	430 (−)	− (−)	− (−)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	− (17.676)	− (388)	− (−)	− (−)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	11.77 (−)	308 (−)	7.978 (−)	208 (−)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
MIRVAC GROUP	110.284 (−)	354 (−)	76.649 (−)	242 (−)
GPT GROUP	89.108 (−)	550 (−)	75.831 (−)	465 (−)
LENDLEASE GROUP	− (△42.974)	− (△572)	17.897 (−)	223 (−)
DEXUS	20.313 (−)	265 (−)	16.334 (−)	212 (−)
GOODMAN GROUP	− (−)	− (−)	15.521 (−)	230 (−)
SCENTRE GROUP	− (−)	− (−)	56.688 (−)	217 (−)
香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
LINK REIT	− (−)	− (−)	27.6 (−)	2,435 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	－	－	－	－
	(－)	(△5)	(－)	(－)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	－	－	－	－
	(－)	(△1)	(－)	(－)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192.3	461	－	－
	(－)	(△0.05769)	(－)	(－)
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	－	－	32.128	7
	(32.128)	(－)	(－)	(－)
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	20.951	127	23.003	122
	(－)	(－)	(－)	(－)
HAMMERSON PLC	－	－	58.616	162
	(－)	(－)	(－)	(－)
LAND SECURITIES GROUP PLC	15.752	142	18.971	175
	(－)	(－)	(－)	(－)
SEGRO PLC	22.038	146	17.705	123
	(－)	(－)	(－)	(－)
ユーロ（オランダ）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	－	－	1.163	153
	(－)	(－)	(－)	(－)
ユーロ（フランス）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
COVIVIO	1.446	136	1.856	168
	(－)	(－)	(－)	(－)

（注１）金額は受渡代金です。
（注２）（　）内は、合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 84,266	百万円 82,751	百万円 －	百万円 －

（注）金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	88,699,016千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	335,421,941千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.26

（注）(b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年２月16日から2020年２月17日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			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	
AMAZON.COM INC	361.08	325.49	69,487	7,629,769	インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,515.76	1,365.53	12,243	1,344,318	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	556.31	475.98	996	109,385	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	35.6	35.74	597	65,621	ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	798.15	684.81	10,320	1,133,145	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	763.85	790.23	4,370	479,909	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	422.94	375.4	14,252	1,564,958	ソフトウェア
CHUBB LTD	393.78	352.14	5,794	636,270	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	194.65	173.59	4,444	487,959	化学
ALLEGHANY CORP	13.25	10.94	902	99,126	保険
SAREPTA THERAPEUTICS INC	－	60.52	759	83,342	バイオテクノロジー
RALPH LAUREN CORP	48.93	34.22	416	45,779	繊維・アパレル・贅沢品
ALLSTATE CORP	306.51	258.32	3,243	356,160	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	641.2	556.87	10,068	1,105,550	コングロマリット
AMGEN INC	565.43	464.84	10,388	1,140,629	バイオテクノロジー
HESS CORP	237.34	213.67	1,289	141,563	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	643.65	544.74	7,401	812,671	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	426.28	392.77	4,075	447,476	電力
AFLAC INC	633.17	570.28	3,011	330,679	保険
AMERICAN INTL GROUP	779.1	680.37	3,298	362,168	保険
AMERCO	5.51	5.85	202	22,240	陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	329.62	291.05	3,424	375,977	半導体・半導体製造装置
ANADARKO PETROLEUM CORP	428.77	－	－	－	石油・ガス・消耗燃料
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	194.82	181.92	1,865	204,861	バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	810.35	604.52	2,536	278,514	建設関連製品
JONES LANG LASALLE INC	40.87	40.87	700	76,889	不動産管理・開発
VALERO ENERGY CORP	372.19	314.33	2,597	285,219	石油・ガス・消耗燃料
APACHE CORP	360.95	314.7	861	94,539	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	76.33	67.7	1,976	217,042	ソフトウェア
APPLE INC	4,204.91	3,499.77	113,725	12,487,007	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	831.06	711.21	4,754	522,037	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	98.26	76.34	684	75,137	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	496.79	421.46	1,886	207,179	食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	96	78.13	784	86,155	電力
AMEREN CORP	220.7	194.87	1,691	185,702	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	83.46	57.95	458	50,387	電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	61.97	59.13	456	50,160	自動車部品
AUTODESK INC	192.95	172.35	3,601	395,417	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	373.36	334.93	6,070	666,552	情報技術サービス
AUTOZONE INC	22.31	19.17	2,019	221,686	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	80.42	65.49	904	99,326	容器・包装
BALL CORP	278.03	252.62	1,950	214,190	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,131.63	1,020.32	23,140	2,540,866	各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	863.63	666.37	3,058	335,838	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	449.71	370.97	3,455	379,382	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	228.65	207.72	5,405	593,500	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	199.25	178.21	1,805	198,296	電気設備
VERIZON COMM INC	3,601.1	3,203.11	18,741	2,057,805	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	81.34	122.01	968	106,369	保険
BEST BUY CO INC	232.06	187.2	1,688	185,422	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	－	15.24	615	67,541	ライフサイエンス・ツール／サービス
YUM! BRANDS INC	278.59	231.1	2,433	267,145	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	415.03	435.84	2,276	249,947	電力
H&R BLOCK INC	161.14	－	－	－	各種消費者サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			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	
BOEING CO	476.45	413.69	14,085	1,546,613	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	108.27	83.24	501	55,021	専門サービス
BORGWARNER INC	215.54	172.1	587	64,531	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,198.2	1,066.58	4,512	495,494	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	117.55	99.88	719	78,972	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	101.53	87.66	994	109,177	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	21.42	19.29	1,472	161,648	ライフサイエンス・ツール／サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,426.27	1,814.88	12,047	1,322,779	医薬品
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	52.15	–	–	–	資本市場
INGREDION INC	53.05	53.05	516	56,699	食品
ONEOK INC	374.02	324.27	2,496	274,086	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	59	59	665	73,080	保険
UNITED RENTALS INC	76.93	61.81	969	106,456	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	230.49	215.99	3,476	381,727	総合公益事業
FEDEX CORP	215.25	193.68	3,072	337,322	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	96.48	80.48	1,686	185,190	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	252.01	227.63	2,368	260,110	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	235.58	243.81	1,740	191,140	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,532.41	1,252.54	903	99,158	メディア
CSX CORP	710.27	595.4	4,738	520,318	陸運・鉄道
CABOT OIL & GAS CORP	382.55	314.16	464	51,052	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	140.5	140.5	683	75,036	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	243.37	200.52	1,082	118,870	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	145.53	128.2	2,613	286,918	飲料
CARDINAL HEALTH INC	269.19	229.5	1,368	150,237	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	354.48	319.62	1,361	149,501	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	521.82	432.58	5,969	655,415	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	112.32	98.65	1,155	126,840	ソフトウェア
CELGENE CORP	608.71	–	–	–	バイオテクノロジー
CITRIX SYSTEMS INC	125.26	94.64	1,154	126,807	ソフトウェア
CENTURYLINK INC	804.24	804.24	1,117	122,744	各種電気通信サービス
CERNER CORP	264.14	251.43	1,937	212,767	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,927.32	2,476.52	34,042	3,737,838	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	222.43	198.96	1,520	166,967	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	142.86	112.22	1,292	141,958	保険
CINTAS CORP	79.44	66.04	1,987	218,173	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	4,106.72	3,309.4	15,544	1,706,758	通信機器
CLOROX COMPANY	108.85	98.76	1,627	178,739	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,520.46	3,147.58	18,869	2,071,897	飲料
COPART INC	189.44	167.49	1,729	189,880	商業サービス・用品
COGNEX CORP	152.91	122.84	660	72,510	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	710	627.79	4,814	528,634	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	263.13	221.45	3,208	352,327	ホテル・レストラン・レジャー
COMERICA INC	149.31	119.85	752	82,589	銀行
NRG ENERGY, INC.	256.31	210.39	842	92,541	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
COMCAST CORP-CL A	3,943.84	3,511.08	16,182	1,776,845	メディア
CONAGRA BRANDS INC	405.73	358.02	1,170	128,506	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	267.33	252.2	2,378	261,131	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	236.16	229.37	1,571	172,541	総合公益事業
COOPER COS INC	44.84	39.36	1,390	152,690	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	162	132.2	730	80,198	飲料
CORNING INC	686.91	583.76	1,668	183,252	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	138.7	482	52,952	容器・包装
HEICO CORP-CL A	–	52.92	545	59,942	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	131.93	119.63	1,995	219,071	機械
DR HORTON INC	321.52	283.55	1,752	192,437	家庭用耐久財
DANAHER CORP	552.86	482.99	8,015	880,071	ヘルスケア機器・用品

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

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

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

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NIKE INC-CL B	1,120.86	967	10,012	1,099,352	繊維・アパレル・贅沢品
NOBLE ENERGY INC	394.36	394.36	755	82,964	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	94.87	94.87	382	41,958	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	245.31	202.6	4,241	465,709	陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	270.88	247.68	2,319	254,710	電力
NISOURCE INC	315.48	315.48	953	104,646	総合公益事業
TAPESTRY INC	268.18	217.9	636	69,886	繊維・アパレル・贅沢品
NORTHERN TRUST CORP	178.67	159.59	1,615	177,332	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	139.67	121.94	4,523	496,652	航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	3,986.35	3,239.87	15,622	1,715,367	銀行
NUCOR CORP	282.41	240.42	1,133	124,467	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	191.75	191.75	1,054	115,755	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	417.83	359.69	3,691	405,366	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	659.07	695.5	2,893	317,682	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	49.17	52.09	1,155	126,921	陸運・鉄道
OGE ENERGY CORP	160.28	160.28	739	81,165	電力
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	70.14	58.22	2,275	249,878	専門小売り
ORACLE CORP	2,607.88	1,806.97	10,023	1,100,554	ソフトウェア
PACCAR INC	296.61	273.94	2,047	224,807	機械
PTC INC	100.28	77.66	678	74,483	ソフトウェア
EXELON CORP	821.76	737.21	3,668	402,785	電力
PARKER HANNIFIN CORP	110.23	100.92	2,137	234,740	機械
PAYCHEX INC	287.92	253.29	2,259	248,104	情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	68.75	61.63	1,694	186,057	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	632.29	537.24	1,900	208,643	電力
PEPSICO INC	1,214.84	1,082.92	15,917	1,747,778	飲料
PENTAIR PLC	168.69	125.11	553	60,772	機械
PFIZER INC	5,112.13	4,280.75	15,629	1,716,066	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	–	155.16	833	91,520	水道
CONOCOPHILLIPS	999.13	858.96	5,035	552,867	石油・ガス・消耗燃料
PVH CORP	68.62	52.05	465	51,075	繊維・アパレル・贅沢品
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	143.08	129.08	1,797	197,330	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,645.68	1,442.97	6,517	715,664	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	397.3	344.94	5,316	583,758	銀行
BROWN & BROWN INC	–	172.94	827	90,861	保険
POLARIS INC	57.26	40.95	384	42,220	レジャー用品
GARMIN LTD	107.74	107.74	1,057	116,145	家庭用耐久財
FLUOR CORP (NEW)	98.21	–	–	–	建設・土木
PPG INDUSTRIES INC	203.71	190.31	2,286	251,065	化学
IPG PHOTONICS CORP	36.52	26.08	363	39,944	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	384.78	339.84	10,817	1,187,755	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	218.16	184.83	2,539	278,823	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	128.75	108.83	1,228	134,850	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ／ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
PROCTER & GAMBLE CO	2,168.05	1,939.08	24,459	2,685,659	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	505.98	461.27	3,864	424,273	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	439.56	390.39	2,283	250,673	総合公益事業
PULTE GROUP INC	212.09	212.09	990	108,729	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	134.06	236.92	4,889	536,847	情報技術サービス
QUALCOMM INC	1,227.58	939.82	8,420	924,602	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	123.37	103.88	1,027	112,862	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	–	113.06	1,110	121,880	バイオテクノロジー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	39.48	31.61	626	68,783	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	70.45	61.16	2,443	268,312	バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	60.79	50.42	777	85,377	保険
RESMED INC	122.71	111.16	1,963	215,546	ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,351.09	1,156.14	6,371	699,589	銀行
SEATTLE GENETICS INC /WA	102.69	91.5	1,080	118,621	バイオテクノロジー

