Asset Management One

運 用 報 告 書（全体版）

第７期<決算日2020年６月11日>

ワールドアセットバランス（基本コース）

愛称：ワールドOne

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、「ワールドアセットバランス（基本コース）」は、2020年６月11日に第７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／海外／資産複合	
信託期間	2017年１月18日から2027年６月11日までです。	
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	ワールドアセットバランス（基本コース）	以下のマザーファンド受益証券、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ＥＴＦ）を主要投資対象とします。なお、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合もあります。
	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。
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。
	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。 ※ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンド受益証券、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ＥＴＦ）への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券（リート）に実質的に分散投資します。 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、為替変動リスクの低減をめざします。 ※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。 各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年１回見直します。 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。	
組入制限	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。 外貨建資産への実質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。	
分配方針	決算日（原則として６月、12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/

ワールドアセットバランス（基本コース）

■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
３期（2018年６月11日）	10,376	0	△1.6	28.1	1.1	57.2	－	－	10.6	16,409
４期（2018年12月11日）	10,007	0	△3.6	26.9	1.0	58.2	－	－	10.5	14,083
５期（2019年６月11日）	10,565	0	5.6	26.2	2.0	58.3	－	－	10.3	12,878
６期（2019年12月11日）	10,853	0	2.7	27.5	0.9	56.9	－	－	10.5	12,003
７期（2020年６月11日）	10,724	0	△1.2	26.0	2.4	60.0	－	－	8.9	11,343

（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）。

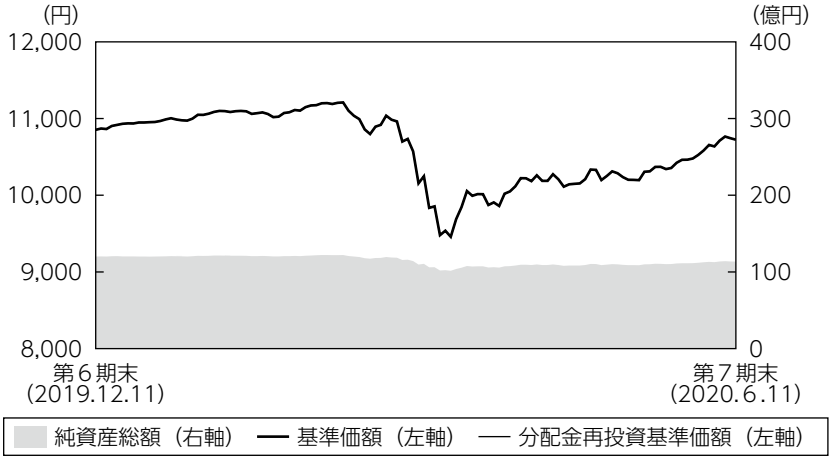
■当期中の基準価額の推移

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						
(期　首)	円	%	%	%	%	%	%	%
2019　年　12　月　11　日	10,853	－	27.5	0.9	56.9	－	－	10.5
12　月　末	10,988	1.2	27.7	1.8	56.9	－	－	10.1
2020　年　1　月　末	11,060	1.9	26.7	2.0	58.0	－	－	10.2
2　月　末	10,858	0.0	25.1	2.3	62.7	－	－	9.8
3　月　末	10,015	△7.7	22.0	5.2	64.9	－	－	8.8
4　月　末	10,335	△4.8	23.7	2.8	59.5	－	－	8.4
5　月　末	10,463	△3.6	24.0	2.9	61.1	－	－	8.4
(期　末)								
2020　年　6　月　11　日	10,724	△1.2	26.0	2.4	60.0	－	－	8.9

（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12月12日から2020年６月11日まで）

基準価額等の推移



第７期首：　10,853円
第７期末：　10,724円
（既払分配金０円）
騰　落　率：　△1.2%
（分配金再投資ベース）

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

基準価額の主な変動要因

当期は、債券市場を除き、株式市場やリート市場が下落したため、基準価額は下落しました。株式市場は米中通商協議の進展期待から上昇傾向で推移していました。しかし、2020年２月下旬から３月下旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大による経済悪化懸念や原油価格の急落などを背景に急落しました。その後、期末にかけては、米欧の経済活動再開への期待から上昇しましたが、期を通して見ると基準価額は下落しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	△1.3%
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.5%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△16.8%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	△6.2%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	△0.3%

投資環境

先進国株式市場はほぼ横ばいとなりました。米国株式市場は米中通商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２月下旬から３月下旬にかけて、欧米における新型コロナウイルスの感染拡大を受け、金融市場が大きな混乱に見舞われたことから急落しました。その後、期末にかけては、米欧の経済活動再開への期待から上昇し、前期末比で上昇となりました。欧州市場もほぼ同様の動きとなりましたが、各国市場は前期末比で概ね下落となりました。

先進国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りはともに低下しました。米国債利回り、ドイツ債利回りは、ＦＲＢ（米連邦準備理事会）による緊急利下げや、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、原油価格の大幅下落等、リスク回避姿勢が高まり、低下しました。経済対策による需給悪化懸念から乱高下する場面もありましたが、期を通じて見ると利回りは低下しました。

外国リート市場は下落しました。米国と豪州リート市場は2020年２月下旬以降、新型コロナウイルスの感染拡大懸念から大幅に下落しましたが、その後は感染拡大が落ち着きつつあるとの楽観的な見方が広がったことや、金融当局が打ち出した緊急資金供給策が好感され下げ幅を縮小しました。欧州リート市場は同様の理由から２月中旬以降大幅に下落し、その後も一進一退の展開となりましたが、期末にかけては行動制限緩和の動きや経済活動の段階的な再開への期待感などから上昇しました。

新興国株式市場は下落しました。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。2020年２月下旬から３月下旬にかけて、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による経済活動の停滞が懸念されたこと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。期末にかけては、感染拡大のピークアウト観測や欧米などの経済活動再開への期待から堅調な推移となりました。

新興国債券市場は上昇しました。期初から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たものの、その後は新型コロナウイルスの感染拡大による経済悪化懸念や原油価格の急落などを背景に、市場は大幅に下落しました。期末にかけては、欧米での経済活動再開に対する期待感や原油価格の上昇などから値を戻しました。米国長期金利は低下し、対米国債スプレッド（利回り格差）は拡大しました。

ポートフォリオについて

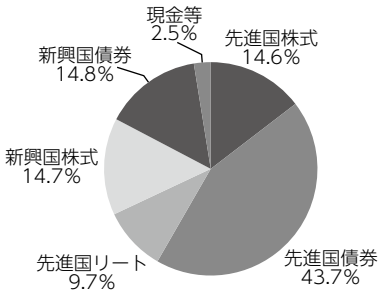
●当ファンド

基本投資比率に基づき、５つのマザーファンドとＥＴＦ（上場投資信託証券）への分散投資を行いました。
なお、当期の基本投資比率は以下の通りです。
先進国株式：15%、先進国債券：45%、先進国リート：10%、新興国株式：15%、新興国債券：15%

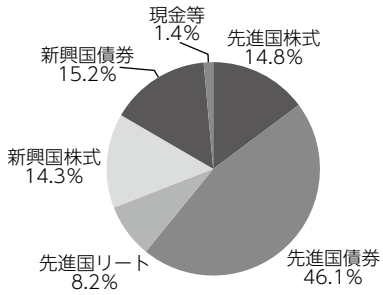
【運用状況】

○資産配分

期首（前期末）



期末



※１　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、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
※３　先進国株式：外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、先進国債券：為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、先進国リート：外国リート・パッシブ・ファンド・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、新興国債券：エマージング債券パッシブ・マザーファンド。また、マザーファンドの他に上場投資信託証券（ＥＴＦ）、有価証券指数等先物取引等を含む場合があります。

●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ました。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

ベンチマークである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。

●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。

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12月12日 ～2020年６月11日
当期分配金（税引前）		－円
対基準価額比率		－％
	当期の収益	－円
	当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額		881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、現行の基本投資比率に基づき５資産に分散投資を行い、信託財産の成長を図ります。
なお、基本投資比率は原則として年１回見直します。

●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。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●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。

●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。

■１万口当たりの費用明細

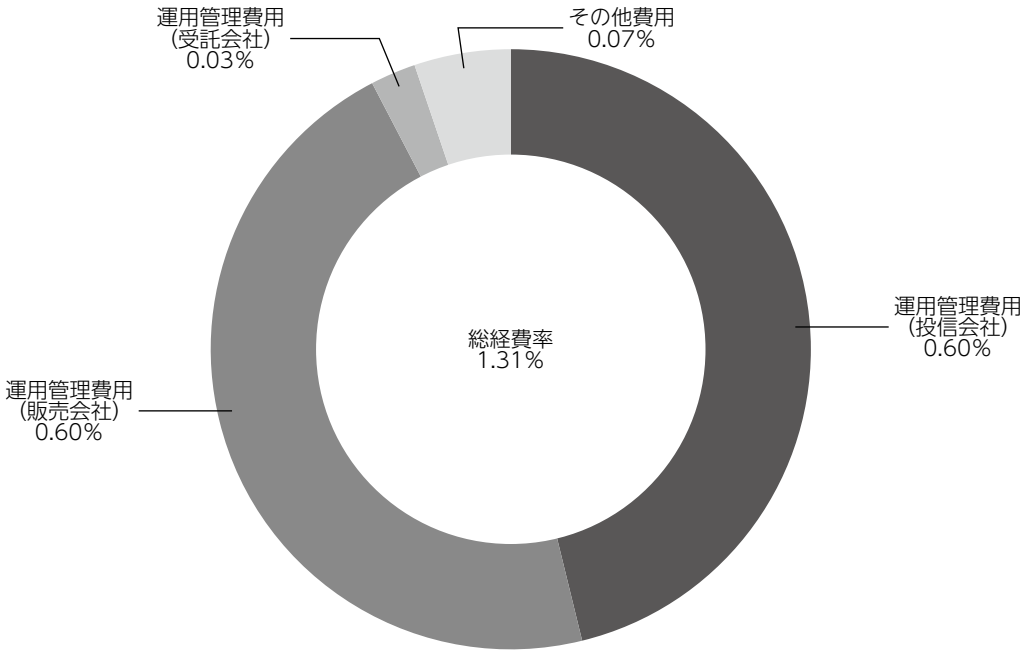
項目	第７期 (2019年12月12日 ～2020年６月11日)		項目の概要
	金額	比率	
(ａ) 信託報酬	66円	0.621％	(ａ) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,605円です。
(投信会社)	(32)	(0.302)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(32)	(0.302)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.016)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(ｂ) 売買委託手数料	2	0.020	(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)	(2)	(0.015)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(ｃ) 有価証券取引税	3	0.033	(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)	(3)	(0.028)	
(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)	(0.004)	
(ｄ) その他費用	4	0.034	(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)	(3)	(0.026)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(1)	(0.007)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	75	0.708	

(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。
(注４) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く）が支払った費用を含みません。

（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1.31％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12月12日から2020年６月11日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	－	－	13,051	52,000
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	71,154	100,000	213,891	308,700
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	－	－	31,534	43,000
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	－	－	30,324	37,400
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	－	－	22,694	49,400

■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	
	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	70,600,487千円	78,930,918千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	318,758,949千円	35,061,099千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.22	2.25

（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12月12日から2020年６月11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) 外国投資信託受益証券

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
(アメリカ・ドル)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF		13.3	13.3	299	32,079
合計	口数・金額	13.3	13.3	299	32,079
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.3%>	1銘柄<0.3%>	−	−

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券評価額の比率です。
(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) 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
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	452,875	439,823	1,678,235
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,731,953	3,589,216	5,227,334
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	843,657	812,123	931,261
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,495,045	1,464,721	1,590,247
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	866,488	843,793	1,720,072

■投資信託財産の構成

2020年６月11日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
投資信託受益証券	32,079	0.3
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,678,235	14.7
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,227,334	45.7
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	931,261	8.1
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,590,247	13.9
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,720,072	15.0
コール・ローン等、その他	269,682	2.4
投資信託財産総額	11,448,913	100.0

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

（注２）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６月11日現在、34,732千円、0.3％、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは359,126,485千円、99.9％、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは332,273,428千円、98.9％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは36,303,224千円、99.6％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは35,682,751千円、96.9％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは119,261,934千円、99.2％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６月11日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝107.01円、１カナダ・ドル＝79.77円、１オーストラリア・ドル＝74.67円、１香港・ドル＝13.81円、１シンガポール・ドル＝77.40円、１ニュージーランド・ドル＝69.81円、１台湾・ドル＝3.61円、１イギリス・ポンド＝136.34円、１イスラエル・シュケル＝31.17円、１スイス・フラン＝113.42円、１トルコ・リラ＝15.79円、１デンマーク・クローネ＝16.34円、１ノルウェー・クローネ＝11.50円、１スウェーデン・クローナ＝11.64円、１メキシコ・ペソ＝4.88円、１フィリピン・ペソ＝2.15円、100チリ・ペソ＝13.85円、100コロンビア・ペソ＝2.91円、１カタール・リアル＝29.23円、１サウジアラビア・リアル＝28.57円、１インド・ルピー＝1.42円、１パキスタン・ルピー＝0.65円、100インドネシア・ルピア＝0.77円、１アラブ首長国連邦・ディルハム＝29.18円、１ブラジル・レアル＝21.51円、１チェコ・コルナ＝4.58円、100韓国・ウォン＝9.01円、１オフショア・人民元＝15.16円、１マレーシア・リンギット＝25.24円、１南アフリカ・ランド＝6.48円、１タイ・バーツ＝3.46円、１ポーランド・ズロチ＝27.33円、100ハンガリー・フォリント＝35.42円、１ユーロ＝121.80円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年６月11日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**17,079,865,759円**
コール・ローン等	236,699,733
投資信託受益証券(評価額)	32,079,672
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,678,235,005
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	5,227,334,594
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	931,261,515
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	1,590,247,976
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	1,720,072,334
未収入金	5,663,934,930
(B) 負債	**5,736,755,934**
未払金	5,645,550,000
未払解約金	19,715,780
未払信託報酬	71,260,804
その他未払費用	229,350
(C) 純資産総額(A－B)	**11,343,109,825**
元本	10,577,163,269
次期繰越損益金	765,946,556
(D) 受益権総口数	**10,577,163,269口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**10,724円**

(注) 期首における元本額は11,059,805,125円、当期中における追加設定元本額は213,369,846円、同解約元本額は696,011,702円です。

■損益の状況

当期　自2019年12月12日　至2020年６月11日

項目	当期
(A) 配当等収益	**487,173円**
受取配当金	553,593
受取利息	7,895
支払利息	△74,315
(B) 有価証券売買損益	**△65,962,102**
売買益	419,143,445
売買損	△485,105,547
(C) 信託報酬等	**△71,822,234**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△137,297,163**
(E) 前期繰越損益金	**528,471,469**
(F) 追加信託差損益金	**374,772,250**
(配当等相当額)	(285,482,070)
(売買損益相当額)	(89,290,180)
(G) 合計(D＋E＋F)	**765,946,556**
次期繰越損益金(G)	**765,946,556**
追加信託差損益金	374,772,250
(配当等相当額)	(285,738,990)
(売買損益相当額)	(89,033,260)
分配準備積立金	647,065,158
繰越損益金	△255,890,852

(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	72,928,594円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	285,738,990
(d) 分配準備積立金	574,136,564
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	932,804,148
(f) １万口当たり当期分配対象額	881.90
(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。

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

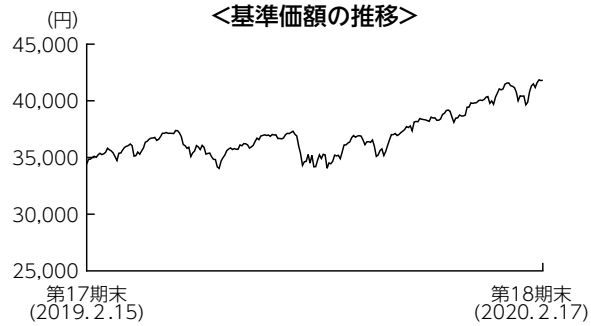
（注１）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。
（注２）ベンチマークはＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。
（注３）ＭＳＣＩコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．に帰属します。また、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。
（注４）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