銘柄	期首(前期末)	当期末			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	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	371.25	315	1,501	164,910	保険
ROSS STORES INC	328.58	288.14	3,508	385,284	専門小売り
ROLLINS INC	123.78	123.78	492	54,119	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	92.48	79.49	3,121	342,774	コングロマリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	104.39	92.51	1,856	203,842	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	141.21	140.75	1,592	174,881	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	–	111.41	840	92,284	化学
RAYTHEON COMPANY	246.16	219.72	4,991	548,077	航空宇宙・防衛
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	38.48	38.48	395	43,446	情報技術サービス
ACCENTURE PLC-CL A	558.07	493.57	10,481	1,150,917	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,256.93	1,113.85	6,647	729,890	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	110.16	101.9	2,177	239,067	保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	231.27	195.63	2,694	295,910	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	293.13	474.12	7,464	819,607	情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	41.54	32.83	6,536	717,688	インターネット販売・通信販売
SCHLUMBERGER LTD	1,211.22	1,065.93	3,668	402,848	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,052.64	898.67	4,244	466,037	資本市場
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	181.38	155.9	2,500	274,569	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	103.34	106.22	575	63,236	食品
SEI INVESTMENTS CO	122.94	106.53	730	80,171	資本市場
ANTHEM INC	227.8	197.28	5,875	645,118	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	147.24	127.49	1,202	132,088	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	260.93	221.75	1,249	137,226	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	73.97	63.67	3,727	409,286	化学
CENTENE CORP	342.56	461.24	2,995	328,883	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	48.52	40.44	1,073	117,854	銀行
IAC INTERACTIVE CORP	69.38	62.52	1,487	163,345	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SMITH (A.O.) CORP	146.99	113.51	498	54,751	建設関連製品
ACUITY BRANDS INC	30.87	30.87	360	39,623	電気設備
SNAP-ON INC	49.35	39.81	622	68,303	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	350.83	313.88	2,965	325,616	保険
ADVANCE AUTO PARTS	63.3	52.97	707	77,697	専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	295.04	266.52	2,055	225,741	電力
SOUTHERN CO	865.24	800.67	5,526	606,779	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	677.81	1,036.81	5,696	625,446	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	113.52	113.52	658	72,256	旅客航空輸送業
AT&T INC	6,330.05	5,656.86	21,637	2,375,796	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,647.12	1,471.08	16,193	1,778,062	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	130.77	117.76	1,966	215,893	機械
STATE STREET CORP	336.8	295.9	2,303	252,933	資本市場
STARBUCKS CORP	1,179.2	923.12	8,241	904,929	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	190.3	175.47	499	54,794	金属・鉱業
STRYKER CORP	296.38	258.5	5,726	628,803	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	380.42	338.6	12,880	1,414,261	娯楽
SUNTRUST BANKS INC	408.38	–	–	–	銀行
NORTONLIFELOCK INC	553.68	489.55	1,011	111,052	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	97.93	382	42,000	陸運・鉄道
SYNOPSYS INC	132.39	118.55	1,936	212,629	ソフトウェア
SYSCO CORP	430.43	382.29	2,989	328,289	食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	99.01	88.5	5,339	586,303	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	39.05	34.55	1,335	146,679	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	805.53	883.22	1,079	118,506	医薬品
TERADYNE INC	–	121.62	853	93,690	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	846.28	720.56	9,526	1,046,012	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	221.99	163.04	783	86,071	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	353.36	309.95	10,513	1,154,348	ライフサイエンス・ツール／サービス
TIFFANY & CO	87.33	87.33	1,172	128,749	専門小売り

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
GLOBE LIFE INC	106.61	72.82	807	88,711	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	143.84	–	–	–	情報技術サービス
DAVITA INC	108.78	81.59	701	77,025	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	110.88	95.73	939	103,187	専門小売り
TRIMBLE INC	200.73	200.73	910	99,974	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	–	28.51	964	105,885	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	246.07	227.36	1,830	200,986	食品
UGI CORP	147.25	147.97	617	67,750	ガス
MARATHON OIL CORP	718.46	584.18	621	68,248	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	638.7	544.82	10,024	1,100,710	陸運・鉄道
UNITED TECHNOLOGIES CORP	709.43	634.51	9,737	1,069,143	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	839.99	733.07	21,902	2,404,912	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	77.43	61.53	860	94,536	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	84.38	72.26	1,061	116,568	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	300.57	267.5	2,237	245,721	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	307.11	453.61	1,586	174,222	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	223.69	198.29	4,834	530,850	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	121.42	97.94	1,439	158,048	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	719.45	602.5	3,184	349,626	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,270.54	1,104.64	13,022	1,429,881	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	369.86	323	4,061	445,977	商業サービス・用品
WATERS CORP	69.53	54.68	1,181	129,719	ライフサイエンス・ツール／サービス
ALLERGAN PLC	296.2	252.62	5,009	550,093	医薬品
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	–	52.4	914	100,439	ヘルスケア機器・用品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	104.59	91.76	1,009	110,827	食品
VAIL RESORTS INC	37.73	31.09	775	85,140	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	260.76	225.67	1,562	171,591	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	75.3	149.64	1,152	126,596	機械
WHIRLPOOL CORP	55.53	46.14	702	77,086	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	162.96	139.02	1,654	181,631	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	92.4	79.7	1,053	115,636	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	91.32	90.2	1,048	115,084	資本市場
CME GROUP INC	304.37	276.73	5,897	647,594	資本市場
WILLIAMS COS INC	1,061.74	907.18	1,954	214,556	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	266.9	221.96	736	80,912	販売
ALLIANT ENERGY CORP	199.1	172.21	1,028	112,960	電力
WEC ENERGY GROUP INC	280.63	238.39	2,428	266,646	総合公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	256.64	218.2	1,080	118,689	資本市場
CARMAX INC	159.79	120.81	1,193	131,070	専門小売り
XEROX CORP	174.55	–	–	–	コンピュータ・周辺機器
XILINX INC	210.93	189.97	1,712	188,082	半導体・半導体製造装置
CIMAREX ENERGY CO	92.53	–	–	–	石油・ガス・消耗燃料
TJX COMPANIES INC	1,073.99	930.1	5,894	647,268	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	–	41.28	985	108,223	電子装置・機器・部品
ZIONS BANCORP NA	165.84	131.42	607	66,752	銀行
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	274	274	147	16,246	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	764	764	420	46,221	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	157	157	911	100,104	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	171	545	59,876	コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	81.92	81.78	1,052	115,565	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	41.71	41.71	602	66,113	銀行
CBRE GROUP INC	294.99	236.13	1,510	165,829	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	198.35	127.32	258	28,420	メディア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	43.5	–	–	–	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	929.92	764.8	1,264	138,894	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	32.56	32.56	949	104,249	ホテル・レストラン・レジャー
WESTLAKE CHEMICAL CORP	30	30	194	21,358	化学