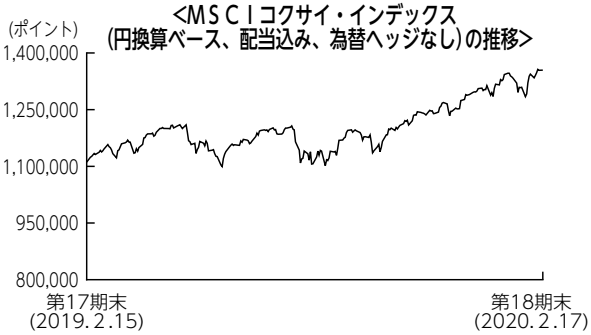
■当期中の基準価額と市況の推移

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６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
外国		アメリカ	百株 20,597.12 (944.38)	千アメリカ・ドル 148,036 (△3,748)	百株 52,364.81	千アメリカ・ドル 408,490
外国		カナダ	百株 3,511.18 (△1,155.8)	千カナダ・ドル 13,919 (△390)	百株 8,023.97	千カナダ・ドル 30,759
外国		オーストラリア	百株 4,492.22 (439.83)	千オーストラリア・ドル 8,156 (515)	百株 12,399.51	千オーストラリア・ドル 21,352
外国		香港	百株 8,847 (969.27)	千香港・ドル 25,910 (−)	百株 18,974.5	千香港・ドル 64,320
外国		シンガポール	百株 1,711 (−)	千シンガポール・ドル 1,203 (−)	百株 11,375.4	千シンガポール・ドル 3,530
外国		ニュージーランド	百株 1,097.05 (−)	千ニュージーランド・ドル 672 (−)	百株 912.87	千ニュージーランド・ドル 698
外国		イギリス	百株 16,501.3 (174,827.16)	千イギリス・ポンド 11,324 (△314)	百株 218,837.93	千イギリス・ポンド 27,695
外国		イスラエル	百株 1,257.5 (−)	千イスラエル・シュケル 2,010 (−)	百株 2,354.7	千イスラエル・シュケル 2,750
外国		スイス	百株 850.1 (375.47)	千スイス・フラン 6,472 (△480)	百株 2,677.98	千スイス・フラン 19,579
外国		デンマーク	百株 212.77 (17.54)	千デンマーク・クローネ 9,890 (−)	百株 709.27	千デンマーク・クローネ 27,146
外国		ノルウェー	百株 291.8 (74.45)	千ノルウェー・クローネ 5,929 (−)	百株 1,353.09	千ノルウェー・クローネ 15,917
外国		スウェーデン	百株 559.9 (243.67)	千スウェーデン・クローナ 8,994 (−)	百株 2,928.51	千スウェーデン・クローナ 42,541
外国	ユーロ	アイルランド	百株 341.42 (−)	千ユーロ 146 (−)	百株 832.18	千ユーロ 854
外国	ユーロ	オランダ	百株 1,455.84 (−)	千ユーロ 6,992 (−)	百株 1,907.64	千ユーロ 8,296
外国	ユーロ	ベルギー	百株 162.34 (−)	千ユーロ 1,541 (−)	百株 361.48	千ユーロ 2,387
外国	ユーロ	ルクセンブルグ	百株 131.92 (−)	千ユーロ 234 (−)	百株 334.29	千ユーロ 573
外国	ユーロ	フランス	百株 1,262.54 (71.83)	千ユーロ 7,234 (△12)	百株 4,011.97	千ユーロ 19,883
外国	ユーロ	ドイツ	百株 1,335.84 (54)	千ユーロ 6,531 (△409)	百株 3,740.17	千ユーロ 17,458
外国	ユーロ	ポルトガル	百株 − (−)	千ユーロ − (−)	百株 526.32	千ユーロ 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)	－ (－)	32.128 (－)	7 (－)
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・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ／ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
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) 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	
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) 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	
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・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
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・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
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・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
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) 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	
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)	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	
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)	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	
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	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
(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) 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
(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) 口数	当期末 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 36,980,111,891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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日　2019年６月24日）

（計算期間　2018年６月23日～2019年６月24日）

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）（ベンチマーク）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
８期（2015年６月22日）	12,930	4.1	371.27	4.2	98.1	－	179,224
９期（2016年６月22日）	13,626	5.4	391.61	5.5	92.9	－	164,686
10期（2017年６月22日）	13,477	△1.1	387.96	△0.9	97.9	－	177,029
11期（2018年６月22日）	13,246	△1.7	381.67	△1.6	98.0	－	290,732
12期（2019年６月24日）	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	－	454,858

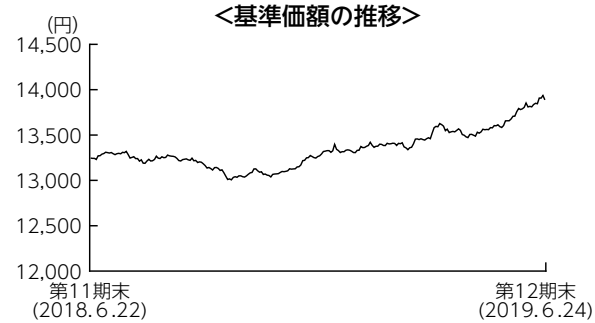
（注１）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
（注２）ベンチマークはＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）です（以下同じ）。
（注３）ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）は、ＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣにより運営されている債券インデックスです。ＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、ＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣに帰属します（以下同じ）。
（注４）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

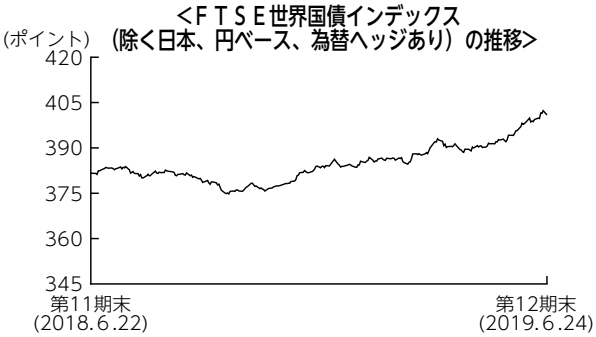
■当期中の基準価額と市況の推移

年　月　日	基準価額		FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジあり)(ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(期　首) 2018年6月22日	円 13,246	% －	ポイント 381.67	% －	% 98.0	% －
6月末	13,272	0.2	382.43	0.2	97.5	－
7月末	13,212	△0.3	380.68	△0.3	97.5	－
8月末	13,229	△0.1	381.23	△0.1	94.5	－
9月末	13,142	△0.8	378.76	△0.8	99.6	－
10月末	13,106	△1.1	377.76	△1.0	94.7	－
11月末	13,148	△0.7	378.89	△0.7	97.8	－
12月末	13,326	0.6	384.13	0.6	94.4	－
2019年1月末	13,385	1.0	385.88	1.1	95.9	－
2月末	13,370	0.9	385.50	1.0	98.6	－
3月末	13,615	2.8	392.62	2.9	95.5	－
4月末	13,521	2.1	389.98	2.2	97.8	－
5月末	13,708	3.5	395.72	3.7	94.8	－
(期　末) 2019年6月24日	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	－

(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６月23日から2019年６月24日まで）





基準価額の推移

基準価額は13,888円となり、前期末比で4.8％上昇しました。

基準価額の主な変動要因

世界的な景気減速を背景に、ＦＲＢ（米連邦準備理事会）が政策金利を引き下げる可能性が高まり、米国債利回りが低下（価格は上昇）したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

投資環境

外国債券市場では、米国債利回り、欧州債利回り、ともに低下しました。米国では世界的な景気減速に加え、米中貿易摩擦やブレグジット（英国のＥＵ離脱）等の不透明感があることから、ＦＲＢが政策金利を引き下げる可能性が高まり、米国債利回りは低下しました。欧州圏ではＥＣＢ（欧州中央銀行）が経済見通しを下方修正したことなどから、欧州債利回りは低下しました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で5.0％上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.2％下回りましたが、債券時価の採用基準が異なることを除くと、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

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	1円	0.011%
(保管費用)	(1)	(0.011)
(その他)	(0)	(0.000)
合計	1	0.011

（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（13,344円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については６ページ（１万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2018年６月23日から2019年６月24日まで）

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 1,727,124	千アメリカ・ドル 996,219 (－)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 95,579	千カナダ・ドル 64,817 (－)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 92,690	千オーストラリア・ドル 54,222 (－)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 11,840	千シンガポール・ドル 4,460 (－)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 172,380	千イギリス・ポンド 113,940 (－)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 76,449	千デンマーク・クローネ 58,854 (－)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 30,963	千ノルウェー・クローネ 20,731 (－)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 60,428	千スウェーデン・クローナ 30,099 (－)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 517,862	千メキシコ・ペソ 308,612 (－)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 11,009	千マレーシア・リンギット 11,734 (－)
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 248,200	千南アフリカ・ランド 179,348 (－)

				買付額	売付額
外国	ポーランド		国債証券	千ポーランド・ズロチ 63,945	千ポーランド・ズロチ 27,822 (－)
	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 38,864	千ユーロ 24,283 (－)
		オランダ	国債証券	76,616	44,422 (－)
		ベルギー	国債証券	80,521	46,009 (－)
		フランス	国債証券	274,219	161,227 (－)
		ドイツ	国債証券	154,501	84,783 (－)
		スペイン	国債証券	157,094	84,462 (－)
		イタリア	国債証券	207,405	132,875 (－)
		フィンランド	国債証券	40,102	23,587 (－)
		オーストリア	国債証券	61,086	41,115 (－)

（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６月23日から2019年６月24日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

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	1,897,040	1,959,720	210,513,189	46.3	－	19.4	18.2	8.7
カナダ	千カナダ・ドル 96,660	千カナダ・ドル 105,900	千円 8,619,241	1.9	－	0.9	0.6	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 103,840	千オーストラリア・ドル 119,687	千円 8,943,082	2.0	－	1.3	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 18,890	千シンガポール・ドル 19,773	千円 1,569,259	0.3	－	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 157,630	千イギリス・ポンド 202,660	千円 27,752,388	6.1	－	4.8	1.0	0.4
デンマーク	千デンマーク・クローネ 82,950	千デンマーク・クローネ 112,323	千円 1,838,735	0.4	－	0.3	0.1	－
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 58,270	千ノルウェー・クローネ 60,483	千円 765,110	0.2	－	0.1	0.1	－
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 93,620	千スウェーデン・クローナ 108,322	千円 1,245,710	0.3	－	0.2	0.1	－
メキシコ	千メキシコ・ペソ 583,851	千メキシコ・ペソ 594,064	千円 3,344,583	0.7	－	0.5	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 41,940	千マレーシア・リンギット 43,482	千円 1,127,076	0.2	－	0.2	0.1	－
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 292,370	千南アフリカ・ランド 269,204	千円 2,019,032	0.4	－	0.4	0.0	－
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 91,990	千ポーランド・ズロチ 96,120	千円 2,762,493	0.6	－	0.2	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	30,170	34,335	4,197,194	0.9	－	0.5	0.3	0.1
オランダ	68,190	81,211	9,927,255	2.2	－	1.2	0.8	0.1
ベルギー	76,370	95,276	11,646,643	2.6	－	1.7	0.7	0.1
フランス	291,320	355,190	43,418,518	9.5	－	6.7	2.2	0.7
ドイツ	190,530	232,138	28,376,636	6.2	－	3.6	2.0	0.6
スペイン	175,120	212,916	26,026,971	5.7	－	4.1	1.2	0.4
イタリア	264,820	293,577	35,886,879	7.9	－	5.3	2.1	0.5
フィンランド	29,480	31,928	3,902,995	0.9	－	0.3	0.4	0.2
オーストリア	48,530	57,967	7,085,945	1.6	－	1.0	0.5	0.1
合計	－	－	千円 440,968,947	96.9	－	52.9	31.4	12.7

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

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	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	8,050	8,400	902,424	2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	2,980	3,081	330,963	2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	3,780	3,852	413,847	2024/01/31
US T N/B 1.375 01/31/21	国債証券	1.3750	6,760	6,710	720,821	2021/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	8,180	8,172	877,869	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	10,750	11,082	1,190,481	2024/01/31
US T N/B 1.875 01/31/22	国債証券	1.8750	6,840	6,857	736,641	2022/01/31
US T N/B 2.5 01/31/21	国債証券	2.5000	17,950	18,135	1,948,145	2021/01/31
US T N/B 2.5 01/15/22	国債証券	2.5000	14,320	14,581	1,566,312	2022/01/15
US T N/B 2.375 01/31/23	国債証券	2.3750	2,760	2,817	302,616	2023/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	800	1,002	107,738	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	2,760	3,055	328,232	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	6,130	6,765	726,802	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	10,100	9,935	1,067,311	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	2,150	2,533	272,198	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	830	1,060	113,962	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	2,300	3,071	329,966	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	2,180	2,858	307,006	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	4,420	6,133	658,851	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	7,940	9,496	1,020,162	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	11,190	12,128	1,302,880	2049/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	10,000	10,060	1,080,741	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	1,210	1,588	170,626	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	5,110	6,960	747,678	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	11,830	11,617	1,247,942	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	10,160	10,005	1,074,841	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	12,980	14,071	1,511,517	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	8,610	9,308	999,885	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	11,930	12,429	1,335,177	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	21,670	21,823	2,344,318	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	21,640	22,690	2,437,426	2029/02/15
US T N/B 1.75 02/28/22	国債証券	1.7500	10,500	10,496	1,127,549	2022/02/28
US T N/B 3.625 02/15/21	国債証券	3.6250	7,430	7,647	821,475	2021/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	14,940	15,804	1,697,695	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	14,000	14,108	1,515,504	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	15,070	15,385	1,652,701	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	3,330	3,376	362,680	2024/02/29
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	5,520	5,720	614,494	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	6,290	6,588	707,712	2025/02/28
US T N/B 1.875 02/28/22	国債証券	1.8750	2,440	2,446	262,841	2022/02/28
US T N/B 2.5 02/15/22	国債証券	2.5000	7,160	7,295	783,632	2022/02/15
US T N/B 2.375 02/29/24	国債証券	2.3750	5,800	5,949	639,048	2024/02/29
US T N/B 1.125 02/28/21	国債証券	1.1250	1,740	1,719	184,733	2021/02/28
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	12,400	12,770	1,371,755	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/21	国債証券	2.5000	15,690	15,864	1,704,178	2021/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	20,250	20,534	2,205,839	2024/03/31
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	5,290	5,288	568,069	2022/03/31
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2.2500	11,920	12,010	1,290,190	2021/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	29,280	28,980	3,113,050	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,400	2,498	268,360	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	9,450	9,646	1,036,213	2026/03/31
US T N/B 1.25 03/31/21	国債証券	1.2500	12,310	12,189	1,309,420	2021/03/31

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	6,720	6,894	740,580	2023/03/31
US T N/B 1.875 03/31/22	国債証券	1.8750	13,300	13,344	1,433,472	2022/03/31
US T N/B 2.375 03/15/22	国債証券	2.3750	15,120	15,374	1,651,525	2022/03/15
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	4,220	4,453	478,421	2025/04/30
US T N/B 2.25 04/30/21	国債証券	2.2500	8,490	8,559	919,510	2021/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	14,260	14,378	1,544,492	2024/04/30
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	9,800	9,743	1,046,620	2023/04/30
US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	1.3750	10,000	9,921	1,065,799	2021/04/30
US T N/B 1.875 04/30/22	国債証券	1.8750	10,390	10,424	1,119,754	2022/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	8,680	8,929	959,212	2026/04/30
US T N/B 2.25 04/15/22	国債証券	2.2500	22,820	23,125	2,484,147	2022/04/15
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	10,670	11,049	1,186,906	2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	11,660	11,894	1,277,755	2024/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	1,210	1,698	182,436	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	4,250	5,613	603,014	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	2,100	2,779	298,614	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	2,310	2,504	269,018	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	5,170	6,710	720,881	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	13,140	13,902	1,493,422	2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	10,700	12,302	1,321,527	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	8,570	9,266	995,451	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	6,660	7,212	774,768	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	8,840	8,690	933,563	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	8,270	9,159	983,862	2048/05/15
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	1,250	1,249	134,232	2022/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,680	3,896	418,589	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	2,250	3,001	322,416	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	34,530	34,481	3,703,982	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	10,790	11,135	1,196,186	2024/05/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.1250	100	102	11,006	2021/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	12,390	12,558	1,349,021	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	13,610	14,538	1,561,752	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	6,270	6,443	692,200	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	19,970	20,548	2,207,344	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	890	1,246	133,912	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	14,030	13,754	1,477,548	2026/05/15
US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	2.0000	11,560	11,606	1,246,767	2021/05/31
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	1,460	1,451	155,950	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	3,500	3,532	379,432	2024/05/31
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	9,490	9,487	1,019,171	2022/05/31
US T N/B 2.125 05/15/22	国債証券	2.1250	12,700	12,832	1,378,449	2022/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,880	4,020	431,927	2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	4,550	4,804	516,136	2025/05/31
US T N/B 1.375 05/31/21	国債証券	1.3750	12,350	12,253	1,316,262	2021/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	550	540	58,106	2023/06/30
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	7,540	7,604	816,839	2024/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	3,820	3,860	414,735	2022/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	8,100	8,496	912,719	2025/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	2,650	2,735	293,846	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	5,160	5,160	554,326	2022/06/30
US T N/B 1.125 06/30/21	国債証券	1.1250	10,000	9,874	1,060,686	2021/06/30
US T N/B 2.625 06/15/21	国債証券	2.6250	16,260	16,529	1,775,643	2021/06/15
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	3,520	3,570	383,551	2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	8,222	883,216	2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	21,300	22,514	2,418,533	2025/07/31

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.125 07/31/21	国債証券	1.1250	13,900	13,715	1,473,294	2021/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22	国債証券	1.8750	10,290	10,323	1,108,977	2022/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	10,070	10,448	1,122,359	2023/07/31
US T N/B 2.625 07/15/21	国債証券	2.6250	16,670	16,955	1,821,312	2021/07/15
US T N/B 2.625 07/31/20	国債証券	2.6250	24,300	24,481	2,629,778	2020/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,200	1,412	151,743	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	4,490	5,463	586,838	2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	930	1,197	128,652	2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	5,580	6,910	742,319	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	3,830	3,977	427,229	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	8,090	8,928	959,050	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	2,000	2,680	287,969	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	8,930	10,669	1,146,162	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	7,640	8,073	867,295	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	11,600	11,670	1,253,660	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	7,440	7,672	824,179	2047/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.1250	9,590	9,660	1,037,760	2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	6,700	6,888	740,009	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	12,610	12,945	1,390,651	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	12,910	12,043	1,293,724	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	10,310	11,158	1,198,603	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	12,780	13,024	1,399,048	2027/08/15
US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	2.6250	13,350	13,457	1,445,644	2020/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	12,080	11,726	1,259,612	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	14,020	14,984	1,609,613	2028/08/15
US T N/B 2.0 08/31/21	国債証券	2.0000	7,060	7,094	762,055	2021/08/31
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	8,140	8,542	917,637	2025/08/31
US T N/B 2.125 08/31/20	国債証券	2.1250	11,660	11,690	1,255,786	2020/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	9,500	9,341	1,003,498	2023/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	7,320	7,336	788,091	2024/08/31
US T N/B 1.125 08/31/21	国債証券	1.1250	11,000	10,849	1,165,455	2021/08/31
US T N/B 1.375 08/31/20	国債証券	1.3750	25,320	25,162	2,702,956	2020/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	7,030	7,299	784,070	2023/08/31
US T N/B 1.5 08/15/20	国債証券	1.5000	22,880	22,773	2,446,340	2020/08/15
US T N/B 2.625 08/31/20	国債証券	2.6250	12,790	12,897	1,385,483	2020/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22	国債証券	1.6250	3,280	3,265	350,737	2022/08/31
US T N/B 2.75 08/15/21	国債証券	2.7500	25,090	25,606	2,750,634	2021/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	7,430	7,915	850,256	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	9,800	9,876	1,060,937	2021/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,720	2,758	296,357	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	9,000	8,843	950,006	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,360	5,356	575,362	2022/09/30
US T N/B 2.0 09/30/20	国債証券	2.0000	12,660	12,677	1,361,841	2020/09/30
US T N/B 1.375 09/30/20	国債証券	1.3750	10,640	10,570	1,135,439	2020/09/30
US T N/B 1.125 09/30/21	国債証券	1.1250	430	423	45,544	2021/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22	国債証券	1.8750	8,860	8,891	955,081	2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	7,810	8,152	875,712	2023/09/30
US T N/B 2.75 09/15/21	国債証券	2.7500	2,960	3,024	324,853	2021/09/15
US T N/B 2.75 09/30/20	国債証券	2.7500	18,860	19,059	2,047,375	2020/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	4,560	4,651	499,631	2024/10/31
US T N/B 1.875 10/31/22	国債証券	1.8750	12,380	12,420	1,334,221	2022/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	6,560	6,987	750,641	2025/10/31
US T N/B 1.25 10/31/21	国債証券	1.2500	10,500	10,373	1,114,329	2021/10/31
US T N/B 2.875 10/15/21	国債証券	2.8750	13,100	13,425	1,442,213	2021/10/15
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	1,780	1,766	189,773	2023/10/31

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.375 10/31/20	国債証券	1.3750	10,000	9,935	1,067,228	2020/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	4,280	4,311	463,132	2022/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	9,290	9,705	1,042,519	2023/10/31
US T N/B 2.875 10/31/20	国債証券	2.8750	16,820	17,045	1,830,997	2020/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	2,100	2,403	258,158	2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,700	2,163	232,376	2028/11/15
US T N/B 6.5 11/15/26	国債証券	6.5000	500	656	70,472	2026/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,050	2,700	290,075	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	9,340	10,091	1,084,028	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	3,650	4,749	510,166	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	10,550	10,942	1,175,416	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	2,350	2,604	279,828	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	7,740	9,431	1,013,173	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	6,690	6,899	741,147	2047/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	8,800	9,528	1,023,500	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	13,320	14,078	1,512,320	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	12,600	12,856	1,381,089	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	2,340	3,087	331,660	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	14,200	16,500	1,772,518	2048/11/15
US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	2.6250	11,860	11,983	1,287,238	2020/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	7,900	7,944	853,353	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	25,880	26,405	2,836,492	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	21,320	23,259	2,498,533	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	1,120	1,114	119,731	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	13,330	13,862	1,489,070	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	8,900	8,930	959,317	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	12,020	12,109	1,300,769	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	12,870	13,107	1,407,974	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	10,290	10,430	1,120,461	2023/11/30
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	3,970	4,026	432,487	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	6,780	7,174	770,695	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	9,810	10,259	1,102,032	2023/11/30
US T N/B 1.625 11/30/20	国債証券	1.6250	10,000	9,966	1,070,590	2020/11/30
US T N/B 1.75 11/30/21	国債証券	1.7500	1,380	1,379	148,169	2021/11/30
US T N/B 2.875 11/15/21	国債証券	2.8750	8,440	8,657	929,961	2021/11/15
US T N/B 2.75 11/30/20	国債証券	2.7500	5,110	5,174	555,838	2020/11/30
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	9,550	9,737	1,046,049	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	9,670	10,011	1,075,429	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	7,300	7,616	818,159	2025/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	7,000	7,061	758,572	2021/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	4,530	4,622	496,534	2024/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	13,500	13,659	1,467,267	2022/12/31
US T N/B 1.75 12/31/20	国債証券	1.7500	12,590	12,571	1,350,402	2020/12/31
US T N/B 2.0 12/31/21	国債証券	2.0000	14,720	14,807	1,590,599	2021/12/31
US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	2.6250	11,320	11,559	1,241,688	2021/12/15
US T N/B 2.5 12/31/20	国債証券	2.5000	14,350	14,488	1,556,336	2020/12/31
小計	－	－	1,897,040	1,959,720	210,513,189	－
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 02/01/21	国債証券	2.2500	1,680	1,700	138,421	2021/02/01
CANADA 0.75 03/01/21	国債証券	0.7500	5,890	5,820	473,691	2021/03/01
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	2,410	2,507	204,121	2024/03/01
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	3,550	3,466	282,135	2022/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	3,740	3,789	308,404	2023/03/01
CANADA 1.75 05/01/21	国債証券	1.7500	3,180	3,198	260,334	2021/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	3,020	3,035	247,071	2026/06/01

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	900	1,338	108,916	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	3,000	4,167	339,181	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	2,530	3,844	312,935	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	2,900	4,389	357,249	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	3,600	3,794	308,837	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	3,260	4,610	375,255	2041/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	2,400	2,483	202,114	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	3,350	3,479	283,235	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	3,690	3,706	301,707	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	2,690	2,809	228,633	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	3,110	3,261	265,460	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	3,890	3,760	306,041	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	2,590	2,772	225,650	2029/06/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	5,860	5,776	470,182	2021/09/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	1,230	1,238	100,769	2024/09/01
CANADA 0.75 09/01/20	国債証券	0.7500	9,530	9,434	767,905	2020/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	2,820	2,891	235,319	2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	3,030	2,992	243,588	2022/09/01
CANADA 2.0 11/01/20	国債証券	2.0000	2,740	2,756	224,360	2020/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	3,920	5,405	439,968	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	3,670	4,540	369,523	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	1,470	1,575	128,222	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	1,010	1,351	110,001	2064/12/01
小計	－	－	96,660	105,900	8,619,241	－
(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	2,990	3,702	276,669	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	5,940	6,683	499,396	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	6,170	7,811	583,645	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	6,850	7,431	555,276	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	9,490	11,438	854,690	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	5,470	6,413	479,218	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	5,740	6,781	506,689	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	2,870	3,979	297,332	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	2,520	3,357	250,885	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	5,770	6,235	465,883	2028/05/21
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.7500	6,540	7,131	532,873	2021/05/15
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	3,530	3,956	295,647	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	1,050	1,228	91,773	2041/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	1,980	2,500	186,855	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	1,770	2,078	155,303	2035/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	7,000	8,022	599,456	2022/07/15
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	5,400	6,103	456,058	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	5,540	6,206	463,713	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	8,170	9,321	696,500	2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国債証券	1.7500	2,950	2,982	222,861	2020/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	3,080	3,219	240,562	2022/11/21
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券	2.0000	3,020	3,102	231,787	2021/12/21
小計	－	－	103,840	119,687	8,943,082	－
(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 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	580	585	46,504	2024/02/01
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	1,700	1,702	135,100	2023/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	1,650	1,838	145,871	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	1,580	1,646	130,655	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	1,010	1,062	84,281	2042/04/01
SINGAPORE 1.75 04/01/22	国債証券	1.7500	30	30	2,387	2022/04/01

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	
(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 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	1,020	1,073	85,196	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	920	949	75,347	2025/06/01
SINGAPORE 2.25 06/01/21	国債証券	2.2500	2,440	2,468	195,929	2021/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	810	824	65,406	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	620	667	52,982	2029/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	1,280	1,330	105,552	2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	830	819	65,023	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,110	1,175	93,304	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	1,200	1,253	99,498	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	900	968	76,852	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	1,210	1,378	109,364	2033/09/01
小計	－	－	18,890	19,773	1,569,259	－
(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	5,380	7,384	1,011,245	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	5,480	7,874	1,078,369	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	3,560	6,480	887,505	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	720	771	105,626	2049/01/22
UK TREASURY 1.5 01/22/21	国債証券	1.5000	4,900	4,968	680,420	2021/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	4,180	5,197	711,704	2025/03/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4.0000	2,350	2,566	351,476	2022/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	3,920	5,696	780,031	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	5,680	5,779	791,431	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	4,750	6,578	900,828	2032/06/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	8.0000	1,520	1,739	238,197	2021/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	4,620	4,670	639,558	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	3,670	5,941	813,660	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	4,190	4,656	637,697	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	3,840	5,351	732,766	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	4,500	7,947	1,088,262	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	3,950	4,169	570,987	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	4,480	4,650	636,828	2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	5,710	5,697	780,269	2022/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	5,830	5,864	803,094	2023/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	3,560	5,384	737,402	2039/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/21	国債証券	3.7500	2,410	2,577	352,978	2021/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	3,820	4,082	558,996	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,500	2,771	379,508	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	1,650	1,785	244,546	2025/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国債証券	3.7500	4,790	4,966	680,068	2020/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	3,820	5,583	764,631	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	4,970	5,307	726,803	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	5,920	6,140	840,947	2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	1,420	1,508	206,522	2054/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	2,010	2,233	305,807	2071/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	5,650	6,042	827,507	2028/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,450	2,133	292,171	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	3,470	5,517	755,539	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	4,040	6,532	894,529	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	3,750	6,123	838,483	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	3,690	6,709	918,853	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	3,290	4,235	580,051	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	4,770	7,309	1,000,969	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	2,980	4,209	576,496	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	4,440	7,518	1,029,610	2049/12/07
小計	－	－	157,630	202,660	27,752,388	－

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	
(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	26,240	49,906	816,976	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	12,910	14,841	242,959	2025/11/15
DENMARK 3.0 11/15/21	国債証券	3.0000	18,170	19,796	324,064	2021/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	8,570	9,399	153,871	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	17,060	18,379	300,865	2027/11/15
小計	－	－	82,950	112,323	1,838,735	－
(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	8,260	8,369	105,870	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	7,030	7,237	91,552	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	9,430	10,196	128,981	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	5,990	6,164	77,979	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	7,420	7,779	98,405	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	15,430	15,894	201,060	2023/05/24
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	4,710	4,842	61,260	2029/09/06
小計	－	－	58,270	60,483	765,110	－
(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	9,750	15,234	175,196	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	9,300	10,015	115,174	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	13,830	16,222	186,562	2025/05/12
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	21,630	24,290	279,345	2022/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	18,180	19,837	228,128	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	12,360	13,492	155,165	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	8,570	9,229	106,136	2029/11/12
小計	－	－	93,620	108,322	1,245,710	－
(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	38,064	34,490	194,183	2026/03/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	37,071	39,323	221,388	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	34,054	34,300	193,114	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	61,151	60,822	342,431	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	54,715	53,221	299,635	2022/06/09
MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	6.5000	56,340	55,189	310,717	2021/06/10
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	6,000	6,112	34,414	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	44,721	44,268	249,233	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	20,296	20,585	115,897	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	37,143	39,737	223,723	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	17,086	20,749	116,817	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	19,500	19,560	110,127	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	66,505	73,941	416,291	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	49,237	50,126	282,210	2023/12/07
MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	国債証券	7.2500	41,968	41,633	234,396	2021/12/09
小計	－	－	583,851	594,064	3,344,583	－
(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 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	3,910	3,922	101,665	2023/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,480	1,552	40,241	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	2,820	2,997	77,689	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,180	1,206	31,266	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,340	1,320	34,237	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	5,540	6,013	155,878	2037/04/07
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	4,580	4,536	117,589	2027/05/31
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	2,000	2,080	53,932	2031/06/30
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,190	2,262	58,635	2024/07/15
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	5,000	5,002	129,663	2022/08/15
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,480	1,656	42,940	2028/09/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	4,400	4,503	116,729	2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	3,470	3,775	97,857	2043/09/30