銘柄	期首(前期末)	当期末			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	
T-MOBILE US INC	302.13	256.75	2,477	271,988	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	333.32	277.59	1,889	207,473	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	314.33	282.49	529	58,157	化学
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	390.26	–	–	–	娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	917.84	–	–	–	娯楽
MARKETAXESS HOLDINGS INC	–	28.92	999	109,770	資本市場
CELANESE CORP	118.8	103.26	1,136	124,740	化学
DEXCOM INC	76.65	72.16	2,048	224,946	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	104.23	104.23	314	34,573	メディア
EXPEDIA GROUP INC	103.73	115.27	1,415	155,423	インターネット販売・通信販売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	184.75	707	77,693	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	124.93	103.12	1,843	202,470	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	418.18	340.23	661	72,659	メディア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	494.25	442.48	4,285	470,587	資本市場
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	146.96	146.96	252	27,738	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOM INC-CLASS B	302.82	–	–	–	娯楽
LIVE NATION	136.82	113.39	839	92,156	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	22.24	20.4	1,880	206,507	ホテル・レストラン・レジャー
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	61.91	45.08	358	39,375	旅客航空輸送業
TRANSDIGM GROUP INC	43.12	36.81	2,380	261,399	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	806.15	699.14	23,837	2,617,322	情報技術サービス
QURATE RETAIL INC	357.33	–	–	–	インターネット販売・通信販売
HANESBRANDS INC	276.19	276.19	394	43,365	繊維・アパレル・贅沢品
WESTERN UNION CO	352.22	352.22	924	101,479	情報技術サービス
OWENS CORNING	105.91	77.56	494	54,349	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	131.82	111.13	1,253	137,651	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	115.86	88.07	550	60,457	商社・流通業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	91.75	70.67	479	52,695	航空宇宙・防衛
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	180.99	173.5	371	40,767	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	105.19	91.76	1,122	123,200	情報技術サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	296.53	295.45	480	52,715	銀行
DELTA AIR LINES INC	138.98	111.58	657	72,161	旅客航空輸送業
INSULET CORP	–	47.81	1,015	111,458	ヘルスケア機器・用品
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	63.54	60.38	158	17,369	石油・ガス・消耗燃料
DISCOVER FINANCIAL	290.57	239.78	1,832	201,197	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	296.1	256.41	2,392	262,675	電子装置・機器・部品
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	178.07	159.7	1,244	136,650	石油・ガス・消耗燃料
WABCO HOLDING INC	40.76	40.76	554	60,870	機械
LULULEMON ATHLETICA INC	90.8	82.55	2,100	230,596	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	66.48	65.32	1,057	116,059	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	37.5	35	2,572	282,464	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	50.2	45.77	1,348	148,037	専門小売り
INVESCO LTD	421.25	334.43	594	65,288	資本市場
MSCI INC	75.37	67.14	2,165	237,790	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,360.77	1,203.48	10,650	1,169,457	タバコ
VISA INC	1,551.28	1,337.71	28,130	3,088,751	情報技術サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	159.33	145.36	2,025	222,362	水道
DISCOVERY INC-C	294.84	304.21	873	95,964	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	599.29	514.74	3,002	329,672	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	116.24	116.24	848	93,158	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,769.14	1,600.64	3,521	386,650	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	151.11	132.37	1,166	128,104	機械
ALKERMES PLC	120.53	–	–	–	バイオテクノロジー
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	289.87	208.76	1,724	189,334	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.79	34.79	856	94,050	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	122.4	111.94	1,931	212,044	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	–	40.23	952	104,578	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HCA HEALTHCARE INC	241.78	206.49	3,088	339,114	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	134.05	123.2	2,111	231,831	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	54.74	42.73	601	66,083	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	74.43	68.85	2,192	240,724	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	136.76	124.53	1,466	160,976	銀行
CIT GROUP INC	92.87	–	–	–	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	306	213.18	2,922	320,865	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	–	98.33	753	82,756	情報技術サービス
TARGA RESOURCES CORP	178.11	190.38	702	77,113	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	61.72	46.81	574	63,095	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	100.84	86.22	1,083	118,933	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	170	172.68	1,144	125,630	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	222.91	202.52	3,200	351,406	複合小売り
FORTINET INC	113.99	111.5	1,328	145,920	ソフトウェア
AON PLC	209.42	181.89	4,287	470,788	保険
TESLA INC	109.91	105.48	8,438	926,571	自動車
GENERAL MOTORS CO	1,100.5	1,006.95	3,500	384,317	自動車
WORLDPAY INC	265.92	–	–	–	情報技術サービス
XPO LOGISTICS INC	128.25	76.14	724	79,588	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC	92.63	92.63	274	30,156	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALLY FINANCIAL INC	398.19	318.71	1,046	114,956	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD	121.38	121.38	347	38,143	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC	135.25	102.73	642	70,588	各種金融サービス
APTIV PLC	225.71	189.2	1,671	183,477	自動車部品
PHILLIPS 66	381.15	342.35	3,063	336,317	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	–	58.85	720	79,104	ソフトウェア
FACEBOOK INC	2,102.8	1,861.56	39,870	4,377,823	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	134.26	134.53	2,210	242,723	ライフサイエンス・ツール／サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	131.09	114.24	856	94,039	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	150.71	144.06	5,130	563,366	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	79.35	72.72	1,798	197,420	ソフトウェア
WORKDAY INC	123.76	122.24	2,408	264,399	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,319.76	1,144.34	10,762	1,181,724	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	422.09	368.25	5,309	582,934	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	198.21	168.99	886	97,340	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	385.41	238.13	271	29,833	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	302.63	441	48,514	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC	128.91	140.75	590	64,784	商社・流通業
CDW CORP	130.4	114.06	1,577	173,191	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	638.82	638.82	555	60,953	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	101.99	101.99	297	32,699	旅客航空輸送業
ARCONIC INC	367.61	307.49	1,025	112,631	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	–	91.9	1,173	128,897	情報技術サービス
SNAP INC	–	571.3	1,003	110,151	インタラクティブ・メディアおよびサービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	178.52	143.04	670	73,581	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	50.06	50.06	247	27,125	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	179.31	142.05	706	77,548	メディア
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	154.1	154.1	238	26,141	繊維・アパレル・贅沢品
OKTA INC	–	88.16	1,208	132,644	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	–	127	944	103,733	情報技術サービス
BAKER HUGHES CO	434.04	510.05	1,121	123,095	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	126.11	106.69	1,015	111,487	食品
ALTICE USA INC-A	–	138.87	398	43,776	メディア
TECHNIPFMC LTD	387.24	312.57	539	59,236	エネルギー設備・サービス
BROADCOM INC	376.55	307.62	9,775	1,073,321	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	–	57.25	1,387	152,367	ソフトウェア
MONGODB INC	–	34.23	586	64,393	情報技術サービス

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
SEEK LTD	258.99	258.99	612	45,141	専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	45.81	–	–	–	ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	288	21,237	電力
AGL ENERGY LTD	606.49	496.44	1,026	75,694	総合公益事業
BRAMBLES LTD	1,440.62	1,266.93	1,602	118,164	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	391	28,831	ホテル・レストラン・レジャー
AURIZON HOLDINGS LTD	1,909.69	1,501.5	822	60,666	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	691.79	576.67	651	48,002	飲料
MEDIBANK PVT LTD	2,734.24	2,069.1	631	46,529	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	4,431.6	3,575.25	940	69,327	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	968.21	816.08	1,385	102,167	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	–	80	232	17,134	ソフトウェア
小計 株数・金額	65,230.79	57,763.33	110,579	8,153,048	
小計 銘柄数<比率>	61銘柄	62銘柄	–	<2.2%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH	327	191	2,183	30,847	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	2,984	42,175	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,536.6	1,038.6	1,819	25,711	銀行
CLP HOLDINGS LTD	1,495	1,210	9,982	141,052	電力
PCCW LTD	3,310	3,310	1,585	22,402	各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	490	495	2,734	38,643	電力
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	1,024.4	944.4	25,461	359,764	資本市場
MTR CORP	1,500	1,260	5,701	80,562	陸運・鉄道
HANG LUNG GROUP LTD	630	–	–	–	不動産管理・開発
HANG SENG BANK LTD	654	577	9,457	133,627	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,322.28	1,154.5	4,294	60,684	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,230	1,015	5,785	81,749	電力
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	957.5	–	–	–	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	8,370.5	7,767.55	11,822	167,047	ガス
HYSAN DEVELOPMENT CO	500	–	–	–	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,030	1,570	8,980	126,893	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES LTD	735	735	1,804	25,496	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,240	2,750	7,672	108,412	銀行
NWS HOLDINGS LTD	1,350	1,350	1,401	19,800	コングロマリット
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	505	505	1,060	14,984	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	6,052.66	4,842.66	5,055	71,437	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,040	–	–	–	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO	2,554	2,554	2,829	39,985	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,350	1,250	14,437	204,001	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	475	305	2,269	32,063	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,135	1,135	8,047	113,706	機械
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	–	700	2,159	30,513	食品
WHEELOCK & CO LTD	860	640	3,132	44,266	不動産管理・開発
MINTH GROUP LTD	440	–	–	–	自動車部品
SJM HOLDINGS LTD	1,560	1,560	1,500	21,205	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	1,244	2,169	30,655	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD	648	–	–	–	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD	10,630.27	9,356.27	75,458	1,066,226	保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,820	2,890	3,450	48,757	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	2,328	1,992	8,057	113,854	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,636	37,250	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	957.5	957.5	4,059	57,364	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,805	25,511	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	–	1,019	2,379	33,620	飲料
WH GROUP LTD	7,015	7,425	6,103	86,240	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,428.32	2,088.32	14,795	209,063	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,228.32	1,983.32	10,283	145,306	不動産管理・開発
小計 株数・金額	81,955.35	72,797.12	275,363	3,890,888	
小計 銘柄数<比率>	40銘柄	36銘柄	–	<1.1%>	

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(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	537	42,419	航空宇宙・防衛
SEMBCORP INDUSTRIES	814	814	166	13,105	コングロマリット
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,237	1,237	253	20,012	メディア
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,921.4	−	−	−	食品
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,581	1,419	3,625	286,128	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	290	364	406	32,087	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	59.44	59.44	173	13,678	販売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	901	478	211	16,711	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	689	635	50,134	資本市場
CAPITALAND LTD	1,924.15	2,045.15	760	60,042	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	4,164	4,164	368	29,083	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,684	1,011	679	53,617	コングロマリット
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,779	1,779	387	30,606	陸運・鉄道
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,670.53	2,515.53	2,782	219,569	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,343.22	6,071.22	1,954	154,283	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	475	475	409	32,313	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,205	952	2,499	197,221	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	405	333	26,305	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	210	210	358	28,307	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,423	1,423	583	46,044	食品
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	1,888	1,888	187	14,825	機械
小計 株数・金額	38,913.74	29,249.34	17,314	1,366,497	
小計 銘柄数<比率>	21銘柄	20銘柄	−	<0.4%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,145.5	852.45	711	50,259	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	298.94	298.94	509	36,010	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD	550.91	550.91	876	61,889	食品
FISHER & PAYKEL	426.78	431.84	1,048	74,035	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	641.04	641.04	335	23,672	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	1,596.23	760	53,706	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	−	617.34	329	23,233	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	901.73	756.56	422	29,808	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計 株数・金額	5,561.13	5,745.31	4,993	352,616	
小計 銘柄数<比率>	7銘柄	8銘柄	−	<0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	463.24	317.98	276	39,524	金属・鉱業
ASHTEAD GROUP	421.54	366.89	982	140,751	商社・流通業
SEVERN TRENT PLC	255.3	182.17	475	68,060	水道
BHP GROUP PLC	1,823.43	1,612.84	2,701	386,901	金属・鉱業
BARCLAYS PLC	15,069.06	13,428.31	2,362	338,244	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,037.64	822.83	716	102,582	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	7,604.43	6,307.77	968	138,652	各種電気通信サービス
BUNZL PLC	278.38	278.38	538	77,136	商社・流通業
EASYJET PLC	136.28	136.28	204	29,243	旅客航空輸送業
AVIVA PLC	3,504.51	3,146.91	1,293	185,166	保険
CRODA INTERNATIONAL	106.45	103.91	525	75,292	化学
DIAGEO PLC	2,129.15	1,828.12	5,629	806,172	飲料
SCHRODERS PLC	109.32	109.32	369	52,928	資本市場
DCC PLC	97.53	78.98	493	70,709	コングロマリット
NATIONAL GRID PLC	2,937.75	2,646.42	2,752	394,126	総合公益事業
KINGFISHER PLC	1,656.8	1,656.8	359	51,412	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	2,689.2	2,486.72	1,599	229,042	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,009.84	1,772.72	5,933	849,647	タバコ
HALMA PLC	−	279.01	613	87,819	電子装置・機器・部品
NEXT PLC	120.64	100.18	714	102,256	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	843.12	716.56	1,307	187,265	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	150.17	150.17	397	56,900	化学

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANGLO AMERICAN PLC	967.27	789.81	1,653	236,776	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,394.09	1,195.6	2,320	332,318	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	17,450.53	15,612.12	9,125	1,306,740	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,084.63	4,527.58	1,441	206,434	保険
CENTRICA PLC	4,713.4	4,713.4	335	48,057	総合公益事業
UNILEVER PLC	1,003.06	855.86	3,941	564,446	パーソナル用品
MEGGITT PLC	621.81	621.81	401	57,521	航空宇宙・防衛
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	2,305.51	1,686.76	306	43,888	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	544.87	544.87	551	78,961	水道
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	808.64	808.64	464	66,537	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	302.4	255.47	681	97,640	食品
PEARSON PLC	650.09	650.09	370	53,081	メディア
PERSIMMON PLC	260.85	260.85	842	120,652	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,219.79	2,049.4	3,025	433,314	保険
RIO TINTO PLC	996.24	874.36	3,669	525,499	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	23,320.41	20,437.18	3,065	438,990	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	582.78	544.64	3,451	494,316	家庭用品
RELX PLC	1,736.66	1,475.23	3,058	437,927	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	－	1,406.17	691	99,010	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,389.93	1,392.68	943	135,055	航空宇宙・防衛
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	4,494.43	3,974.34	846	121,280	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	611.91	376.85	447	64,110	資本市場
SSE PLC	844.79	746.84	1,239	177,425	電力
BP PLC	17,559.46	15,740.09	7,190	1,029,618	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	852.71	871.11	682	97,773	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	317.2	317.2	551	78,945	コングロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	－	55.18	511	73,288	機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,583.66	2,183.29	1,386	198,593	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	61,338.35	53,939.91	3,052	437,189	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	2,530.22	2,522.87	584	83,743	家庭用耐久財
TESCO PLC	8,771.57	7,573.16	1,937	277,409	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	886.62	766.43	893	127,971	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	749.03	680.27	1,237	177,197	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,360.21	3,862.19	6,444	922,845	医薬品
WEIR GROUP	183.36	191.61	264	37,878	機械
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	262.66	246.6	2,027	290,273	資本市場
BABCOCK INT'L GROUP	213.02	－	－	－	商業サービス・用品
WPP PLC	1,074.94	951.48	929	133,145	メディア
FERGUSON PLC	210.79	－	－	－	商社・流通業
ASTRAZENECA PLC	1,112.61	1,015.56	7,413	1,061,625	医薬品
WHITBREAD PLC	156.39	98.14	467	66,979	ホテル・レストラン・レジャー
CARNIVAL PLC	164.92	133.5	413	59,186	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,202.9	1,767.3	324	46,515	複合小売り
JOHN WOOD GROUP PLC	489.88	－	－	－	エネルギー設備・サービス
INTERTEK GROUP PLC	143.35	120.83	712	102,017	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	387.27	316.86	633	90,680	繊維・アパレル・贅沢品
INVESTEC PLC	506.55	－	－	－	資本市場
INTERCONTINENTAL HOTELS	151.25	124.6	595	85,270	ホテル・レストラン・レジャー
ITV PLC	3,709.08	2,543.08	345	49,526	メディア
SAINSBURY (J) PLC	1,372.15	1,372.15	282	40,477	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	1,222.5	1,222.5	245	35,187	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	158.93	369	52,936	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	107.26	82.33	438	62,768	家庭用耐久財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,047.66	3,336.87	6,420	919,363	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,247.53	2,863.67	5,518	790,219	石油・ガス・消耗燃料
TUI AG-DI	450.43	298.24	267	38,326	ホテル・レストラン・レジャー
AVEVA GROUP PLC	－	57.04	301	43,168	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,147.15	2,011.44	654	93,785	資本市場
EXPERIAN PLC	803.95	698.42	1,971	282,338	専門サービス
MONDI PLC	283.18	397.67	661	94,673	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	212.9	209.27	353	50,630	資本市場
FRESNILLO PLC NPR	156.39	–	–	–	金属・鉱業
OCADO GROUP PLC	–	310.11	361	51,801	インターネット販売・通信販売
INFORMA PLC	1,024.75	1,024.75	797	114,196	メディア
GLENCORE PLC	9,828.06	8,664.21	2,026	290,203	金属・鉱業
GVC HOLDINGS PLC	496.18	496.18	415	59,442	ホテル・レストラン・レジャー
EVRAZ PLC	–	487.65	187	26,920	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	81.49	81.49	63	9,043	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,126.94	1,126.94	392	56,159	保険
COCA-COLA HBC AG	194.47	152.08	431	61,849	飲料
CONVATEC GROUP PLC	1,184	–	–	–	ヘルスケア機器・用品
ROYAL MAIL PLC	550.6	–	–	–	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	500.37	–	–	–	ホテル・レストラン・レジャー
FERGUSON PLC	–	171.28	1,294	185,328	商社・流通業
M&G PLC	–	2,049.4	510	73,075	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	–	320.86	278	39,854	専門小売り
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	323.42	261	209	29,974	ソフトウェア
AUTO TRADER GROUP PLC	763.48	763.48	449	64,395	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,176.2	3,647.35	866	124,046	電気設備
小計 株数・金額	260,125.86	232,616.39	138,461	19,827,669	
小計 銘柄数<比率>	92銘柄	93銘柄	–	<5.4%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	784.28	797.54	2,280	72,965	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,280.49	1,063.99	2,597	83,110	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	1,882.3	–	–	–	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	17.6	17.6	952	30,486	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	–	1,021.34	1,581	50,593	銀行
ISRAEL CHEMICALS LTD	494.11	494.11	684	21,898	化学
NICE LTD	60.65	49.02	3,015	96,487	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	104.44	104.44	994	31,816	銀行
AZRIELI GROUP	44.28	22.91	641	20,527	不動産管理・開発
小計 株数・金額	4,668.15	3,570.95	12,746	407,884	
小計 銘柄数<比率>	8銘柄	8銘柄	–	<0.1%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,180.4	1,914.83	2,576	288,067	資本市場
NESTLE SA-REGISTERED	2,679.67	2,303.64	24,777	2,770,422	食品
CIE FINANC RICHEMONT	465.47	409.15	3,047	340,724	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	613.98	544.32	18,539	2,072,905	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	36.07	28.96	701	78,392	機械
SIKA INHABER	112.91	102.09	1,903	212,883	化学
SGS SA-REG	4.84	4.24	1,125	125,819	専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS	1,875.05	1,662.22	15,894	1,777,124	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R	41.27	32.52	590	66,030	保険
BARRY CALLEBAUT AG	1.44	2.65	581	65,066	食品
CLARIANT AG-REG	194.96	122.82	290	32,532	化学
SWISSCOM AG-REG	22.8	19.6	1,119	125,133	各種電気通信サービス
ABB LTD	1,623.58	1,408.52	3,350	374,660	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	123.41	129.44	755	84,433	専門サービス
GEBERIT AG	32.43	29.01	1,520	170,029	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG	62.28	57.93	2,415	270,032	ライフサイエンス・ツール／サービス
LINDT & SPRUENGLI PART	1.05	0.79	661	73,976	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.09	0.09	822	91,974	食品
GIVAUDAN-REG	7.71	7.42	2,470	276,266	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	130.46	115.58	5,005	559,695	保険

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
LAFARGEHOLCIM LTD	406.15	379.97	1,888	211,147	建設資材
TEMENOS GROUP	45.21	47.3	792	88,610	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG	53.19	45.84	1,172	131,055	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG	51.05	40.18	638	71,363	海運業
STRAUMANN HOLDING AG	7.82	7.94	766	85,723	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	26.91	21.34	539	60,366	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	45.92	221	24,819	繊維・アパレル・贅沢品
SCHINDLER NAMEN	16.63	16.63	390	43,621	機械
SWISS LIFE HOLDING AG	31.19	24.58	1,270	142,086	保険
VIFOR PHARMA AG	45.83	34.65	652	73,009	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING	9.04	6.33	407	45,614	化学
SWISS PRIME SITE AG	59.9	59.9	739	82,646	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING PORTEUR	30	30	242	27,085	各種金融サービス
DUFRY GROUP	23.9	31.38	268	30,033	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	15.05	15.05	1,419	158,716	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	178.49	178.49	897	100,303	資本市場
SWISS RE LTD	276.09	225.97	2,607	291,566	保険
ALCON INC	－	320.32	1,969	220,154	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG	3,364.64	3,016.86	3,911	437,329	資本市場
小計 株数・金額	14,896.88	13,444.47	108,947	12,181,428	
小計 銘柄数<比率>	38銘柄	39銘柄	－	<3.3%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
CARLSBERG AS-B	96.44	84.41	8,656	137,807	飲料
A P MOLLER A/S	6.04	4.91	4,212	67,067	海運業
AP MOLLER MAERSK A	2.73	2.73	2,200	35,030	海運業
DANSKE BANK A/S	611.14	510.34	6,203	98,754	銀行
GENMAB A/S	56.22	50.14	8,187	130,350	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS	191.11	155.33	5,874	93,523	化学
NOVO NORDISK A/S-B	1,596.6	1,369.25	59,706	950,521	医薬品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	158.08	139.63	9,723	154,803	電気設備
COLOPLAST-B	112.12	97.29	9,230	146,955	ヘルスケア機器・用品
DSV PANALPINA A S	171.23	176.26	13,713	218,311	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	65.37	72.44	1,682	26,778	ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S	48.4	48.4	1,260	20,072	医薬品
TRYG A/S	111.07	111.07	2,303	36,673	保険
PANDORA A/S	82.51	82.51	2,813	44,792	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	77.08	75.39	4,108	65,411	化学
ISS A/S	162.4	111.07	1,882	29,971	商業サービス・用品
ORSTED A/S	172.49	150.9	11,211	178,492	電力
小計 株数・金額	3,721.03	3,242.07	152,972	2,435,317	
小計 銘柄数<比率>	17銘柄	17銘柄	－	<0.7%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
MOWI ASA	330	351.83	7,895	93,714	食品
DNB ASA	797.83	713.52	12,504	148,427	銀行
NORSK HYDRO ASA	1,371.9	931.39	2,748	32,625	金属・鉱業
TELENOR ASA	620.76	547.66	8,883	105,441	各種電気通信サービス
ORKLA ASA	848.09	649.38	5,747	68,217	食品
EQUINOR ASA	983.97	810.22	13,028	154,646	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	160	121.71	4,607	54,696	化学
AKER BP ASA	85.52	85.52	2,197	26,078	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	166.83	3,461	41,090	保険
SCHIBSTED ASA	74.45	74.45	1,935	22,976	メディア
小計 株数・金額	5,439.35	4,452.51	63,008	747,914	
小計 銘柄数<比率>	10銘柄	10銘柄	－	<0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	571.91	522.84	19,679	222,577	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	383.14	287.68	9,525	107,728	機械