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(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 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,500	1,528	39,608	2026/11/30
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	1,050	1,124	29,141	2033/11/07
小計	－	－	41,940	43,482	1,127,076	－
(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	32,290	30,389	227,920	2030/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	33,480	29,951	224,634	2044/01/31
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9.0000	10,100	9,358	70,186	2040/01/31
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	36,310	32,804	246,037	2037/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	58,790	52,562	394,217	2048/02/28
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	13,680	9,589	71,919	2041/02/28
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7.7500	2,740	2,780	20,855	2023/02/28
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	17,190	14,635	109,766	2031/02/28
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8.8750	13,250	12,515	93,866	2035/02/28
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	13,000	12,066	90,497	2032/03/31
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	17,630	12,838	96,287	2036/03/31
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	43,910	49,712	372,842	2026/12/21
小計	－	－	292,370	269,204	2,019,032	－
(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	6,870	7,039	202,320	2023/01/25
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,800	2,337	67,179	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	8,680	8,925	256,510	2028/04/25
POLAND 2.0 04/25/21	国債証券	2.0000	9,120	9,205	264,572	2021/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	4,880	4,961	142,594	2022/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	6,690	6,854	197,008	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	7,390	7,512	215,895	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	4,790	5,096	146,482	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	8,370	8,484	243,837	2027/07/25
POLAND 1.75 07/25/21	国債証券	1.7500	4,510	4,530	130,213	2021/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	4,570	5,143	147,827	2022/09/23
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.2500	10,020	10,528	302,575	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	2,690	2,947	84,719	2021/10/25
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	10,380	11,280	324,209	2023/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	1,230	1,271	36,547	2029/10/25
小計	－	－	91,990	96,120	2,762,493	－
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	1,710	2,097	256,417	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	400	441	54,013	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	1,870	2,204	269,529	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	3,740	4,944	604,356	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	4,040	4,701	574,747	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	2,320	2,402	293,724	2022/03/15
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	640	692	84,665	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	810	884	108,076	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	2,250	2,743	335,405	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	1,540	1,647	201,389	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	770	834	101,952	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	2,800	3,013	368,383	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	1,020	1,169	143,013	2037/05/15
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5.0000	3,460	3,714	454,113	2020/10/18
IRISH 10/18/22	国債証券	－	2,800	2,842	347,406	2022/10/18
小計	－	－	30,170	34,335	4,197,194	－
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.5000	590	764	93,404	2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	3,760	6,656	813,678	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	2,940	4,815	588,680	2047/01/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	1,670	1,938	236,966	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	2,070	3,110	380,187	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	3,260	5,435	664,462	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	3,370	4,494	549,362	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,050	1,095	133,895	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	－	4,490	4,569	558,627	2022/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	－	3,980	4,082	499,077	2024/01/15
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	国債証券	3.5000	3,940	4,113	502,855	2020/07/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	国債証券	3.2500	5,240	5,671	693,247	2021/07/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	5,200	5,705	697,388	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	3,140	3,340	408,283	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	7,500	8,185	1,000,540	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	3,590	4,056	495,917	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	4,130	4,308	526,706	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	2,340	2,545	311,121	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	3,670	3,978	486,372	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	2,260	2,343	286,478	2029/07/15
小計	－	－	68,190	81,211	9,927,255	－
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.0000	2,130	2,406	294,196	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	3,370	5,002	611,492	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	4,350	7,350	898,567	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	2,220	2,934	358,722	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,550	2,269	277,387	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	6,370	10,694	1,307,236	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	700	779	95,327	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	3,060	5,084	621,528	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	2,230	2,565	313,661	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	1,180	1,372	167,754	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	810	1,057	129,284	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	900	1,172	143,317	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	3,770	4,088	499,726	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	4,580	5,277	645,103	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	3,220	3,493	427,065	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	2,950	3,285	401,619	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	3,390	3,629	443,624	2028/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,330	1,432	175,159	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	1,410	1,927	235,677	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	1,220	1,478	180,707	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,430	2,590	316,618	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	2,050	2,195	268,416	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	1,000	1,129	138,111	2037/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.2500	7,470	8,307	1,015,568	2021/09/28
BELGIUM 3.75 09/28/20	国債証券	3.7500	5,060	5,338	652,572	2020/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	4,100	4,759	581,779	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	1,500	1,569	191,834	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	2,020	2,082	254,579	2023/10/22
小計	－	－	76,370	95,276	11,646,643	－
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 02/25/22	国債証券	－	2,810	2,856	349,155	2022/02/25
FRANCE OAT 02/25/21	国債証券	－	7,080	7,157	874,901	2021/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	－	4,560	4,663	570,006	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	－	5,720	5,848	714,868	2023/03/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	国債証券	3.7500	5,510	5,959	728,543	2021/04/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,480	2,003	244,877	2023/04/25

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	7,840	9,922	1,212,902	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	7,740	13,766	1,682,838	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	3,340	6,280	767,732	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	2,440	4,769	583,031	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	10,630	16,395	2,004,185	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	7,350	8,119	992,551	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	5,390	8,991	1,099,073	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	5,600	8,767	1,071,681	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	5,150	6,540	799,554	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,060	2,337	285,721	2050/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	3,280	3,955	483,574	2066/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	8,220	9,335	1,141,165	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	8,110	10,204	1,247,386	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,470	5,865	716,976	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	15,580	17,950	2,194,287	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	7,840	8,246	1,008,100	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	4,530	4,730	578,305	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	4,080	4,574	559,216	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	10,560	11,123	1,359,773	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	5,000	5,462	667,736	2027/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	7,450	8,140	995,063	2023/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	5,350	5,980	731,088	2036/05/25
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	－	5,500	5,604	685,060	2022/05/25
FRANCE OAT 05/25/21	国債証券	－	4,160	4,212	514,895	2021/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	4,200	5,067	619,447	2039/06/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	10,990	13,314	1,627,617	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,220	3,121	381,517	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	10,570	13,153	1,607,873	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	7,710	12,554	1,534,709	2038/10/25
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.2500	6,000	6,554	801,246	2021/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	9,960	17,160	2,097,758	2032/10/25
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	13,640	14,963	1,829,103	2022/10/25
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	国債証券	2.5000	4,310	4,490	548,977	2020/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	9,220	10,321	1,261,701	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	15,190	16,490	2,015,788	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	6,490	6,713	820,676	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	6,690	7,163	875,627	2028/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	国債証券	0.2500	4,300	4,353	532,218	2020/11/25
小計	－	－	291,320	355,190	43,418,518	－
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	1,180	1,556	190,279	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	3,440	5,245	641,149	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	1,400	2,382	291,270	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	7,900	13,206	1,614,421	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	4,010	6,811	832,677	2037/01/04
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.0000	8,030	8,594	1,050,543	2022/01/04
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	国債証券	2.5000	2,200	2,311	282,530	2021/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	3,440	3,656	446,913	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	6,250	6,686	817,357	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	4,420	4,650	568,526	2029/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	3,100	3,354	410,009	2023/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	3,330	3,588	438,606	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	4,200	4,678	571,854	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	7,580	7,996	977,541	2027/02/15
BUNDESSCHAT 03/12/21	国債証券	－	1,640	1,660	203,003	2021/03/12

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	
BUNDESOBL 04/09/21	国債証券	－	2,850	2,887	352,951	2021/04/09
BUNDESOBL 04/08/22	国債証券	－	2,500	2,551	311,941	2022/04/08
BUNDESOBL 04/14/23	国債証券	－	2,960	3,040	371,708	2023/04/14
BUNDESOBL 04/05/24	国債証券	－	5,990	6,174	754,718	2024/04/05
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	7,210	7,979	975,355	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	3,070	3,337	408,034	2023/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,670	2,616	319,884	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,800	2,647	323,607	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	3,740	6,825	834,321	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	5,700	9,674	1,182,561	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	5,950	9,239	1,129,489	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	2,980	5,859	716,267	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	2,490	2,693	329,205	2021/07/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.0000	3,200	3,321	405,981	2020/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	9,530	10,257	1,253,890	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	4,120	7,131	871,700	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	5,250	8,330	1,018,312	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	4,460	5,649	690,619	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	3,410	3,744	457,684	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	4,490	4,833	590,900	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	－	7,360	7,626	932,291	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	3,420	3,604	440,602	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	2,900	3,229	394,713	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	3,100	3,364	411,248	2024/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	2,700	2,879	351,976	2021/09/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.2500	3,000	3,106	379,767	2020/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	3,300	3,539	432,650	2022/09/04
BUNDESSCHAT 09/11/20	国債証券	－	5,060	5,102	623,785	2020/09/11
BUNDESOBL 10/08/21	国債証券	－	3,400	3,458	422,814	2021/10/08
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	国債証券	0.2500	3,000	3,037	371,340	2020/10/16
BUNDESOBL 10/07/22	国債証券	－	3,000	3,072	375,561	2022/10/07
BUNDESOBL 10/13/23	国債証券	－	4,800	4,941	604,061	2023/10/13
小計	－	－	190,530	232,138	28,376,636	－
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	4,160	4,833	590,806	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	3,500	5,357	654,958	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	3,000	3,688	450,911	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	5,190	7,908	966,756	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	6,210	7,481	914,485	2023/01/31
SPAIN 0.05 01/31/21	国債証券	0.0500	2,500	2,517	307,748	2021/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	3,100	3,393	414,822	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	5,600	6,672	815,586	2024/04/30
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.5000	3,710	4,114	502,974	2021/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,700	2,965	362,491	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	3,000	3,375	412,655	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	3,760	4,114	503,001	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	5,320	5,836	713,488	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	3,300	3,368	411,818	2022/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	4,440	6,246	763,605	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	4,360	7,454	911,265	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	3,390	5,724	699,753	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	2,350	3,621	442,748	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	4,820	6,186	756,210	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	4,840	5,568	680,701	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	4,390	7,209	881,307	2032/07/30

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	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	3,210	3,873	473,458	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	3,770	4,119	503,532	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	2,770	3,141	384,048	2035/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	2,680	2,744	335,491	2021/07/30
SPAIN 1.15 07/30/20	国債証券	1.1500	4,500	4,578	559,733	2020/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	3,270	3,345	408,906	2023/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	12,920	14,877	1,818,674	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	4,410	6,366	778,267	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	2,510	4,604	562,899	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	4,820	6,494	793,925	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,730	2,253	275,516	2048/10/31
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.8500	2,630	2,818	344,477	2020/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	4,650	5,269	644,151	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	12,730	13,964	1,706,996	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	12,120	13,122	1,604,072	2026/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	4,080	4,897	598,676	2023/10/31
SPAIN 0.05 10/31/21	国債証券	0.0500	6,080	6,138	750,339	2021/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	2,600	2,664	325,702	2022/10/31
小計	－	－	175,120	212,916	26,026,971	－
(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	3,440	4,732	578,489	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	11,650	13,767	1,682,996	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	7,300	7,383	902,551	2028/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	2,650	2,553	312,177	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	8,640	9,403	1,149,517	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	3,500	4,003	489,337	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	1,100	1,015	124,123	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	3,860	4,588	560,897	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	2,500	2,783	340,193	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	10,660	12,558	1,535,156	2026/03/01
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.7500	2,950	3,125	382,060	2021/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	3,300	3,076	376,090	2032/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	3,370	3,687	450,704	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	3,980	4,457	544,911	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	2,700	2,690	328,925	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	2,000	1,994	243,761	2023/03/01
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	3,000	3,047	372,532	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	2,700	2,733	334,107	2022/04/01
ITALY BTPS 0.05 04/15/21	国債証券	0.0500	950	946	115,698	2021/04/15
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	4,300	5,930	724,951	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	2,600	2,932	358,422	2023/05/01
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国債証券	3.7500	3,000	3,189	389,907	2021/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	2,800	2,871	350,965	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	5,980	5,964	729,131	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	3,300	3,295	402,786	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	7,430	7,420	907,080	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,500	2,573	314,523	2027/06/01
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国債証券	0.4500	3,750	3,757	459,321	2021/06/01
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	6,930	7,407	905,489	2021/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	5,450	7,100	867,935	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	4,160	5,500	672,363	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	4,010	4,585	560,572	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	5,700	5,796	708,529	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	3,850	4,146	506,843	2029/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	3,000	3,003	367,182	2022/08/01

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	2,130	2,187	267,414	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	6,970	9,048	1,106,091	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	2,900	3,075	375,996	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	8,450	10,468	1,279,684	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	4,630	6,090	744,535	2040/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	3,810	4,159	508,488	2021/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	2,650	2,657	324,898	2033/09/01
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債証券	4.0000	4,220	4,421	540,428	2020/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	6,380	7,116	869,921	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	3,970	4,540	555,000	2049/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	2,960	3,385	413,796	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	2,400	2,305	281,816	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	4,140	4,213	515,041	2022/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	1,870	1,834	224,188	2023/10/15
ITALY BTPS 2.3 10/15/21	国債証券	2.3000	3,300	3,432	419,584	2021/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	3,030	3,185	389,425	2023/10/01
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	国債証券	0.2000	2,500	2,505	306,318	2020/10/15
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,700	2,259	276,197	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	2,150	2,960	361,923	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	3,400	4,602	562,619	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	6,380	8,181	1,000,054	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	3,200	3,676	449,358	2022/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	2,800	2,802	342,600	2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	3,430	3,611	441,484	2025/11/15
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	国債証券	0.6500	2,000	2,015	246,391	2020/11/01
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国債証券	0.3500	10,200	10,167	1,242,845	2021/11/01
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	2,900	2,971	363,269	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	3,500	3,402	415,946	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	2,650	2,794	341,609	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	3,190	3,404	416,107	2028/12/01
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2.1500	2,000	2,074	253,599	2021/12/15
小計	－	－	264,820	293,577	35,886,879	－
(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	1,610	1,806	220,769	2024/04/15
FINLAND 3.5 04/15/21	国債証券	3.5000	2,460	2,645	323,408	2021/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	750	805	98,520	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	470	568	69,474	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	910	959	117,310	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	750	843	103,086	2034/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	3,510	3,789	463,172	2023/04/15
FINLAND 04/15/22	国債証券	－	2,230	2,269	277,398	2022/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	1,330	1,688	206,392	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	700	881	107,807	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	780	1,153	141,031	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	640	671	82,115	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	780	840	102,725	2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	650	684	83,705	2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	600	632	77,319	2027/09/15
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	3,580	3,839	469,390	2022/09/15
FINLAND 09/15/23	国債証券	－	2,090	2,137	261,293	2023/09/15
FINLAND 0.375 09/15/20	国債証券	0.3750	5,640	5,710	698,072	2020/09/15
小計	－	－	29,480	31,928	3,902,995	－
(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	1,150	2,365	289,145	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	1,250	1,499	183,239	2047/02/20

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 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	2,960	3,103	379,375	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	2,030	2,181	266,721	2028/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	1,620	2,191	267,921	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	2,840	4,639	567,157	2037/03/15
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.6500	3,420	3,836	468,980	2022/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	2,300	2,426	296,606	2027/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	1,360	1,768	216,188	2034/05/23
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	1,760	2,797	341,938	2044/06/20
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.9000	2,450	2,565	313,563	2020/07/15
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	1,160	1,768	216,187	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	－	1,430	1,461	178,631	2023/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	3,850	4,208	514,392	2021/09/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	910	1,412	172,623	2117/09/20
AUSTRIA 09/20/22	国債証券	－	3,400	3,467	423,886	2022/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	4,150	4,616	564,366	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	2,040	2,189	267,698	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	1,940	2,133	260,834	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	2,750	3,026	370,011	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	410	495	60,603	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	3,350	3,811	465,872	2022/11/22
小計	－	－	48,530	57,967	7,085,945	－
合計	－	－	－	－	440,968,947	－

■投資信託財産の構成

2019年６月24日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	440,968,947	96.5
コール・ローン等、その他	15,870,707	3.5
投資信託財産総額	456,839,654	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、451,345,121千円、98.8％です。
（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年６月24日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝107.42円、１カナダ・ドル＝81.39円、１オーストラリア・ドル＝74.72円、１シンガポール・ドル＝79.36円、１イギリス・ポンド＝136.94円、１デンマーク・クローネ＝16.37円、１ノルウェー・クローネ＝12.65円、１スウェーデン・クローナ＝11.50円、１メキシコ・ペソ＝5.63円、１マレーシア・リンギット＝25.92円、１南アフリカ・ランド＝7.50円、１ポーランド・ズロチ＝28.74円、１ユーロ＝122.24円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年６月24日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**901,512,323,487円**
コール・ローン等	10,602,452,655
公社債(評価額)	440,968,947,653
未収入金	446,677,308,686
未収利息	2,291,367,499
前払費用	972,246,994
(B) 負債	**446,653,996,538**
未払金	446,512,220,538
未払解約金	141,776,000
(C) 純資産総額(A－B)	**454,858,326,949**
元本	327,518,238,620
次期繰越損益金	127,340,088,329
(D) 受益権総口数	**327,518,238,620口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**13,888円**