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(スウェーデン)	百株	百株	ﾁｽｳｪｰﾃﾞﾝ・ｸﾛｰﾅ	千円	
ERICSSON LM-B SHS	2,717.83	2,361.6	20,829	235,579	通信機器
LUNDBERGS B	73.82	73.82	3,284	37,153	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	371.98	288.12	5,493	62,125	機械
SANDVIK AB	967.46	877.84	16,187	183,079	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,475.88	1,308.27	13,121	148,409	銀行
SKANSKA AB-B SHS	325.47	244	5,824	65,872	建設・土木
SWEDBANK AB	824.1	719.58	11,293	127,732	銀行
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,265.39	1,121.06	12,281	138,900	銀行
VOLVO AB-B SHS	1,416.08	1,192.27	20,668	233,755	機械
SWEDISH MATCH AB	164.88	129.41	7,686	86,939	タバコ
TELE2 AB-B SHS	448.76	346.18	5,085	57,515	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN C	114.03	114.03	2,884	32,628	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	191.91	4,277	48,380	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	240.98	240.98	3,577	40,459	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	376.57	351.8	19,813	224,089	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	777.79	602.83	12,327	139,428	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	883.27	810.88	19,550	221,114	建設関連製品
TELIA CO AB	2,318.55	2,318.55	9,603	108,614	各種電気通信サービス
LUNDIN PETROLEUM AB	167.9	121.46	3,655	41,348	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	218.55	218.55	5,100	57,691	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	233.43	233.43	5,926	67,031	機械
KINNEVIK AB-B	183.1	183.1	4,255	48,126	各種金融サービス
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	53.32	78.44	3,556	40,223	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	59.2	59.2	2,362	26,715	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	336.92	2,466	27,893	家庭用耐久財
HEXAGON AB	220.37	211.45	11,959	135,263	電子装置・機器・部品
EPIROC AB-A	633.58	489.55	5,837	66,026	機械
EPIROC AB-B	308.99	308.99	3,627	41,027	機械
ESSITY AB-B	525.22	466.4	14,714	166,425	家庭用品
NORDEA BANK ABP	2,678.38	2,592.68	22,229	251,417	銀行
小計 株数・金額	21,528.76	19,403.82	308,689	3,491,276	
小計 銘柄数<比率>	32銘柄	32銘柄	－	<0.9%>	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	713.94	619.9	2,217	263,779	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	62.46	62.46	636	75,714	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	138.65	122.58	1,430	170,173	食品
KINGSPAN GROUP PLC	147.56	117.68	706	83,995	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	173.97	173.97	606	72,103	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,063.63	822.56	339	40,334	銀行
AIB GROUP PLC	523.22	413.52	99	11,796	銀行
小計 株数・金額	2,823.43	2,332.67	6,034	717,896	
小計 銘柄数<比率>	7銘柄	7銘柄	－	<0.2%>	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	515.53	451.22	5,859	697,051	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	151.11	137.16	1,586	188,700	化学
ING GROEP NV-CVA	3,412.95	3,045.08	3,261	387,961	銀行
RANDSTAD NV	120.61	90.74	500	59,563	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,096.41	890.26	2,063	245,488	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	230.51	195.82	2,033	241,915	飲料
AKZO NOBEL	187.86	174.91	1,524	181,356	化学
ASML HOLDING NV	360.62	330.53	9,682	1,151,874	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,503.49	1,503.49	572	68,072	保険
UNILEVER NV-CVA	1,348.83	－	－	－	パーソナル用品
KONINKLIJKE PHILIPS NV	832.6	719.25	3,204	381,178	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	250.51	206.87	1,446	172,018	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	556.11	556.11	1,609	191,518	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	173.87	179.74	616	73,297	ライフサイエンス・ツール／サービス

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOPAK (KON.)	53.64	53.64	272	32,428	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV	2,910.29	2,910.29	727	86,586	各種電気通信サービス
HEINEKEN HOLDING NV-A	97.91	97.91	907	107,971	飲料
UNILEVER NV	－	1,131.34	6,205	738,194	パーソナル用品
FERRARI NV	108.95	89.34	1,427	169,780	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	943.17	779.51	683	81,306	機械
PROSUS NV	－	368.71	2,651	315,365	インターネット販売・通信販売
NN GROUP NV	285.28	217.2	784	93,301	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	899.77	790.84	969	115,358	自動車
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	－	90	846	100,693	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ABN AMRO BANK NV	342.51	342.51	520	61,871	銀行
EXOR NV	77.26	79.71	595	70,870	各種金融サービス
ALTICE EUROPE NV	－	567.63	370	44,107	メディア
ADYEN NV	－	8.18	722	85,982	情報技術サービス
小計 株数・金額	16,459.79	16,007.99	51,646	6,143,817	
小計 銘柄数<比率>	23銘柄	27銘柄	－	<1.7%>	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	191.09	141.15	635	75,543	化学
KBC GROUPE	208.03	185.77	1,346	160,130	銀行
SOLVAY SA	70.86	55.63	542	64,536	化学
AGEAS	179.04	143.65	756	89,954	保険
UCB SA	112.67	90.95	816	97,093	医薬品
COLRUYT NV	46.73	46.73	216	25,793	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	84.48	66.89	627	74,638	各種金融サービス
PROXIMUS	142.83	142.83	376	44,805	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	－	34.26	820	97,650	バイオテクノロジー
TELENET GROUP HOLDING NV	36.34	36.34	150	17,845	メディア
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	658.58	587.31	3,979	473,344	飲料
小計 株数・金額	1,730.65	1,531.51	10,266	1,221,337	
小計 銘柄数<比率>	10銘柄	11銘柄	－	<0.3%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELOR MITTAL (NL)	581.89	467.14	748	89,046	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	7.94	8.99	423	50,371	ライフサイエンス・ツール／サービス
TENARIS SA	369.59	369.59	355	42,339	エネルギー設備・サービス
SES FDR	342.68	288.47	318	37,919	メディア
RTL GROUP SA	34.46	－	－	－	メディア
AROUNDTOWN SA	717.83	717.83	630	74,975	不動産管理・開発
小計 株数・金額	2,054.39	1,852.02	2,476	294,652	
小計 銘柄数<比率>	6銘柄	5銘柄	－	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	370.92	363.17	5,040	599,653	化学
AXA	1,652.52	1,481.6	3,772	448,735	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	496.32	444.49	1,246	148,318	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	2.74	1.63	177	21,174	航空宇宙・防衛
DANONE	540.23	488.33	3,541	421,281	食品
SAFRAN SA	292.68	258.98	3,755	446,719	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	160	122.77	472	56,242	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	222.76	175.72	678	80,729	建設・土木
BNP PARIBAS	969.88	864.34	4,639	551,947	銀行
THALES SA	98.83	85.49	820	97,630	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	137.59	125.15	1,438	171,135	情報技術サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	42.64	42.64	157	18,676	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	43.34	43.34	593	70,633	電子装置・機器・部品
NATIXIS	701.66	701.66	305	36,317	資本市場
EIFFAGE	59.49	64.61	713	84,930	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	182.22	151.98	621	73,981	メディア
FAURECIA	61.17	61.17	263	31,304	自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IMERYS SA	22.56	−	−	−	建設資材
L'OREAL	215.81	195.54	5,244	623,871	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	244.37	214.86	8,915	1,060,601	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	713.47	713.47	268	31,929	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	150.18	124.22	1,351	160,776	自動車部品
PERNOD-RICARD	184.79	167.19	2,775	330,156	飲料
PEUGEOT SA	500.87	439.05	850	101,168	自動車
RENAULT SA	177.86	149.17	514	61,221	自動車
REMY COINTREAU	18.6	18.6	186	22,170	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	443.31	394.36	1,415	168,370	建設関連製品
SEB SA	14.05	15.51	185	22,122	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	697.92	611.81	1,941	230,933	銀行
VINCI S.A.	438.89	392.37	4,151	493,835	建設・土木
SODEXO	86.39	70.75	706	84,012	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	480.32	436.56	4,234	503,751	電気設備
VIVENDI SA	935.6	679.89	1,720	204,625	娯楽
TOTAL SA	2,125.19	1,860.2	8,417	1,001,334	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	247.98	196.53	534	63,614	自動車部品
ORANGE	1,726.54	1,512.46	2,020	240,376	各種電気通信サービス
HERMES INTL	27.03	24.83	1,750	208,241	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	24.78	−	−	−	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	109.13	99.53	1,545	183,876	ソフトウェア
KERING	66.09	58.3	3,377	401,835	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	235	28,003	保険
CARREFOUR SA	510.94	510.94	810	96,368	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	88.16	73.04	590	70,240	情報技術サービス
SANOFI	977.88	871.69	8,040	956,494	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	59.11	59.35	443	52,712	娯楽
TELEPERFORMANCE	53.63	43.83	1,058	125,970	専門サービス
EURAZEO	47.25	27.48	180	21,444	各種金融サービス
JC DECAUX SA	60.58	60.58	139	16,546	メディア
ESSILORLUXOTTICA	241.21	217.61	3,032	360,733	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	999.73	862.05	1,162	138,339	銀行
WENDEL	22.2	22.2	278	33,169	各種金融サービス
ILIAD SA	21.02	21.02	283	33,682	各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	32.48	32.48	302	35,933	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	28.81	18.84	341	40,655	ライフサイエンス・ツール／サービス
ENGIE	1,597.35	1,392.72	2,247	267,321	総合公益事業
ALSTOM	120.46	157.12	763	90,838	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	125.42	125.42	154	18,336	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	538	538	692	82,336	電力
IPSEN SA	36.46	36.46	249	29,688	医薬品
ARKEMA SA	52.3	50.33	432	51,502	化学
LEGRAND SA	233.08	206.73	1,573	187,149	電気設備
ADP	23.13	23.13	390	46,418	運送インフラ
SCOR SE	138.75	101.16	376	44,802	保険
REXEL SA	232.45	−	−	−	商社・流通業
BUREAU VERITAS SA	214.8	231.79	591	70,423	専門サービス
GETLINK	376.46	376.46	627	74,609	運送インフラ
SUEZ SA	383.31	266.2	399	47,500	総合公益事業
EDENRED	226.52	191.88	948	112,874	情報技術サービス
WORLDLINE SA	−	77.58	573	68,247	情報技術サービス
AMUNDI SA	38.94	41.19	316	37,656	資本市場
小計 株数・金額	23,307.02	20,629.42	107,584	12,798,244	
小計 銘柄数<比率>	69銘柄	67銘柄	−	<3.5%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	163.56	139	4,008	476,882	繊維・アパレル・贅沢品

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

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
INNOGY SE-TEMPORARY	97.69	−	−	−	総合公益事業
ZALANDO SE	143.53	99.64	472	56,267	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	158.02	127.08	496	59,109	化学
UNIPER SE	138.97	142.52	420	50,048	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	72.38	80.81	640	76,193	インターネット販売・通信販売
小計 株数・金額	20,772.55	18,422.22	90,303	10,742,544	
小計 銘柄数<比率>	61銘柄	57銘柄	−	<2.9%>	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	195.17	195.17	329	39,156	食品・生活必需品小売り
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,420.94	2,016.06	950	113,032	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	522.32	400.88	560	66,621	石油・ガス・消耗燃料
小計 株数・金額	3,138.43	2,612.11	1,839	218,809	
小計 銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄	−	<0.1%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	5,323.01	4,772.67	5,180	616,300	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	144.26	158.85	247	29,393	電気設備
REPSOL SA	1,267.23	1,149.98	1,454	173,054	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	4,153.79	3,677.55	2,297	273,294	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	293.14	234.17	587	69,920	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	232.16	201.37	629	74,883	建設・土木
BANKINTER S.A.	579.6	579.6	363	43,189	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,956.67	5,235.94	2,745	326,569	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	290.1	236.12	564	67,188	ガス
BANCO SANTANDER SA	14,112.32	12,640.63	4,958	589,913	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	345.96	345.96	658	78,277	電力
BANCO SABADELL	5,633.71	4,136.31	352	41,923	銀行
INDITEX	967.34	838.83	2,636	313,631	専門小売り
MAPFRE SA	844.74	844.74	204	24,308	保険
ENAGAS	180.95	180.95	463	55,170	ガス
GRIFOLS SA	235.18	235.18	776	92,352	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	468.31	386.66	1,154	137,393	建設・土木
CAIXABANK	2,972.24	2,972.24	834	99,249	銀行
AMADEUS IT GROUP SA	384.92	338.91	2,468	293,667	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	447.47	−	−	−	旅客航空輸送業
BANKIA SA	1,006.75	1,006.75	169	20,180	銀行
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION-RTS	231.8	−	−	−	建設・土木
AENA SME SA	61.75	53.38	898	106,903	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	−	197.8	937	111,557	各種電気通信サービス
小計 株数・金額	46,133.4	40,424.59	30,584	3,638,321	
小計 銘柄数<比率>	23銘柄	22銘柄	−	<1.0%>	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	1,040.14	870.3	1,629	193,809	保険
INTESA SANPAOLO	13,499.21	11,576.31	2,902	345,243	銀行
UNICREDIT SPA	1,701.44	1,557.18	2,162	257,227	銀行
ENI SPA	2,222.05	1,978.38	2,550	303,410	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	620.22	416.39	399	47,582	銀行
ENEL SPA	6,744.93	6,323.33	5,233	622,615	電力
LEONARDO SPA	262.69	283.16	324	38,653	航空宇宙・防衛
SNAM SPA	1,997.02	1,691.63	844	100,517	ガス
TELECOM ITALIA SPA	11,584.73	7,626.75	394	46,906	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	4,975.96	254	30,248	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	436.88	373.65	853	101,477	運送インフラ
TERNA SPA	1,126.86	1,136.54	738	87,800	電力
RECORDATI SPA	68.59	68.59	276	32,923	医薬品
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	557.25	397.52	356	42,370	飲料
PRYSMIAN SPA	294.18	214.52	509	60,659	電気設備
MONCLER SPA	143.53	143.53	546	65,053	繊維・アパレル・贅沢品

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
FINECOBANK SPA		–	450.48	491	58,519	銀行
POSTE ITALIANE SPA		400.15	400.15	438	52,124	保険
PIRELLI & C SPA		340.86	340.86	154	18,328	自動車部品
小計	株数・金額	48,016.69	40,825.23	21,061	2,505,470	
	銘柄数<比率>	18銘柄	19銘柄	–	<0.7%>	
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ		349.35	349.35	390	46,441	機械
NOKIAN RENKAAT OYJ		93.99	93.99	255	30,378	自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		493.71	399.09	1,199	142,712	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS		423.03	419.15	512	61,006	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		394.03	361.41	1,492	177,562	保険
FORTUM OYJ		374.52	374.52	830	98,773	電力
NOKIA OYJ		4,959.75	4,308	1,698	202,019	通信機器
ELISA OYJ		141.76	107.87	610	72,579	各種電気通信サービス
METSO OYJ		85.85	85.85	285	33,947	機械
NESTE OYJ		108.4	329.31	1,287	153,212	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ		291.24	265.02	1,533	182,476	機械
ORION OYJ		80.51	80.51	315	37,524	医薬品
小計	株数・金額	7,796.14	7,174.07	10,412	1,238,634	
	銘柄数<比率>	12銘柄	12銘柄	–	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG		128.17	128.17	563	67,041	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG		67.78	49.08	238	28,387	電力
VOEST-ALPINE AG		98.75	98.75	225	26,877	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		251.17	209.43	742	88,294	銀行
ANDRITZ AG		62.65	62.65	222	26,502	機械
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		96.41	96.41	217	25,839	銀行
小計	株数・金額	704.93	644.49	2,210	262,942	
	銘柄数<比率>	6銘柄	6銘柄	–	<0.1%>	
合計	株数・金額	975,274.54	858,545.81	–	350,796,430	
	銘柄数<比率>	1,245銘柄	1,254銘柄	–	<94.7%>	

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
不動産ファンド	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(アメリカ)					
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9.644	8.646	1,512	166,066	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	13.309	12.027	1,770	194,426	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	–	17.771	787	86,479	0.0
SL GREEN	7.097	7.097	674	74,059	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	125.554	108.247	1,127	123,847	0.0
PROLOGIS INC	55.164	56.079	5,470	600,661	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12.353	10.491	2,387	262,094	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	8.062	8.062	958	105,242	0.0
EQUINIX INC	6.964	6.522	4,230	464,508	0.1
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13.649	13.649	778	85,483	0.0
DUKE REALTY TRUST	32.954	27.278	1,049	115,252	0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	35.534	31.583	5,241	575,552	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5.653	5.075	1,645	180,638	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	32.976	27.869	2,409	264,569	0.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6	6	763	83,819	0.0

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	39.277	40.162	1,498	164,529	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	10.277	8.778	2,586	283,952	0.1
WELLTOWER INC	33.309	32.099	2,867	314,805	0.1
KIMCO REALTY	32.98	32.98	635	69,744	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	11.649	–	–	–	–
IRON MOUNTAIN INC	23.977	23.977	794	87,246	0.0
THE MACERICH COMPANY	9.014	–	–	–	–
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	–	13.626	1,025	112,569	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	64.001	55.116	932	102,334	0.0
MID AMERICA	10.258	8.834	1,285	141,140	0.0
REALTY INCOME CORP	26.616	23.491	1,885	206,989	0.1
REGENCY CENTERS CORP	13.023	11.403	730	80,156	0.0
UDR INC	21.658	22.345	1,124	123,459	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	26.5	23.306	3,237	355,496	0.1
PUBLIC STORAGE	13.721	12.188	2,837	311,569	0.1
SUN COMMUNITIES INC	–	7.418	1,246	136,827	0.0
VENTAS INC	30.244	29.505	1,762	193,569	0.1
VORNADO REALTY TRUST	15.346	12.472	846	92,970	0.0
WEYERHAEUSER CO	63.699	57.621	1,766	193,979	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	11.885	9.261	1,068	117,375	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	18.388	15.605	2,052	225,315	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	–	39.953	962	105,635	0.0
AGNC INVESTMENT CORP	44.741	44.741	865	95,008	0.0
VEREIT INC	93.429	82.604	828	90,971	0.0
AMERICAN TOWER CORP	38.497	34.213	8,767	962,625	0.3
WP CAREY INC	15.148	13.039	1,119	122,881	0.0
INVITATION HOMES INC	30.427	42.384	1,379	151,479	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19.124	–	–	–	–
VICI PROPERTIES INC	–	34.2	961	105,557	0.0
小計 口数・金額	1,082.101	1,077.717	75,873	8,330,894	–
小計 銘柄数<比率>	39銘柄<2.1%>	41銘柄<2.2%>	–	–	2.2
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
SMARTCENTRES REIT	9.288	3.067	96	7,989	0.0
CANADIAN APT PPTYS REIT	–	7.819	459	38,082	0.0
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10.748	10.748	230	19,129	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	–	17.676	385	31,972	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9.675	13.467	372	30,876	0.0
小計 口数・金額	29.711	52.777	1,545	128,051	–
小計 銘柄数<比率>	3銘柄<0.0%>	5銘柄<0.0%>	–	–	0.0
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
MIRVAC GROUP	295.783	329.418	1,083	79,907	0.0
GPT GROUP	144.955	158.232	987	72,798	0.0
LENDLEASE GROUP	60.871	–	–	–	–
STOCKLAND	194.018	194.018	975	71,953	0.0
DEXUS	80.596	84.575	1,114	82,186	0.0
GOODMAN GROUP	147.572	132.051	2,170	160,061	0.0
VICINITY CENTRES	270.443	270.443	673	49,650	0.0
SCENTRE GROUP	476.956	420.268	1,584	116,818	0.0
小計 口数・金額	1,671.194	1,589.005	8,590	633,377	–
小計 銘柄数<比率>	8銘柄<0.2%>	7銘柄<0.2%>	–	–	0.2
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	185.5	157.9	12,426	175,589	0.0
小計 口数・金額	185.5	157.9	12,426	175,589	–
小計 銘柄数<比率>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	–	–	0.0
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPITALAND MALL TRUST	199	199	501	39,576	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200.806	200.806	662	52,297	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206.3	206.3	429	33,864	0.0
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	192.1	345	27,288	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		–	192.3	449	35,512	0.0
小計	口数・金額	798.206	990.506	2,389	188,540	–
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.0%>	5銘柄<0.1%>	–	–	0.1
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC		71.871	69.819	410	58,768	0.0
HAMMERSON PLC		58.616	–	–	–	–
LAND SECURITIES GROUP PLC		59.062	55.843	556	79,631	0.0
SEGRO PLC		82.914	87.247	815	116,816	0.0
小計	口数・金額	272.463	212.909	1,782	255,216	–
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.1%>	3銘柄<0.1%>	–	–	0.1
(オランダ)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		12.061	10.898	1,383	164,581	0.0
小計	口数・金額	12.061	10.898	1,383	164,581	–
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	–	–	0.0
(フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		3.67	3.67	666	79,239	0.0
ICADE		2.234	2.234	234	27,877	0.0
KLEPIERRE		17.042	17.042	532	63,313	0.0
COVIVIO		4.675	4.265	472	56,266	0.0
小計	口数・金額	27.621	27.211	1,905	226,697	–
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.1%>	4銘柄<0.1%>	–	–	0.1
合計	口数・金額	4,078.857	4,118.923	–	10,102,948	–
	銘柄数<比率>	64銘柄<2.6%>	67銘柄<2.7%>	–	–	2.7