(注１) 期首元本額 219,492,082,847円
追加設定元本額 318,381,509,298円
一部解約元本額 210,355,353,525円

(注２) 期末における元本の内訳
たわらノーロード　先進国債券<為替ヘッジあり> 3,224,600,502円
たわらノーロード　バランス（堅実型） 65,645,542円
たわらノーロード　バランス（標準型） 185,013,476円
たわらノーロード　バランス（積極型） 97,413,863円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型） 5,188,706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） 154,058,984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） 224,161,212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） 77,130,935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） 53,023,594円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型） 2,888,993円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型） 3,911,149円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型） 5,903,650円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型） 1,921,029円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型） 1,630,421円
投資のソムリエ 43,865,840,177円
投資のソムリエ<ＤＣ年金> 4,581,689,980円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>リスク抑制型 3,438,212,320円
リスク抑制世界８資産バランスファンド 48,208,802,056円
ワールドアセットバランス（基本コース） 4,185,978,240円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） 16,092,225,458円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045） 15,393,523円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055） 13,286,347円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） 25,234,208円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035） 31,891,818円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 8,076,059,496円
９資産分散投資・スタンダード<ＤＣ年金> 402,018,567円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040） 2,786,156円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050） 2,786,156円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060） 2,786,156円
外国債券パッシブファンド２（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定） 20,018,593,420円
先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定） 104,519,210,396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） 6,414,554,911円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定） 117,947,641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） 3,904,515,819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） 23,815,754,097円
ＤＩＡＭバランス30ＶＡ（適格機関投資家限定） 26,541,840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） 27,336,766,237円
ＤＩＡＭバランス20ＶＡ（適格機関投資家限定） 141,340,484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） 2,314,215,501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） 2,463,946,681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） 3,267,487,092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） 129,881,787円
期末元本合計 327,518,238,620円

■損益の状況

当期　自2018年６月23日　至2019年６月24日

項目	当期
(A) 配当等収益	**7,319,339,939円**
受取利息	7,324,148,475
支払利息	△4,808,536
(B) 有価証券売買損益	**10,366,235,165**
売買益	58,948,076,732
売買損	△48,581,841,567
(C) その他費用	**△34,367,885**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**17,651,207,219**
(E) 前期繰越損益金	**71,240,884,883**
(F) 解約差損益金	**△69,764,609,475**
(G) 追加信託差損益金	**108,212,605,702**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**127,340,088,329**
次期繰越損益金(H)	**127,340,088,329**

(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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日　2019年６月24日）

（対象期間　2018年６月23日～2019年６月24日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額		Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（ベンチマーク）		投資信託受益証券、投資証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%	ポイント	%	%	百万円
８期(2015年６月22日)	11,550	27.0	113,473.63	27.7	99.5	26,943
９期(2016年６月22日)	10,906	△5.6	108,051.29	△4.8	99.6	32,918
10期(2017年６月22日)	11,770	7.9	117,262.55	8.5	99.7	43,023
11期(2018年６月22日)	11,979	1.8	120,101.82	2.4	99.3	53,148
12期(2019年６月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2	47,410

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

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

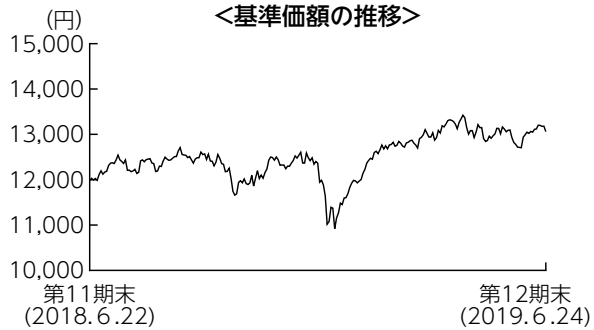
（注３）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

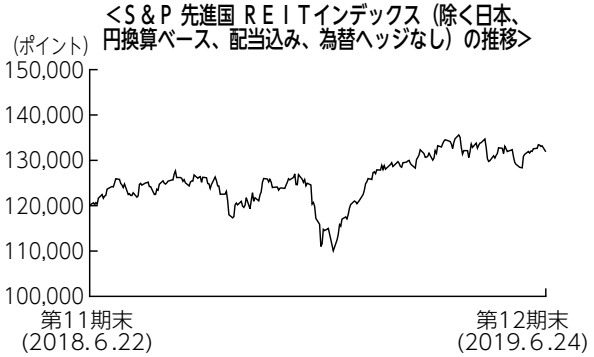
■当期中の基準価額と市況の推移

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

（注）騰落率は期首比です。

■**当期の運用経過**（2018年６月23日から2019年６月24日まで）





基準価額の推移

当期末の基準価額は13,060円となり、前期末に比べ9.0％上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

為替市場では、2018年の年末にかけて、米中通商問題や世界経済の減速懸念などから安全資産とされる円が買われ、円高が進む展開となりました。2019年１月に米中通商問題の進展期待などから米ドルが買われ、米ドル高円安方向へと反転したものの、４月後半以降は米国の金利低下観測などから米ドル安円高となりました。ユーロは欧州経済の減速や、イタリアの財政悪化に対する懸念などから弱含む展開となり、ユーロ安円高となりました。豪ドルに対しても円高が進みました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

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

■１万口当たりの費用明細

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

（注）金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「１万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（12,500円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については６ページ（１万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2018年６月23日から2019年６月24日まで）

(1) 株　式

		買付		売付	
		株　数	金　額	株　数	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	－ (939.19)	－ (1,331)	939.19	1,846

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

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

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

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

	買付		売付	
	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
PARAMOUNT GROUP INC	75.42 (−)	1,067 (−)	91.771 (−)	1,299 (−)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8.43 (−)	81 (−)	9.372 (−)	90 (−)
URBAN EDGE PROPERTIES	52.551 (−)	1,037 (−)	53.423 (−)	1,045 (−)
INFRAREIT INC	12.483 (−)	261 (−)	28.615 (−)	602 (−)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	29.853 (−)	549 (−)	23.175 (−)	419 (−)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	40.549 (−)	823 (−)	46.325 (−)	985 (−)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5.796 (−)	212 (−)	5.556 (−)	200 (−)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	24.672 (−)	683 (−)	26.347 (−)	716 (−)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	4.323 (−)	145 (−)	4.537 (−)	141 (−)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	84.215 (−)	1,351 (−)	99.901 (−)	1,617 (−)
GLOBAL NET LEASE INC	35.862 (−)	713 (−)	35.307 (−)	692 (−)
TIER REIT INC	21.709 (△20.073)	511 (−)	21.964 (−)	525 (−)
QUALITY CARE PROPERTIES INC	− (−)	− (−)	39.836 (−)	826 (−)
MANULIFE US REIT	544.2 (−)	449 (△12)	599.2 (−)	482 (−)
PARK HOTELS & RESORTS INC	83.394 (−)	2,489 (−)	97.853 (−)	2,948 (−)
VICI PROPERTIES INC	207.696 (−)	4,456 (−)	80.417 (−)	1,709 (−)
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	15.23 (−)	249 (−)	17.937 (−)	273 (−)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	9.588 (−)	378 (−)	10.272 (−)	423 (−)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26.462 (−)	714 (−)	27.36 (−)	727 (−)
COLONY CAPITAL INC	183.257 (−)	1,039 (−)	220.405 (−)	1,213 (−)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	28.769 (−)	917 (−)	32.456 (−)	1,016 (−)
CANADIAN APT PPTYS REIT	31.269 (−)	1,458 (−)	34.809 (−)	1,608 (−)
MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	1.872 (−)	23 (−)	11.888 (−)	145 (−)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	63.055 (−)	1,340 (△0.00021)	74.795 (−)	1,561 (−)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	74.559 (−)	1,857 (−)	87.619 (−)	2,168 (−)
ALLIED PROPERTIES REIT	21.435 (−)	964 (−)	22.484 (−)	999 (−)
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	43.668 (−)	520 (−)	51.892 (−)	605 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	14.715 (−)	343 (−)	17.361 (−)	405 (−)
NORTHVIEW APARTMENT REIT	13.732 (−)	357 (−)	13.305 (−)	347 (−)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.999 (−)	433 (−)	12.044 (−)	521 (−)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	33.972 (−)	363 (−)	39.625 (−)	427 (−)
CROMBIE REAL ESTATE INV	21.802 (−)	295 (−)	22.991 (−)	304 (−)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21.662 (−)	275 (−)	21.914 (−)	268 (−)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28.331 (−)	316 (−)	27.451 (−)	301 (−)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5.315 (−)	92 (−)	6.065 (−)	101 (−)
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	44.11 (−)	597 (−)	48.142 (−)	656 (−)
DREAM INDUSTRIAL REIT	16.637 (−)	184 (−)	8.155 (−)	86 (−)
AGELLAN COMMERCIAL REIT	1.817 (−)	24 (−)	8.847 (−)	121 (−)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	34.28 (−)	393 (−)	32.393 (−)	371 (−)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8.269 (−)	475 (−)	9.657 (−)	541 (−)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	17.602 (−)	116 (−)	7.137 (−)	45 (−)
CHOICE PROPERTIES REIT	60.2 (−)	758 (−)	65.242 (−)	811 (−)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.287 (−)	139 (−)	2.25 (−)	43 (−)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20.46 (−)	258 (−)	16.695 (−)	212 (−)
SLATE RETAIL REIT	− (−)	− (−)	1.333 (−)	16 (−)
KILLAM APARTMENT REIT	14.397 (−)	244 (−)	12.805 (−)	214 (−)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	242.529 (−)	854 (−)	281.491 (−)	965 (−)
MIRVAC GROUP	1,707.557 (−)	4,235 (−)	1,871.957 (−)	4,516 (−)
INVESTA OFFICE FUND	100.574 (−)	553 (−)	312.012 (−)	1,726 (−)
CROMWELL PROPERTY GROUP	792.327 (−)	843 (−)	858.175 (−)	919 (−)
CHARTER HALL RETAIL REIT	194.63 (−)	859 (−)	210.659 (−)	911 (−)
GPT GROUP	815.73 (−)	4,457 (−)	944.51 (−)	5,031 (−)
ABACUS PROPERTY GROUP	121.863 (−)	423 (−)	138.637 (−)	471 (−)
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	70.981 (−)	233 (−)	63.558 (−)	200 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
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
STOCKLAND	1,134.738 (−)	4,452 (−)	1,295.009 (−)	4,980 (−)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	105.055 (−)	316 (−)	110.745 (−)	332 (−)
DEXUS	474.812 (−)	5,255 (−)	520.639 (−)	5,654 (−)
GOODMAN GROUP	736.22 (−)	8,330 (−)	844.47 (−)	9,396 (−)
VICINITY CENTRES	1,388.558 (−)	3,692 (−)	1,620.371 (−)	4,201 (−)
CHARTER HALL GROUP	204.429 (−)	1,599 (−)	238.778 (−)	1,840 (−)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	120.316 (−)	457 (−)	124.733 (−)	473 (−)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	357.474 (−)	919 (−)	350.961 (−)	875 (−)
ARENA REIT	82.031 (−)	206 (−)	83.801 (−)	205 (−)
PROPERTYLINK GROUP	85.162 (−)	95 (−)	236.384 (−)	273 (−)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	72.038 (−)	317 (−)	66.989 (−)	289 (−)
APN INDUSTRIA REIT	10.177 (−)	28 (−)	13.842 (−)	35 (−)
NATIONAL STORAGE REIT	232.204 (−)	400 (−)	212.63 (−)	359 (−)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	24.928 (−)	83 (−)	35.314 (−)	110 (−)
GDI PROPERTY GROUP	116.482 (−)	150 (−)	164.948 (−)	215 (−)
RURAL FUNDS GROUP	132.102 (−)	291 (−)	131.091 (−)	286 (−)
SCENTRE GROUP	2,387.236 (−)	9,609 (−)	2,758.491 (−)	10,773 (−)
VIVA ENERGY REIT	137.23 (−)	321 (−)	164.432 (−)	372 (−)
香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
LINK REIT	954.5 (−)	77,547 (−)	1,116.5 (−)	88,799 (−)
PROSPERITY REIT	475 (−)	1,505 (−)	535 (−)	1,673 (−)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	647 (−)	3,348 (−)	658 (−)	3,335 (−)
CHAMPION REIT	683 (−)	3,963 (−)	863 (−)	4,929 (−)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	493 (−)	2,629 (−)	512 (−)	2,656 (−)
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	467 (−)	4,332 (−)	578 (−)	5,320 (−)
SPRING REIT	− (−)	− (−)	351 (−)	1,129 (−)
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
CAPITALAND MALL TRUST	1,392.6 (−)	3,168 (−)	1,527.5 (−)	3,427 (−)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,307.3 (−)	3,540 (△16)	1,409.9 (−)	3,776 (−)

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

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ニュージーランド	千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	476.379 (−)	706 (−)	519.884 (−)	758 (−)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	131.176 (−)	281 (−)	133.251 (−)	280 (−)
GOODMAN PROPERTY TRUST	479.081 (−)	754 (−)	558.658 (−)	868 (−)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	610.536 (−)	865 (−)	704.745 (−)	990 (−)
ARGOSY PROPERTY LTD	279.934 (−)	331 (−)	353.982 (−)	415 (−)
INVESTORE PROPERTY LTD	− (−)	− (−)	88.877 (−)	135 (−)
STRIDE STAPLED GROUP	132.924 (−)	262 (−)	141.986 (−)	273 (−)
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	454.367 (−)	2,653 (−)	536.609 (−)	3,171 (−)
CAPITAL & REGIONAL PLC	97.167 (−)	33 (−)	191.461 (−)	64 (−)
DERWENT LONDON PLC	50.122 (−)	1,541 (−)	58.014 (−)	1,752 (−)
BIG YELLOW GROUP PLC	60.671 (−)	569 (−)	69.34 (−)	653 (−)
HAMMERSON PLC	358.576 (−)	1,389 (−)	422.594 (−)	1,668 (−)
LAND SECURITIES GROUP PLC	346.004 (−)	2,983 (−)	397.676 (−)	3,475 (−)
WORKSPACE GROUP PLC	61.546 (−)	581 (−)	65.953 (−)	622 (−)
INTU PROPERTIES PLC	337.034 (−)	468 (−)	413.403 (−)	632 (−)
UNITE GROUP PLC	118.308 (−)	1,039 (−)	138.011 (−)	1,204 (−)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	346.823 (−)	419 (−)	264.264 (−)	299 (−)
SHAFTESBURY PLC	103.837 (−)	915 (−)	126.292 (−)	1,120 (−)
SEGRO PLC	504.351 (−)	3,270 (−)	549.647 (−)	3,507 (−)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	116.446 (−)	832 (4)	140.521 (−)	995 (−)
ASSURA PLC	979.633 (−)	561 (−)	1,138.511 (−)	642 (−)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	210.591 (−)	124 (−)	227.094 (−)	132 (−)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	257.154 (−)	230 (−)	62.879 (−)	58 (−)
HANSTEEN HOLDINGS PLC	146.332 (−)	137 (−)	154.385 (−)	145 (−)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	544.164 (−)	483 (−)	316.63 (−)	272 (−)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	96.354 (−)	544 (−)	113.596 (−)	636 (−)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	302.075 (−)	564 (−)	345.983 (−)	645 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
RDI REIT PLC	268.946 (△435.616)	85 (−)	284.57 (−)	119 (−)
NEWRIVER REIT PLC	103.299 (−)	231 (−)	130.334 (−)	308 (−)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	278.488 (−)	278 (−)	124.548 (−)	116 (−)
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	− (−)	− (−)	37.06 (−)	35 (−)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	249.974 (−)	258 (−)	115.017 (−)	116 (−)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	730.342 (−)	1,046 (−)	758.831 (−)	1,092 (−)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	195.483 (−)	183 (−)	227.97 (−)	213 (−)
LXI REIT PLC	163.221 (−)	199 (−)	102.424 (−)	127 (−)
REGIONAL REIT LTD	42.589 (−)	43 (−)	50.002 (−)	50 (−)
イスラエル	千口	千イスラエル・シュケル	千口	千イスラエル・シュケル
REIT 1 LTD	49.236 (−)	741 (−)	55.868 (−)	848 (−)
韓国	千口	千韓国・ウォン	千口	千韓国・ウォン
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	11.931 (−)	68,035 (−)	2.615 (−)	16,416 (−)
ユーロ（アイルランド）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
GREEN REIT PLC	236.998 (−)	359 (−)	289.749 (−)	436 (−)
HIBERNIA REIT PLC	301.843 (−)	419 (−)	359.133 (−)	497 (−)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	123.754 (−)	185 (−)	138.475 (−)	204 (−)
ユーロ（オランダ）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18.473 (−)	525 (−)	25.483 (−)	749 (−)
VASTNED RETAIL	6.129 (−)	200 (−)	6.597 (−)	217 (−)
WERELDHAVE NV	18.915 (−)	542 (−)	21.418 (−)	611 (−)
NSI NV	5.389 (−)	189 (−)	6.676 (−)	233 (−)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	62.815 (−)	9,724 (−)	71.729 (−)	11,288 (−)
ユーロ（ベルギー）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
BEFIMMO	9.827 (−)	494 (−)	11.687 (−)	582 (−)
COFINIMMO SA	10.427 (−)	1,144 (−)	11.214 (−)	1,220 (−)
RETAIL ESTATES	3.173 (−)	240 (−)	3.796 (−)	287 (−)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8.965 (−)	205 (−)	7.531 (−)	173 (−)
WAREHOUSES DE PAUW	7.777 (−)	944 (−)	8.578 (−)	1,030 (−)
MONTEA SCA	5.495 (−)	379 (−)	1.933 (−)	144 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ユーロ（ベルギー）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
AEDIFICA	9.653 (−)	765 (−)	8.616 (−)	674 (−)
COFINIMMO SA-RTS	− (−)	− (−)	8.342 (−)	5 (−)
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES-RTS	− (6.367)	− (−)	6.367 (−)	1 (−)
MONTEA CVA-RTS	− (2.68)	− (−)	2.68 (−)	1 (−)
AEDIFICA SA-RTS	− (7.159)	− (−)	7.159 (−)	23 (−)
ユーロ（フランス）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
GECINA SA	27.493 (−)	3,620 (−)	28.486 (−)	3,740 (−)
ICADE	18.147 (−)	1,356 (−)	20.929 (−)	1,547 (−)
ALTAREA	1.082 (−)	195 (−)	1.391 (−)	258 (−)
KLEPIERRE	93.413 (−)	2,800 (−)	109.79 (−)	3,292 (−)
COVIVIO	24.261 (−)	2,156 (−)	27.794 (−)	2,471 (−)
MERCIALYS	18.313 (−)	228 (−)	22.454 (−)	280 (−)
COVIVIO	− (2.776)	− (−)	− (−)	− (−)
ユーロ（ドイツ）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	28.848 (−)	261 (−)	34.209 (−)	305 (−)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	69.158 (−)	888 (△24)	74.4 (−)	959 (−)
ユーロ（スペイン）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	132.264 (−)	1,204 (−)	171.48 (−)	1,538 (−)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	29.717 (−)	235 (△1)	44.258 (−)	357 (−)
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	4.117 (−)	75 (−)	50.296 (−)	917 (−)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	151.755 (−)	1,734 (△13)	163.968 (−)	1,881 (−)
ユーロ（イタリア）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
BENI STABILI SPA	185.952 (△336.763)	139 (−)	286.949 (−)	208 (−)
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	11.626 (−)	69 (△0.18159)	15.741 (−)	97 (−)