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT	7,276	–
	S&P/TSE 60 IX FUT	370	–
	SPI 200 FUTURES	221	–
	FTSE 100 INDEX FUTURE	569	–
	DJ EURO STOXX 50	1,679	–

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

■投資信託財産の構成

2020年2月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	350,796,430	94.6
投資信託受益証券、投資証券	10,102,948	2.7
コール・ローン等、その他	9,740,489	2.6
投資信託財産総額	370,639,867	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。
(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、370,367,645千円、99.9%です。
(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年2月17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.80円、1カナダ・ドル=82.86円、1オーストラリア・ドル=73.73円、1香港・ドル=14.13円、1シンガポール・ドル=78.92円、1ニュージーランド・ドル=70.61円、1イギリス・ポンド=143.20円、1イスラエル・シュケル=32.00円、1スイス・フラン=111.81円、1デンマーク・クローネ=15.92円、1ノルウェー・クローネ=11.87円、1スウェーデン・クローナ=11.31円、1ユーロ=118.96円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年２月17日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**371,336,825,866円**
コール・ローン等	6,549,317,097
株式(評価額)	350,796,430,193
投資信託受益証券(評価額)	821,917,447
投資証券(評価額)	9,281,030,671
未収入金	981,917,778
未収配当金	425,800,789
差入委託証拠金	2,480,411,891
(B) 負債	**916,378,668**
未払金	704,679,668
未払解約金	211,699,000
(C) 純資産総額(A－B)	**370,420,447,198**
元本	88,590,932,378
次期繰越損益金	281,829,514,820
(D) 受益権総口数	**88,590,932,378口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**41,812円**

(注１) 期首元本額 101,602,311,525円
追加設定元本額 23,968,777,744円
一部解約元本額 36,980,156,891円

(注２) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,405,331,645円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,265,172円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,568,890円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	9,804,082円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	31,959,861円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	25,017,559円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,341,477円
たわらノーロード　先進国株式	12,358,698,257円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	181,844,047円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	1,666,506,602円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	215,144,281円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	21,417,034円
たわらノーロード　バランス（標準型）	170,820,437円
たわらノーロード　バランス（積極型）	210,567,034円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	679,207円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	87,148,596円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	220,238,898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）	147,447,694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）	270,535,285円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	64,582円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,015,608円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,220,065円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,516,202円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,637,207円
たわらノーロード　全世界株式	43,988,328円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	42,514,197,886円
Ｏｎｅ ＤＣ 先進国株式インデックスファンド	189,412,832円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	176,623,075円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	878,800,098円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,066,933,587円
ＤＩＡＭ ＤＣ バランス30インデックスファンド	117,048,457円
ＤＩＡＭ ＤＣ バランス50インデックスファンド	341,782,574円
ＤＩＡＭ ＤＣ バランス70インデックスファンド	300,493,482円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	27,606,178円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	792,953,460円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	186,919,230円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国10）	206,435,395円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国20）	158,994,799円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国30）	277,906,766円
投資のソムリエ	1,161,944,551円
クルーズコントロール	194,095,583円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	110,373,729円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	175,641,805円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	100,302,518円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	196,533円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	553,382円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	2,320,962円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	63,170,120円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	668,936,157円
ワールドアセットバランス（基本コース）	439,823,625円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,662,660,975円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	1,709,520円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	1,370,366円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	565,992円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	1,592,751円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	11,750,393円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	563,321,995円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	144,219,671円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	261,455円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	222,668円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	257,387円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	65,132円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12（適格機関投資家限定）	25,533,156円
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	259,123,350円
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）	85,286,421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）	2,001,550,769円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	9,249,815,085円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	205,960,997円
ＤＩＡＭワールドバランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,470,386円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	17,813,512円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,958,854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）	135,238,394円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,631,553円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	48,605,100円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,643,533円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,877,279円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,536,268円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,685,027円
ＤＩＡＭバランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	375,124,662円
ＤＩＡＭバランスファンド37.5ＶＡ（適格機関投資家限定）	492,768,252円
ＤＩＡＭバランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,604,220,114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）	579,217,915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）	95,885,349円
ＤＩＡＭ 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）	618,117,607円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	27,550,457円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド55ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,905,718円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド35ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,443,862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）	214,153,029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）	24,495,642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）	88,530,403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）	152,767,521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）	444,738,720円
ＤＩＡＭバランス20ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,591,432円
ＤＩＡＭバランス40ＶＡ（適格機関投資家限定）	206,560円
ＤＩＡＭバランス60ＶＡ（適格機関投資家限定）	242,312円
期末元本合計	88,590,932,378円

■損益の状況

当期　自2019年２月16日　至2020年２月17日

項目	当期
(A) 配当等収益	**7,745,119,922円**
受取配当金	7,694,676,622
受取利息	12,104,811
その他収益金	38,840,064
支払利息	△501,575
(B) 有価証券売買損益	**59,213,874,771**
売買益	74,270,892,711
売買損	△15,057,017,940
(C) 先物取引等取引損益	**1,575,644,220**
取引益	1,915,607,176
取引損	△339,962,956
(D) その他費用	**△122,413,484**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**68,412,225,429**
(F) 前期繰越損益金	**248,087,509,699**
(G) 解約差損益金	**△99,035,323,364**
(H) 追加信託差損益金	**64,365,103,056**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**281,829,514,820**
次期繰越損益金(I)	**281,829,514,820**

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

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）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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）。

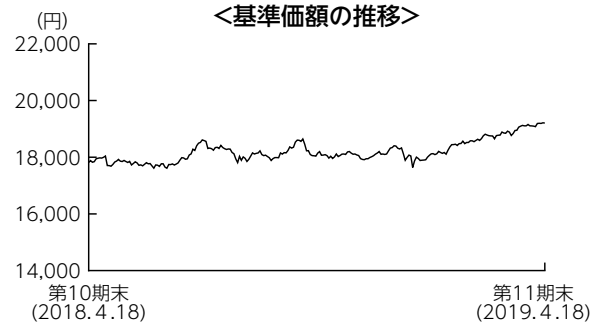
■当期中の基準価額と市況の推移

年　月　日	基準価額		ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし)(ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(期　首)	円	%	ポイント	%	%	%
2018　年　4　月　18　日	17,815	－	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	－

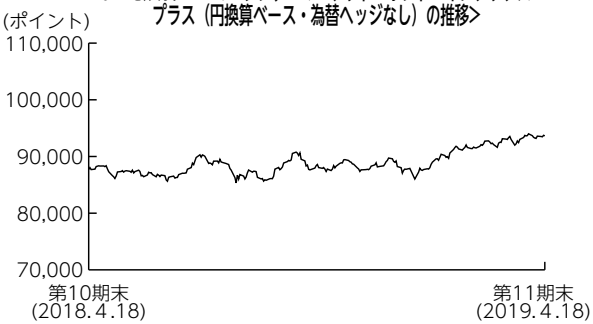
（注１）騰落率は期首比です。
（注２）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■**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>



<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）の推移>



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

【運用状況】

○国別構成比

期首（前期末）

国		ファンド	ベンチマーク	差
中南米	アルゼンチン	0.0%	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、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスです。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で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
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	国債証券	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年未満
	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	
（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	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	
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	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	
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
	千円	%
公社債	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
未収利息	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**
１万口当たり基準価額(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
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国10）	196,851,738円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国20）	178,790,603円
ＤＩＡＭＤＣ８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
クルーズコントロール	720,989,640円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>	866,443,655円
ＤＩＡＭ８資産バランスファンドN<ＤＣ年金>	150,180,507円
クルーズコントロール<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・イヤー2045）	3,585,101円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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・イヤー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・イヤー2040）	795,968円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	795,968円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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) 合計(D＋E＋F＋G)	**51,799,208,886**
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（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（ベンチマーク）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券、投資証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
7期(2015年4月20日)	11,412	22.2	250,241.33	23.2	95.4	3.6	0.9	41,339
8期(2016年4月18日)	8,600	△24.6	189,749.05	△24.2	92.8	6.1	1.0	36,196
9期(2017年4月18日)	10,121	17.7	224,042.80	18.1	95.8	3.2	0.9	40,863
10期(2018年4月18日)	12,241	20.9	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7	66,443
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）。

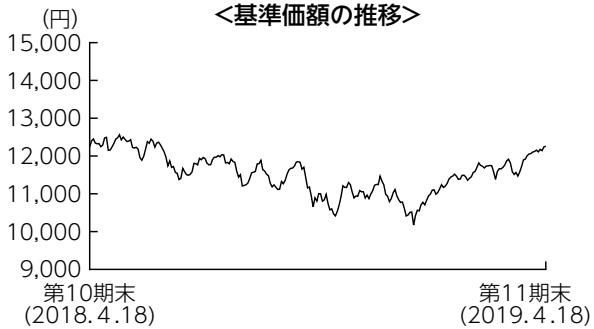
■当期中の基準価額と市況の推移

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(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)(ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券、投資証券組入比率
		騰落率		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