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

■利害関係人との取引状況等（2018年６月23日から2019年６月24日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
WHEELER REIT INC	2.961	–	–	–	–
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	–	18.755	228	24,558	0.1
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	19.187	–	–	–	–
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	68.158	–	–	–	–
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	180.298	30.159	1,354	145,461	0.3
PHYSICIANS REALTY TRUST	76.067	63.958	1,144	122,910	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	34.068	36.539	1,486	159,709	0.3
AMERICAN HOMES 4 RENT	110.338	92.275	2,305	247,705	0.5
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	35.997	33.291	393	42,305	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	–	3.694	434	46,633	0.1
JBG SMITH PROPERTIES	39.622	41.967	1,699	182,532	0.4
AMERICAN FINANCE TRUST INC	–	20.602	219	23,613	0.0
RETAIL VALUE INC	–	5.916	202	21,714	0.0
INVITATION HOMES INC	120.949	135.096	3,667	394,001	0.8
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	13.143	–	–	–	–
FOREST CITY REALTY TRUST INC	113.135	–	–	–	–
QTS REALTY TRUST INC	21.476	19.246	894	96,134	0.2
SPIRIT MTA REIT	17.097	13.946	122	13,108	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	55.942	48.864	758	81,464	0.2
SAFEHOLD INC	–	2.744	78	8,433	0.0
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	–	17.735	370	39,816	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	8.484	24.28	493	52,971	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	49.73	40.874	901	96,814	0.2
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	84.705	71.712	2,889	310,366	0.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	127.551	105.086	1,935	207,931	0.4
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13.902	8.936	87	9,407	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	–	33.378	653	70,167	0.1
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	8.916	6.509	76	8,166	0.0
FARMLAND PARTNERS INC	14.523	9.63	65	7,034	0.0
CITY OFFICE REIT INC	14.463	15.324	189	20,378	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	78.952	70.292	278	29,901	0.1
CARETRUST REIT INC	32.366	33.024	814	87,515	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34.578	31.63	218	23,478	0.0
STORE CAPITAL CORP	72.549	70.644	2,471	265,524	0.6
PARAMOUNT GROUP INC	86.597	70.246	1,029	110,546	0.2
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8.278	7.336	82	8,896	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	44.936	44.064	790	84,869	0.2
INFRAREIT INC	16.132	–	–	–	–
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	18.694	25.372	464	49,930	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	45.298	39.522	828	88,984	0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7.762	8.002	328	35,233	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	21.369	19.694	583	62,640	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6.974	6.76	266	28,668	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	91.138	75.452	1,194	128,303	0.3
GLOBAL NET LEASE INC	28.621	29.176	577	62,086	0.1
TIER REIT INC	20.328	–	–	–	–
QUALITY CARE PROPERTIES INC	39.836	–	–	–	–
CLIPPER REALTY INC	5.169	5.169	63	6,790	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC	85.299	70.84	1,998	214,667	0.5
VICI PROPERTIES INC	–	127.279	2,900	311,591	0.7
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	21.513	18.806	300	32,241	0.1
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	11.004	10.32	440	47,369	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26.006	25.108	711	76,381	0.2
COLONY CAPITAL INC	208.616	171.468	886	95,226	0.2
小計 口数・金額	9,953.908	7,983.341	319,298	34,299,078	–
小計 銘柄数<比率>	161銘柄<71.3%>	155銘柄<72.3%>	–	–	72.3
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
SMARTCENTRES REIT	27.854	24.167	823	67,014	0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT	29.587	26.047	1,284	104,556	0.2
MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	10.016	–	–	–	–

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	60.656	48.916	1,128	91,847	0.2
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	65.342	52.282	1,393	113,401	0.2
ALLIED PROPERTIES REIT	19.518	18.469	886	72,153	0.2
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	38.546	30.322	376	30,676	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	12.463	9.817	239	19,495	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REIT	10.096	10.523	287	23,415	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.781	7.736	314	25,588	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	30.141	24.488	287	23,398	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV	18.049	16.86	267	21,777	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20.114	19.862	280	22,793	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	21.137	22.017	262	21,324	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	7.446	6.696	122	9,978	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM	37.235	33.203	465	37,860	0.1
DREAM INDUSTRIAL REIT	13.888	22.37	270	22,030	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REIT	7.03	–	–	–	–
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	17.406	19.293	256	20,884	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	9.917	8.529	531	43,240	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	–	10.465	69	5,689	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	58.346	53.304	747	60,867	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	–	5.037	96	7,854	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12.724	16.489	239	19,513	0.0
SLATE RETAIL REIT	7.739	6.406	80	6,579	0.0
SLATE OFFICE REIT	12.079	12.079	72	5,888	0.0
KILLAM APARTMENT REIT	15.367	16.959	333	27,122	0.1
小計 口数・金額	572.477	522.336	11,118	904,955	–
銘柄数<比率>	25銘柄<1.8%>	25銘柄<1.9%>	–	–	1.9
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
BWP TRUST	205.883	166.921	645	48,267	0.1
MIRVAC GROUP	1,562.622	1,398.222	4,404	329,096	0.7
INVESTA OFFICE FUND	211.438	–	–	–	–
CROMWELL PROPERTY GROUP	674.83	608.982	761	56,878	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	140.441	124.412	577	43,133	0.1
GPT GROUP	761.372	632.592	3,966	296,365	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP	137.44	120.666	520	38,859	0.1
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	88.555	95.978	368	27,538	0.1
STOCKLAND	1,031.289	871.018	3,762	281,156	0.6
INGENIA COMMUNITIES GROUP	85.235	79.545	256	19,197	0.0
DEXUS	429.175	383.348	5,167	386,117	0.8
GOODMAN GROUP	676.39	568.14	8,567	640,167	1.4
VICINITY CENTRES	1,363.217	1,131.404	2,964	221,490	0.5
CHARTER HALL GROUP	196.697	162.348	1,803	134,771	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	104.165	99.748	428	32,048	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	307.102	313.615	802	59,989	0.1
ARENA REIT	108.676	106.906	306	22,925	0.0
PROPERTYLINK GROUP	151.222	–	–	–	–
CHARTER HALL LONG WALE REIT	72.501	77.55	396	29,610	0.1
APN INDUSTRIA REIT	42.579	38.914	114	8,577	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	223.901	243.475	445	33,292	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62.65	52.264	183	13,707	0.0
GDI PROPERTY GROUP	208.566	160.1	228	17,106	0.0
RURAL FUNDS GROUP	104.894	105.905	248	18,596	0.0
SCENTRE GROUP	2,259.234	1,887.979	7,268	543,118	1.1
VIVA ENERGY REIT	183.737	156.535	425	31,813	0.1
小計 口数・金額	11,393.811	9,586.567	44,617	3,333,828	–
銘柄数<比率>	26銘柄<6.9%>	24銘柄<7.0%>	–	–	7.0
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	910.52	748.52	71,932	989,075	2.1
PROSPERITY REIT	522	462	1,570	21,598	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	492	481	2,578	35,449	0.1
CHAMPION REIT	871.07	691.07	4,485	61,669	0.1

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円	%
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	403	384	2,284	31,416	0.1
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	588	477	5,094	70,047	0.1
SPRING REIT	351	–	–	–	–
小計 口数・金額	4,137.59	3,243.59	87,945	1,209,256	–
小計 銘柄数<比率>	7銘柄<2.1%>	6銘柄<2.6%>	–	–	2.6
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPITALAND MALL TRUST	1,136.76	1,001.86	2,564	203,539	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,014.36	911.76	2,771	219,966	0.5
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,132.679	992.379	2,123	168,536	0.4
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	952.79	808.39	1,568	124,458	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	876.22	839.72	1,318	104,625	0.2
STARHILL GLOBAL REIT	550.5	469.2	363	28,857	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	548.015	438.715	570	45,261	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	270.88	244.28	385	30,629	0.1
KEPPEL REIT	769.7	626.4	789	62,635	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	247.6	230.1	584	46,382	0.1
ESR REIT	539.43	660.33	353	28,036	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	314.3	257.6	414	32,913	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	234.58	233.38	359	28,522	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	236.6	198.5	202	16,068	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	235.095	217.695	317	25,223	0.1
PARKWAY LIFE REIT	167.7	131.6	402	31,957	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	798.3	571.8	131	10,436	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	524.22	460.92	995	79,009	0.2
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	811.8	657.2	1,334	105,875	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST	435.78	410.78	328	26,079	0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	357.2	218.6	98	7,806	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	912.6	741.7	1,068	84,760	0.2
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	317.2	283.5	277	22,048	0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	359.6	355.6	240	19,048	0.0
SPH REIT	265.4	224.9	238	18,918	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST	488.62	445.32	316	25,091	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	276.1	256.4	156	12,412	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	–	273	193	15,382	0.0
KEPPEL DC REIT	402.2	341	552	43,840	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL T	572.75	555.65	677	53,797	0.1
小計 口数・金額	15,748.979	14,058.279	21,700	1,722,122	–
小計 銘柄数<比率>	29銘柄<3.2%>	30銘柄<3.6%>	–	–	3.6
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
PRECINCT PROPERTIES	423.696	380.191	661	46,876	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	129.943	127.868	310	22,017	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	441.448	361.871	698	49,489	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	606.953	512.744	825	58,496	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	356.878	282.83	383	27,156	0.1
INVESTORE PROPERTY LTD	88.877	–	–	–	–
STRIDE STAPLED GROUP	149.101	140.039	308	21,830	0.0
小計 口数・金額	2,196.896	1,805.543	3,187	225,866	–
小計 銘柄数<比率>	7銘柄<0.4%>	6銘柄<0.5%>	–	–	0.5
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC	419.592	337.35	1,821	249,462	0.5
CAPITAL & REGIONAL PLC	229.731	135.437	18	2,540	0.0
DERWENT LONDON PLC	46.537	38.645	1,218	166,805	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC	63.285	54.616	543	74,491	0.2
HAMMERSON PLC	333.513	269.495	750	102,816	0.2
LAND SECURITIES GROUP PLC	317.138	265.466	2,210	302,674	0.6
WORKSPACE GROUP PLC	50.811	46.404	411	56,301	0.1
INTU PROPERTIES PLC	372.244	295.875	224	30,711	0.1
UNITE GROUP PLC	111.92	92.217	891	122,114	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	312.94	395.499	523	71,707	0.2
SHAFTESBURY PLC	103.012	80.557	659	90,292	0.2

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
SEGRO PLC	425.024	379.728	2,820	386,255	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	119.899	95.824	669	91,645	0.2
ASSURA PLC	1,013.326	854.448	541	74,183	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	221.364	204.861	114	15,625	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	－	194.275	188	25,752	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC	167.573	159.52	152	20,817	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	－	227.534	199	27,294	0.1
SAFESTORE HOLDINGS LTD	89.348	72.106	446	61,121	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	295.326	251.418	506	69,409	0.1
RDI REIT PLC	528.881	77.641	80	10,972	0.0
NEWRIVER REIT PLC	131.034	103.999	194	26,631	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	81.48	235.42	185	25,403	0.1
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37.06	－	－	－	－
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	－	134.957	112	15,413	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	626.95	598.461	921	126,208	0.3
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	228.6	196.113	180	24,680	0.1
LXI REIT PLC	73.4	134.197	167	22,971	0.0
REGIONAL REIT LTD	118.301	110.888	120	16,460	0.0
小計 口数・金額	6,518.289	6,042.951	16,874	2,310,766	－
小計 銘柄数<比率>	26銘柄<5.7%>	28銘柄<4.9%>	－	－	4.9
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シュケル	千円	%
REIT 1 LTD	70.287	63.655	1,128	33,530	0.1
小計 口数・金額	70.287	63.655	1,128	33,530	－
小計 銘柄数<比率>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	－	－	0.1
(韓国)	千口	千口	千韓国・ウォン	千円	%
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	－	9.316	63,255	5,870	0.0
小計 口数・金額	－	9.316	63,255	5,870	－
小計 銘柄数<比率>	－銘柄<－%>	1銘柄<0.0%>	－	－	0.0
(ユーロ…アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円	%
GREEN REIT PLC	293.629	240.878	422	51,646	0.1
HIBERNIA REIT PLC	299.53	242.24	340	41,574	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	138.876	124.155	206	25,223	0.1
小計 口数・金額	732.035	607.273	968	118,444	－
小計 銘柄数<比率>	3銘柄<0.3%>	3銘柄<0.2%>	－	－	0.2
(ユーロ…オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21.124	14.114	347	42,442	0.1
VASTNED RETAIL	6.794	6.326	175	21,420	0.0
WERELDHAVE NV	16.816	14.313	335	40,976	0.1
NSI NV	7.625	6.338	237	28,975	0.1
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	57.184	48.27	6,475	791,555	1.7
小計 口数・金額	109.543	89.361	7,570	925,369	－
小計 銘柄数<比率>	5銘柄<3.0%>	5銘柄<2.0%>	－	－	2.0
(ユーロ…ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%
BEFIMMO	9.8	7.94	409	50,082	0.1
COFINIMMO SA	8.205	7.418	830	101,558	0.2
RETAIL ESTATES	3.232	2.609	204	24,971	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6.873	8.307	211	25,893	0.1
WAREHOUSES DE PAUW	7.037	6.236	897	109,769	0.2
MONTEA SCA	－	3.562	265	32,438	0.1
AEDIFICA	7.647	8.684	719	87,894	0.2
COFINIMMO SA-RTS	8.342	－	－	－	－
小計 口数・金額	51.136	44.756	3,539	432,609	－
小計 銘柄数<比率>	7銘柄<0.7%>	7銘柄<0.9%>	－	－	0.9
(ユーロ…フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA	20.261	19.268	2,605	318,439	0.7
ICADE	18.935	16.153	1,281	156,679	0.3
ALTAREA	1.518	1.209	217	26,631	0.1
KLEPIERRE	87.317	70.94	2,111	258,069	0.5
COVIVIO	22.663	21.906	2,018	246,758	0.5