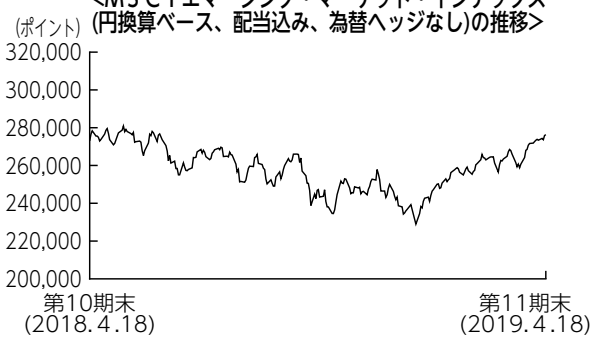
(注１) 騰落率は期首比です。
(注２) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注３) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■**当期の運用経過**（2018年４月19日から2019年４月18日まで）

<基準価額の推移>



<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)の推移>



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。

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	当期 比率
(a) 売買委託手数料	11円	0.091%
(株式)	(9)	(0.077)
(先物・オプション)	(2)	(0.013)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)
(投資証券)	(0)	(0.000)
(b) 有価証券取引税	11	0.094
(株式)	(11)	(0.094)
(投資証券)	(0)	(0.000)
(c) その他費用	16	0.143
(保管費用)	(14)	(0.125)
(その他)	(2)	(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 株数	買付 金額	売付 株数	売付 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 株数	買付 金額	売付 株数	売付 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
外国	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
外国	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
外国	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
外国	チェコ	百株 637.07 (－)	千チェコ・コルナ 9,092 (△22)	百株 744.1	千チェコ・コルナ 12,137
外国	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
外国	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
外国	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
外国	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
外国	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
外国	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
外国	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
外国	ユーロ　ギリシャ	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 証券数	買付 金額	売付 証券数	売付 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		売付	
	口数	金額	口数	金額
トルコ	千口	千トルコ・リラ	千口	千トルコ・リラ
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	−	−	231.071	399
	(−)	(−)	(−)	(−)
メキシコ	千口	千メキシコ・ペソ	千口	千メキシコ・ペソ
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	69.8	12,260	89.3	15,870
	(−)	(−)	(−)	(−)
CEMEX SAB DE CV	715.2	7,226	776.7	8,656
	(−)	(−)	(−)	(−)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	207	5,840	203.5	5,327
	(−)	(△159)	(−)	(−)
南アフリカ	千口	千南アフリカ・ランド	千口	千南アフリカ・ランド
HYPROP INVESTMENTS LTD	−	−	7.533	772
	(−)	(−)	(−)	(−)
FORTRESS REIT LTD-B	−	−	37.518	558
	(95.302)	(1,476)	(−)	(−)
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	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CTRIP.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
51JOB 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
AUTOHOME 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	27,352.59	24,857.87	66,349	7,433,825	
小計 銘柄数<比率>	37銘柄	50銘柄	－	<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
HUADIAN 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
ALUMINUM 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	コングロマリット
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 CRRC 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 HUISHAN 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・金額	779,691.89	892,466.75	981,470	14,015,400	
小計 銘柄数<比率>	139銘柄	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
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	906.56	543.93	2,328	8,450	不動産管理・開発
RUENTEX 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) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(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
INNOLUX 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	343,730.4	311,006.96	1,833,403	6,655,254	
小計 銘柄数<比率>	90銘柄	87銘柄	－	<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	－	227.56	184	26,881	
小計 銘柄数<比率>	－銘柄	1銘柄	－	<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	17,330.76	14,542.25	16,207	315,065	
小計 銘柄数<比率>	24銘柄	18銘柄	－	<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)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
GRUPO TELEVISA SAB	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	66,826.3	59,294.65	216,398	1,287,571	
小計 銘柄数<比率>	23銘柄	23銘柄	－	<2.1%>	
(フィリピン)	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	68,466.49	60,163.4	287,943	624,836	
小計 銘柄数<比率>	23銘柄	23銘柄	－	<1.0%>	
(チリ)	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)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(チリ)	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
COLBUN 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	369,948.11	290,987.83	3,521,029	596,110	
小計 銘柄数<比率>	18銘柄	17銘柄	－	<1.0%>	
(コロンビア)	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	10,650.8	10,076.44	7,277,830	258,362	
小計 銘柄数<比率>	9銘柄	9銘柄	－	<0.4%>	
(カタール)	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	コングロマリット
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	2,753.98	2,389.52	17,255	529,567	
小計 銘柄数<比率>	12銘柄	10銘柄	－	<0.9%>	
(インド)	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	–	–	–	コングロマリット
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	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	716.16	508.92	20,135	32,820	運送インフラ
REC LTD	856.77	551.73	8,300	13,530	各種金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD	37.2	37.23	28,216	45,992	保険
BAJAJ AUTO LTD	84.02	79.67	24,446	39,847	自動車
COAL INDIA LTD	759.01	1,124.57	28,294	46,119	石油・ガス・消耗燃料
TATA MOTORS LTD	315.68	−	−	−	自動車
VAKRANGEE LTD	359.54	−	−	−	情報技術サービス
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	329.95	289.33	12,185	19,861	消費者金融
BHARTI INFRATEL LTD	283.64	322.96	10,107	16,474	各種電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	344.12	254.66	21,199	34,554	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	23.33	23.33	223	363	金属・鉱業
CADILA HEALTHCARE LTD	181.46	169.62	5,731	9,342	医薬品
AVENUE SUPERMARTS LTD	−	112.16	15,821	25,789	食品・生活必需品小売り
IDFC BANK LTD	1,144.21	−	−	−	銀行
INTERGLOBE AVIATION LTD	−	83	13,129	21,401	旅客航空輸送業
小計 株数・金額	56,633.8	54,947.24	3,245,320	5,289,872	
小計 銘柄数<比率>	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	2,292	1,679	24,483	19,587	
小計 銘柄数<比率>	5銘柄	3銘柄	−	<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) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	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	310,884.42	273,663.42	157,318,009	1,258,544	
小計 銘柄数<比率>	29銘柄	28銘柄	－	<2.0%>	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千アラブ首長国連邦・ディルハム	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	－	－	－	コングロマリット
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	21,344.13	19,061.42	12,638	386,112	
小計 銘柄数<比率>	10銘柄	9銘柄	－	<0.6%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	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 RENNER 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) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(ブラジル)	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	52,917.21	51,338.8	138,540	3,937,324	
小計 銘柄数<比率>	54銘柄	52銘柄	－	<6.4%>	
(チェコ)	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	880.13	773.1	18,936	93,359	
小計 銘柄数<比率>	4銘柄	3銘柄	－	<0.2%>	
(韓国)	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	コングロマリット
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)	当期末			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) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(韓国)	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	コングロマリット
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 HOLDIMGS 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	コングロマリット
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 ABYSS 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・金額	9,498.66	14,106.56	78,200,380	7,734,017	
小計 銘柄数<比率>	114銘柄	114銘柄	–	<12.6%>	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	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)	当期末			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	千オフショア・人民元	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 PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	−	18	212	3,562	医薬品
HENGTONG 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) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	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	－	22,976.2	30,039	503,453	
小計 銘柄数<比率>	－銘柄	73銘柄	－	<0.8%>	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	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	コングロマリット
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	コングロマリット
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・鉱業
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	85,950.54	70,464.34	44,415	1,201,450	
小計 銘柄数<比率>	46銘柄	44銘柄	－	<2.0%>	

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	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	40,441.41	37,747.67	452,832	3,631,720	
小計 銘柄数<比率>	50銘柄	47銘柄	−	<5.9%>	

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイ・バーツ	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・金額	95,110.1	103,334.1	380,063	1,337,823	
小計 銘柄数<比率>	35銘柄	36銘柄	—	<2.2%>	
(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		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	
(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・金額	7,674.3	6,095.86	22,471	665,616	
	銘柄数<比率>	23銘柄	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・金額	741.47	695.21	472,587	187,239	
	銘柄数<比率>	3銘柄	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・金額	10,974.97	1,921.97	1,033	130,726	
	銘柄数<比率>	9銘柄	7銘柄	−	<0.2%>	
合計	株数・金額	2,382,094.46	2,324,818.12	−	58,119,723	
	銘柄数<比率>	837銘柄	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		期首（前期末）	当期末		
		証券数	証券数	評価額	
				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・金額	−	59,033	−	238
	銘柄数<比率>	−銘柄	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)	当期末		
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額
(トルコ)		千口	千口	千トルコ・リラ	千円
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM		231.071	−	−	−
小計	口数・金額	231.071	−	−	−
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.0%>	−銘柄<−%>	−	−
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコ・ペソ	千円
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D		203.9	184.4	33,477	199,193
CEMEX SAB DE CV		1,546.875	1,485.375	13,724	81,662
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		322.6	326.1	8,951	53,261
小計	口数・金額	2,073.375	1,995.875	56,154	334,117
	銘柄数<比率>	3銘柄<0.6%>	3銘柄<0.5%>	−	−
(南アフリカ)		千口	千口	千南アフリカ・ランド	千円
HYPROP INVESTMENTS LTD		29.707	22.174	1,646	13,204
FORTRESS REIT LTD-B		−	57.784	606	4,865
RESILIENT REIT LTD		28.6	28.6	1,605	12,874
小計	口数・金額	58.307	108.558	3,858	30,944
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.1%>	3銘柄<0.1%>	−	−
合計	口数・金額	2,362.753	2,104.433	−	365,061
	銘柄数<比率>	6銘柄<0.7%>	6銘柄<0.6%>	−	−

(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。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
外国	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	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	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・ローン等	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
追加設定元本額 37,610,929,316円
一部解約元本額 41,698,211,731円

(注２) 期末における元本の内訳

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
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（安定型）	3,316,467円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（中立型）	11,116,546円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（積極型）	13,466,899円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	29,486,742円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	30,019,978円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	17,894,922円
たわらノーロード 新興国株式	4,693,236,793円
たわらノーロード 新興国株式＜ラップ向け＞	1,745,232,327円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	295,037,515円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,803,077円
たわらノーロード バランス（標準型）	7,560,261円
たわらノーロード バランス（積極型）	15,098,973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
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
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
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
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
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	127,493円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	509,106円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	376,542円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,087,195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
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国10）	322,361,801円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国20）	287,554,676円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国30）	570,061,430円
投資のソムリエ	7,790,159,816円
クルーズコントロール	1,134,187,407円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	794,559,986円
ＤＩＡＭ８資産バランスファンドN＜ＤＣ年金＞	247,104,657円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	794,812円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	18,102,848円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	56,295,543円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	186,431,702円
ダイナミック・ナビゲーション	1,713,505円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,843,208,568円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,641,892,969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
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	2,640,706円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	2,310,127円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,309,203円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	4,477,478円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	274,183,673円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	7,252,317円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	596,693円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	596,693円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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
その他収益金	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。