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
MERCIALYS		22.547	18.406	210	25,739	0.1
小計	口数・金額	173.241	147.882	8.445	1,032,318	–
	銘柄数<比率>	6銘柄<2.4%>	6銘柄<2.2%>	–	–	2.2
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
HAMBORNER REIT AG		33.143	27.782	247	30,292	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		61.358	56.116	788	96,377	0.2
小計	口数・金額	94.501	83.898	1,036	126,670	–
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.3%>	2銘柄<0.3%>	–	–	0.3
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		136.98	97.764	999	122,135	0.3
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		39.724	25.183	172	21,117	0.0
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS S		46.179	–	–	–	–
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		140.114	127.901	1,580	193,243	0.4
小計	口数・金額	362.997	250.848	2,752	336,497	–
	銘柄数<比率>	4銘柄<1.0%>	3銘柄<0.7%>	–	–	0.7
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
BENI STABILI SPA		437.76	–	–	–	–
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		20.03	15.915	94	11,555	0.0
小計	口数・金額	457.79	15.915	94	11,555	–
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	–	–	0.0
合計	口数・金額	52,573.48	44,555.511	–	47,028,742	–
	銘柄数<比率>	311銘柄<99.3%>	303銘柄<99.2%>	–	–	99.2

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

■投資信託財産の構成

2019年６月24日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券、投資証券	47,028,742	99.2
コール・ローン等、その他	382,171	0.8
投資信託財産総額	47,410,913	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第２位を四捨五入しています。
（注２）当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、47,359,422千円、99.9％です。
（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年６月24日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝107.42円、１カナダ・ドル＝81.39円、１オーストラリア・ドル＝74.72円、１香港・ドル＝13.75円、１シンガポール・ドル＝79.36円、１ニュージーランド・ドル＝70.86円、１イギリス・ポンド＝136.94円、１イスラエル・シュケル＝29.71円、100韓国・ウォン＝9.28円、１ユーロ＝122.24円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年６月24日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**47,623,950,891円**
コール・ローン等	133,244,022
投資信託受益証券(評価額)	5,083,074,363
投資証券(評価額)	41,945,667,910
未収入金	361,567,209
未収配当金	100,397,387
(B) 負債	**213,744,900**
未払金	213,036,900
未払解約金	708,000
(C) 純資産総額(A－B)	**47,410,205,991**
元本	36,301,672,788
次期繰越損益金	11,108,533,203
(D) 受益権総口数	**36,301,672,788口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**13,060円**

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

(注２) 期末における元本の内訳

先進国ＲＥＩＴインデックスＦ＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	160,560,827円
先進国ＲＥＩＴインデックスＦ＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	93,381,433円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（安定型）	5,570,605円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（中立型）	14,365,615円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（積極型）	22,970,643円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	53,567,046円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	38,170,950円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	28,280,765円
たわらノーロード 先進国リート	3,920,685,465円
たわらノーロード 先進国リート＜ラップ向け＞	599,465,183円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	151,921,418円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	326,595,821円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,096,319円
たわらノーロード バランス（標準型）	42,404,047円
たわらノーロード バランス（積極型）	94,801,723円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	17,099,439円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	87,460,533円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	76,847,691円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	204,814,938円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	676,227円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	2,026,563円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,696,987円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	5,195,023円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	19,026,187円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	520,077,807円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	53,216,299円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）	175,540,190円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）	158,001,161円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）	310,814,217円
投資のソムリエ	7,768,303,637円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	795,364,191円
ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	135,937,313円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	282,312,537円
ダイナミック・ナビゲーション	746,055円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,021,843,742円
ワールドアセットバランス（基本コース）	951,671,015円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,735,792,629円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	4,282,362円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	3,668,511円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,038,670円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	7,614,992円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	673,546,769円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	16,954,156円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	794,026円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	794,026円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	794,026円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	834,894,408円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	40,270,163円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	363,780,773円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	12,032,969円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,432,240,792円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,009,502,069円
Ｐ－Ｏｎｅマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,461,256,521円
ＤＩＡＭ海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	557,905,314円
期末元本合計	36,301,672,788円

■損益の状況

当期　自2018年６月23日　至2019年６月24日

項目	当期
(A) 配当等収益	**2,193,044,685円**
受取配当金	2,191,595,379
受取利息	1,865,527
支払利息	△416,221
(B) 有価証券売買損益	**1,897,564,952**
売買益	7,074,533,912
売買損	△5,176,968,960
(C) その他費用	**△51,136,964**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**4,039,472,673**
(E) 前期繰越損益金	**8,778,934,476**
(F) 解約差損益金	**△12,880,878,527**
(G) 追加信託差損益金	**11,171,004,581**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**11,108,533,203**
次期繰越損益金(H)	**11,108,533,203**

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

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12期（決算日　2020年４月20日）

（計算期間　2019年４月19日～2020年４月20日）

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	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
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
12期(2020年4月20日)	9,723	△20.7	225,442.54	△18.4	64.7	34.8	0.4	41,166

（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）。

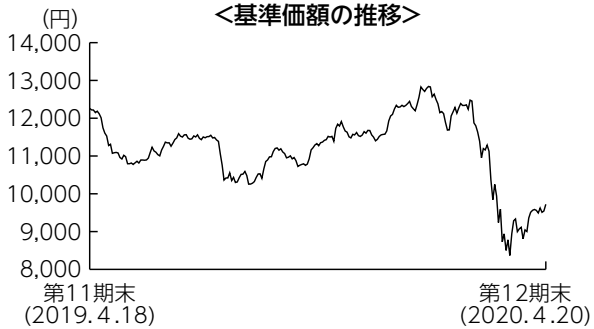
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2019年 4 月18日	円 12,260	% －	ポイント 276,323.22	% －	% 94.4	% 4.4	% 0.6
4　月　末	12,012	△2.0	270,962.63	△1.9	89.9	8.6	0.5
5　月　末	10,861	△11.4	245,572.57	△11.1	90.0	8.2	0.5
6　月　末	11,437	△6.7	258,203.62	△6.6	88.8	9.0	1.8
7　月　末	11,428	△6.8	258,772.93	△6.4	88.5	9.5	1.7
8　月　末	10,433	△14.9	236,418.66	△14.4	88.1	8.4	2.9
9　月　末	10,926	△10.9	248,035.72	△10.2	91.9	6.6	1.0
10　月　末	11,519	△6.0	260,565.89	△5.7	86.0	12.9	1.0
11　月　末	11,675	△4.8	264,578.11	△4.3	88.1	10.9	1.0
12　月　末	12,446	1.5	282,689.73	2.3	89.1	10.4	1.0
2020年 1　月　末	11,890	△3.0	269,975.47	△2.3	87.8	11.2	1.0
2　月　末	11,393	△7.1	260,455.14	△5.7	83.3	15.1	0.8
3　月　末	9,074	△26.0	209,688.40	△24.1	76.5	39.1	0.5
(期　末) 2020年 4 月20日	9,723	△20.7	225,442.54	△18.4	64.7	34.8	0.4

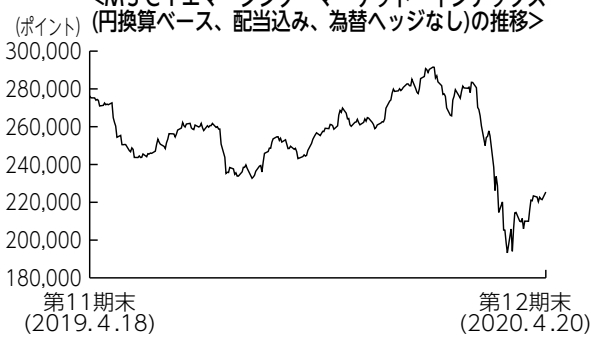
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■**当期の運用経過**（2019年４月19日から2020年４月20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9,723円となり、前期末比で20.7％下落しました。

基準価額の主な変動要因

株式市場では台湾など一部の市場は上昇したものの、新型コロナウイルスや原油価格下落の影響が懸念された多くの市場が下落したうえ、為替市場においてほとんどの通貨に対して円高になったことから、基準価額は下落しました。

投資環境

新興国株式市場は米国による対中追加関税に対する不透明感などから弱含む展開となりましたが、2019年10月中旬以降は米中通商協議の進展期待から反発する動きとなりました。2020年に入ってからも米中通商協議の第一段階の合意署名を受け上昇傾向が続きましたが、２月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大と、原油価格下落による経済への影響が懸念され大きく下落しました。３月下旬以降はいくぶん回復しましたが、前期末と比べて大きく値下がりして期末を迎えました。

為替市場では、米ドルは米中通商協議を巡る混乱からドル安円高が進行したものの、2019年８月に対中追加関税の一部発動延期等をきっかけとしてドル高円安基調となりました。2020年２月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され為替は乱高下し、期末時点では前期末と比べてドル安円高となりました。こうした市場環境を背景に、ほとんどの新興国通貨は対円で下落し、円高となりました。

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	組入比率
1	銀行	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

期末

No.	業種	組入比率
1	銀行	9.9%
2	小売	7.2
3	メディア・娯楽	5.7
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.5
5	半導体・半導体製造装置	4.6
6	素材	4.4
7	エネルギー	3.8
8	電気通信サービス	2.8
9	保険	2.4
10	食品・飲料・タバコ	2.4

（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18.4％下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを2.3％下回りましたが、ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当課税の要因を除くと、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	15円	0.134%
(株式)	(13)	(0.112)
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)
(先物・オプション)	(2)	(0.020)
(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	21	0.186
(株式)	(21)	(0.186)
(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)
(c) その他費用	22	0.201
(保管費用)	(16)	(0.147)
(その他)	(6)	(0.053)
合計	58	0.520

(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（11,180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６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４月19日から2020年４月20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 16,856.16 (146.86)	千アメリカ・ドル 51,386 (－)	百株 27,934.82	千アメリカ・ドル 77,877
	香港	百株 554,549.5 (938)	千香港・ドル 581,838 (△305)	百株 992,284.5	千香港・ドル 992,235
	台湾	百株 208,375.58 (1,865.75)	千台湾・ドル 1,126,428 (△1,378)	百株 357,090	千台湾・ドル 2,042,558
	イギリス	百株 182.62 (－)	千イギリス・ポンド 189 (－)	百株 312.4	千イギリス・ポンド 334
	トルコ	百株 9,122.31 (209.16)	千トルコ・リラ 10,315 (－)	百株 17,342.1	千トルコ・リラ 19,368
	メキシコ	百株 33,335.95 (△2,143)	千メキシコ・ペソ 114,920 (△12,997)	百株 62,660.9	千メキシコ・ペソ 213,460
	フィリピン	百株 24,771.25 (191.22)	千フィリピン・ペソ 175,653 (－)	百株 62,556.72	千フィリピン・ペソ 306,962
	チリ	百株 129,062.57 (8,941.39)	千チリ・ペソ 2,098,587 (－)	百株 320,395.49	千チリ・ペソ 3,500,006
	コロンビア	百株 2,915.21 (－)	千コロンビア・ペソ 3,972,626 (－)	百株 7,626.67	千コロンビア・ペソ 7,804,073
	カタール	百株 8,712.05 (18,556.38)	千カタール・リアル 11,648 (－)	百株 18,546.81	千カタール・リアル 17,574

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	サウジアラビア	百株 16,494.48 (77.55)	千サウジアラビア・リアル 59,534 (−)	百株 8,312.54	千サウジアラビア・リアル 28,127
外国	インド	百株 50,337.27 (1,309.58)	千インド・ルピー 2,322,225 (−)	百株 76,161.37	千インド・ルピー 3,635,329
外国	パキスタン	百株 978.68 (−)	千パキスタン・ルピー 12,229 (−)	百株 2,122	千パキスタン・ルピー 29,010
外国	インドネシア	百株 204,703 (23,972)	千インドネシア・ルピア 93,495,095 (−)	百株 346,444.16	千インドネシア・ルピア 165,267,725
外国	アラブ首長国連邦	百株 9,635.31 (−)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 6,878 (−)	百株 19,636.15	千アラブ首長国連邦・ディルハム 11,658
外国	ブラジル	百株 37,577.79 (827.9)	千ブラジル・レアル 102,312 (△4,702)	百株 61,468.12	千ブラジル・レアル 168,820
外国	チェコ	百株 681.48 (−)	千チェコ・コルナ 8,961 (−)	百株 1,118.36	千チェコ・コルナ 17,327
外国	韓国	百株 9,608.49 (21.69)	千韓国・ウォン 45,418,797 (△2,181)	百株 16,134.78	千韓国・ウォン 81,506,176
外国	中国	百株 161,751.14 (349.4)	千オフショア・人民元 178,257 (−)	百株 121,032.2	千オフショア・人民元 133,546
外国	マレーシア	百株 45,839 (−)	千マレーシア・リンギット 26,788 (−)	百株 83,268.48	千マレーシア・リンギット 46,889
外国	南アフリカ	百株 26,475.81 (△5,801.19)	千南アフリカ・ランド 252,464 (△46,237)	百株 42,859.94	千南アフリカ・ランド 436,794
外国	タイ	百株 109,850 (8,194.21)	千タイ・バーツ 363,305 (△75)	百株 145,855.88	千タイ・バーツ 467,777
外国	ポーランド	百株 2,471.48 (−)	千ポーランド・ズロチ 11,979 (−)	百株 5,605.51	千ポーランド・ズロチ 20,962
外国	ハンガリー	百株 509.73 (−)	千ハンガリー・フォリント 303,954 (−)	百株 834.9	千ハンガリー・フォリント 524,424
外国	ユーロ　ベルギー	百株 27 (−)	千ユーロ 51 (−)	百株 −	千ユーロ −
外国	ユーロ　ギリシャ	百株 3,454.74 (−)	千ユーロ 906 (−)	百株 3,636.23	千ユーロ 1,323

（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 − (62,595)	千タイ・バーツ − (75)	証券 112,163 (−)	千タイ・バーツ 41 (−)

（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
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA CAPPED UCITS ETF	3,088.04 (−)	14,666 (−)	3,088.04 (−)	13,482 (−)
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	113.9 (−)	18,990 (−)	202.2 (−)	34,354 (−)
GRUPO TELEVISA SAB	67.1 (147.2)	2,312 (5,435)	110.5 (−)	3,897 (−)
CEMEX SAB DE CV	1,216.9 (−)	7,668 (−)	2,013.8 (−)	13,677 (−)
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	17.7 (27.4)	1,113 (2,493)	20.1 (−)	1,284 (−)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	137.3 (−)	3,252 (△242)	278.5 (−)	7,951 (−)
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	10.1 (39.7)	976 (4,843)	26.5 (−)	2,907 (−)
ブラジル	千口	千ブラジル・レアル	千口	千ブラジル・レアル
SUL AMERICA SA	10.7 (17.869)	568 (561)	12.3 (−)	646 (−)
BANCO SANTANDER BRASIL SA	− (34.6)	− (1,507)	21 (−)	818 (−)
ENERGISA SA	5.1 (16)	281 (719)	15 (−)	810 (−)
KLABIN SA	16.9 (62)	356 (975)	53.7 (−)	1,049 (−)
BANCO BTG PACTUAL SA	4 (18.5)	279 (876)	15.3 (−)	906 (−)
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
REDEFINE PROPERTIES LTD	145.422 (279.94)	1,175 (2,538)	272.494 (−)	1,494 (−)
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	143.934 (184.218)	2,517 (4,439)	132.389 (−)	2,386 (−)
HYPROP INVESTMENTS LTD	− (−)	− (−)	22.174 (−)	1,499 (−)
FORTRESS REIT LTD	− (117.482)	− (2,344)	62.964 (−)	1,174 (−)
FORTRESS REIT LTD-B	− (−)	− (−)	57.784 (−)	603 (−)
RESILIENT REIT LTD	− (0.698)	− (−)	29.298 (−)	1,655 (−)

（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 83,453	百万円 71,156	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	100,666,358千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	44,319,711千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	2.27

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■**利害関係人との取引状況等**（2019年４月19日から2020年４月20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	
TRIP.COM GROUP LTD ADR	390.58	236.39	563	60,827	インターネット販売・通信販売
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	170	100.55	71	7,702	金属・鉱業
SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	699	242.1	120	12,981	石油・ガス・消耗燃料
CREDICORP LTD	64.94	34.47	496	53,560	銀行
SINA CORP	58.7	37.64	129	13,994	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	527.53	297.41	242	26,151	無線通信サービス
NETEASE INC-ADR	74.21	35.13	1,224	132,140	娯楽
GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	－	33.43	24	2,643	銀行
SOUTHERN COPPER CORP	72.48	42.94	129	14,018	金属・鉱業
TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	－	37.89	29	3,164	各種電気通信サービス
YPF SA ADR	－	15.94	6	667	石油・ガス・消耗燃料
LUKOIL SPON ADR	467	208.53	1,299	140,209	石油・ガス・消耗燃料
GAZPROM PAO ADR	5,196.69	2,639.51	1,302	140,480	石油・ガス・消耗燃料
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	1,570.79	787.21	307	33,123	銀行
INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	1,058	940	61	6,602	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	1,028.8	547.36	42	4,635	不動産管理・開発
SURGUTNEFTEGAZ ADR	775.37	432.84	198	21,388	石油・ガス・消耗燃料
51JOB INC ADR	23	15.26	109	11,773	専門サービス
X5 RETAIL GROUP NV GDR	126.36	68.74	196	21,151	食品・生活必需品小売り
NOVATEK PJSC GDR	88.33	46.01	593	64,035	石油・ガス・消耗燃料
BAIDU INC -SPON ADR	263.13	135.55	1,423	153,557	インタラクティブ・メディアおよびサービス
NOVOLIPETSK STEEL GDR	136.17	81.7	138	14,993	金属・鉱業
BANCO MACRO SA ADR	－	32.36	53	5,722	銀行
MMC NORILSK NICKEL ADR	635.43	315.94	841	90,738	金属・鉱業
ROSNEFT OIL CO GDR	1,151	615.61	258	27,855	石油・ガス・消耗燃料
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	136.49	70.71	795	85,809	各種消費者サービス
SEVERSTAL GDR	247.28	122.6	142	15,383	金属・鉱業
TATNEFT ADR	246.84	130.78	549	59,233	石油・ガス・消耗燃料
MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	237.48	147.36	99	10,747	金属・鉱業
VTB BANK OJSC GDR	1,720	820	75	8,165	銀行
DP WORLD PLC	152.19	60.42	93	10,104	運送インフラ
MAGNIT PJSC GDR	356.89	201.42	190	20,590	食品・生活必需品小売り
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	424.34	222.33	396	42,793	インターネット販売・通信販売
TAL EDUCATION GROUP-ADR	339.86	190.58	984	106,221	各種消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD ADR	27	16.3	40	4,320	資本市場
SBERBANK ADR	2,588.17	1,341.38	1,385	149,497	銀行
PHOSAGRO PJSC GDR	137.84	92.54	108	11,701	化学
HUAZHU GROUP LTD ADR	126.76	55.08	170	18,433	ホテル・レストラン・レジャー
JOYY INC-ADR	43.98	31.62	196	21,233	インタラクティブ・メディアおよびサービス
GDS HOLDINGS LTD ADR	56	32.56	192	20,726	情報技術サービス
ZAI LAB LTD ADR	－	16.93	107	11,593	バイオテクノロジー
BEST INC ADR	－	85.74	47	5,171	航空貨物・物流サービス
HUYA INC ADR	－	15.6	25	2,785	娯楽
NIO INC ADR	－	234.28	75	8,113	自動車
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	81.15	46.89	51	5,509	娯楽
58.COM INC ADR	91.17	51.12	262	28,293	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AUTOHOME INC ADR	56.56	30.96	246	26,615	インタラクティブ・メディアおよびサービス
LUCKIN COFFEE INC ADR	－	30.29	13	1,434	ホテル・レストラン・レジャー
WEIBO CORP ADR	54.27	19.47	71	7,707	インタラクティブ・メディアおよびサービス
JD.COM INC ADR	697.18	362.26	1,671	180,373	インターネット販売・通信販売
GLOBANT SA	－	19.17	197	21,307	ソフトウェア
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	1,230.79	850.33	17,814	1,921,997	インターネット販売・通信販売
MOMO INC SPON ADR	140.47	63.37	150	16,278	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)	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	
BAOZUN INC-SPN ADR	34	20.7	64	6,907	インターネット販売・通信販売
PINDUODUO INC ADR	184.17	96.03	426	46,063	インターネット販売・通信販売
YUM CHINA HOLDINGS INC	343.85	176.25	799	86,273	ホテル・レストラン・レジャー
IQIYI INC ADR	111.09	69.53	134	14,463	娯楽
POLYUS PJSC GDR	60.12	25.09	198	21,384	金属・鉱業
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	47.46	37.6	72	7,768	医薬品
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	306.96	158.27	455	49,161	航空貨物・物流サービス
小計 株数・金額	24,857.87	13,926.07	38,171	4,118,284	
小計 銘柄数<比率>	50銘柄	60銘柄	−	<10.0%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
JIANGXI COPPER CO LTD	1,240	380	287	3,998	金属・鉱業
JIANGSU EXPRESS	1,280	360	316	4,399	運送インフラ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	1,260	580	203	2,825	旅客航空輸送業
ANGANG STEEL CO LTD-H	1,040	−	−	−	金属・鉱業
CHINA MOBILE LIMITED	5,825	2,995	18,059	251,393	無線通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	1,060	615	3,533	49,181	建設資材
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	2,880	1,000	109	1,517	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING ENTERPRISES	515	190	515	7,180	ガス
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	4,360	2,500	672	9,361	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	3,400	1,820	3,024	42,105	ヘルスケア・テクノロジー
YANZHOU COAL MINING CO LTD	1,720	700	433	6,031	石油・ガス・消耗燃料
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	700	365	2,412	33,584	パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,440	380	90	1,258	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	1,240	800	236	3,285	旅客航空輸送業
CNOOC LTD	16,970	8,790	7,374	102,657	石油・ガス・消耗燃料
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	2,700	1,700	1,193	16,612	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	4,520	2,340	3,837	53,419	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	3,651.2	1,871.2	4,893	68,113	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,648.88	1,568.88	5,036	70,102	不動産管理・開発
CITIC LTD	5,620	2,800	2,214	30,830	コングロマリット
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	1,980	−	−	−	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	1,620	940	514	7,157	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	6,980	3,800	1,664	23,168	コンピュータ・周辺機器
PETRO CHINA CO LTD	19,820	10,700	2,953	41,108	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	5,927.42	2,567.42	1,283	17,869	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	1,599.9	993.9	1,302	18,123	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	24,092	12,912	4,996	69,557	石油・ガス・消耗燃料
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	540	−	−	−	医薬品
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	940	370	509	7,086	情報技術サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	2,320	1,010	1,137	15,830	ソフトウェア
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	755	396	3,177	44,236	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	2,880	1,700	768	10,696	ガス
TOWNGAS CHINA CO LTD	910	100	35	498	ガス
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,520	800	318	4,432	運送インフラ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	6,340	4,200	613	8,535	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	1,240	880	797	11,098	運送インフラ
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	3,740	1,460	232	3,231	金属・鉱業
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	800	−	−	−	資本市場
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	−	610	893	12,431	不動産管理・開発
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	1,040	610	890	12,397	運送インフラ
CHINA EVERBRIGHT LTD	1,060	620	734	10,218	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,710	922	2,143	29,839	ガス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	635	425	836	11,642	電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	4,780	2,600	3,042	42,344	自動車
SHENZHEN INVESTMENT LTD	3,060	1,480	356	4,964	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	820	440	1,768	24,621	ガス
BYD CO LTD	575	270	1,186	16,518	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	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA TELECOM CORP LTD	13,400	7,000	1,778	24,749	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	1,720	580	348	4,844	エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,300	9,100	864	12,033	娯楽
SINOTRANS LTD	1,900	2,480	453	6,317	航空貨物・物流サービス
MAANSHAN IRON & STEEL	1,720	160	37	518	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	3,375.92	1,925.92	853	11,876	商業サービス・用品
MMG LTD	2,200	–	–	–	金属・鉱業
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	1,360	700	350	4,872	紙製品・林産品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	6,617.88	3,477.88	2,584	35,970	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	1,890	1,580	467	6,510	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	1,912	1,012	935	13,016	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	3,125	1,190	595	8,282	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	7,150	3,560	5,724	79,684	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	5,610	3,070	1,013	14,102	金属・鉱業
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	700	–	–	–	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,760	1,040	1,148	15,982	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,747	1,567	2,356	32,806	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD	1,764.4	814.4	1,162	16,188	機械
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	1,000	340	159	2,214	石油・ガス・消耗燃料
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	3,730	2,930	606	8,442	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL	460	170	215	3,000	コングロマリット
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD	–	540	439	6,111	運送インフラ
TINGYI HOLDING CORP	1,780	860	1,111	15,466	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	340	160	692	9,632	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	2,820	1,300	2,061	28,700	水道
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	2,080	1,480	504	7,025	医薬品
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	1,413.33	733.33	2,705	37,667	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	1,460	740	388	5,407	運送インフラ
SINO BIOPHARMACEUTICAL	6,755	3,455	3,987	55,500	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,650	1,390	3,912	54,466	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	5,426	2,804	114,851	1,598,737	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	4,920	2,695	21,182	294,863	保険
LI NING CO LTD	–	1,015	2,461	34,262	繊維・アパレル・贅沢品
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	5,080	3,280	1,000	13,925	水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	9,702.4	4,352.4	317	4,422	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	3,500	2,100	317	4,414	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	1,640	540	285	3,968	旅客航空輸送業
ZTE CORP	712.88	430.88	1,027	14,304	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	2,500	1,260	280	3,911	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	3,340	1,750	2,492	34,688	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	2,485	690	146	2,036	海運業
BANK OF COMMUNICATIONS	8,102.05	3,792.05	1,827	25,442	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	1,862.5	1,162.5	702	9,773	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	720	390	1,528	21,280	電子装置・機器・部品
CHINA CONSTRUCTION BANK	91,385.3	46,635.3	28,540	397,287	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	726	384	3,603	50,165	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,700	1,740	890	12,401	自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	1,580	640	545	7,590	不動産管理・開発
SSY GROUP LTD	1,440	980	596	8,307	医薬品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	1,710	600	468	6,514	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	3,920	1,660	1,538	21,420	建設資材
BANK OF CHINA LTD	75,282	37,952	11,309	157,430	銀行
SHUI ON LAND LTD	3,355	3,880	516	7,183	不動産管理・開発
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,130	600	1,854	25,807	不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	820	–	–	–	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	800	804	810	11,281	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	3,709.7	1,824.7	6,441	89,661	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	
IND & COMM BK OF CHINA - H	65,902.35	31,332.35	16,104	224,179	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	960	355	299	4,175	金属・鉱業
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	1,040	565	416	5,804	電子装置・機器・部品
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	2,276	1,196	688	9,589	建設・土木
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	4,420	1,990	1,040	14,487	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	1,780	430	92	1,280	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	540	400	552	7,683	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	510	170	394	5,490	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	1,150	560	1,150	16,019	家庭用耐久財
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	1,910	—	—	—	食品
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	7,271.42	3,851.42	3,766	52,432	不動産管理・開発
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	3,690	1,320	314	4,373	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	8,798	3,848	1,427	19,872	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	1,210	445	504	7,024	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	687	362	4,090	56,941	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,040	550	3,517	48,960	繊維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL	2,610.28	1,265.28	1,213	16,890	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	5,140	2,860	1,527	21,259	不動産管理・開発
CHINA AOYUAN GROUP LTD	—	410	376	5,244	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	2,535	1,340	274	3,823	不動産管理・開発
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	1,500	292	4,071	繊維・アパレル・贅沢品
SOHO CHINA LTD	1,725	1,115	404	5,634	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	760	450	1,190	16,568	ソフトウェア
SINOTRUK HONG KONG LTD	645	385	591	8,231	機械
CHINA RAILWAY GROUP LTD	3,380	2,050	906	12,612	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	1,220	540	399	5,562	食品
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	525	250	410	5,707	通信機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	1,650	870	748	10,414	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,880	2,670	1,503	20,924	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	2,518	1,336	3,266	45,469	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	2,500	980	1,342	18,688	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD - H	3,374.5	1,934.5	793	11,040	機械
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	1,260	770	733	10,203	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,115	1,260	1,512	21,047	食品・生活必需品小売り
BBMG CORP	2,220	460	91	1,274	建設資材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	1,452	236	43	604	金属・鉱業
SINOPHARM GROUP CO	1,076	616	1,232	17,149	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	1,340	1,301	18,111	建設資材
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	2,760	80	10	151	建設・土木
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	2,745.27	1,265.27	832	11,589	自動車
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,995	845	301	4,199	金属・鉱業
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	2,680	600	190	2,647	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	2,720	1,880	733	10,206	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	737	305	418	5,824	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	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	3,250	—	—	—	医薬品
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,330	1,230	4,225	58,812	不動産管理・開発
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	1,660	860	283	3,950	不動産管理・開発
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	—	566	358	4,987	機械
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,440	885	3,367	46,874	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	846	353	896	12,480	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	5,926.56	3,021.56	1,713	23,848	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	2,030	1,260	379	5,279	不動産管理・開発
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	848	68	51	710	電気設備
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	—	680	703	9,787	建設関連製品
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,690	1,240	378	5,264	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	27,910	13,380	4,161	57,923	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	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	550	310	926	12,902	専門小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,990	1,450	884	12,312	各種金融サービス
CITIC SECURITIES CO LTD	2,025	915	1,363	18,977	資本市場
SEAZEN GROUP LIMITED	1,720	780	556	7,741	不動産管理・開発
HAITONG SECURITIES CO LTD	2,920	1,220	875	12,193	資本市場
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	7,890	4,610	1,170	16,299	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	460	320	870	12,115	医薬品
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	3,340	1,640	970	13,514	不動産管理・開発
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	1,215	1,235	433	6,034	建設・土木
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	3,285	1,955	762	10,613	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	850	200	90	1,255	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	720	672	9,360	商業サービス・用品
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	940	－	－	－	不動産管理・開発
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	598	260	295	4,118	資本市場
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	7,170	3,700	1,739	24,206	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	430	200	1,196	16,648	食品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	740	320	411	5,728	ライフサイエンス・ツール／サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	1,180	630	2,119	29,509	商業サービス・用品
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	－	630	311	4,340	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	－	167	1,603	22,316	ヘルスケア・テクノロジー
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	3,080	－	－	－	自動車部品
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	－	190	199	2,777	各種消費者サービス
A-LIVING SERVICES CO LTD	－	160	628	8,752	商業サービス・用品
CHINA TOWER CORP LTD	38,060	21,000	3,633	50,571	各種電気通信サービス
XIAOMI CORP	3,356	5,190	5,397	75,134	コンピュータ・周辺機器
WUXI APPTEC CO LTD	－	96	1,008	14,044	ライフサイエンス・ツール／サービス
MEITUAN DIANPING	294	502	5,020	69,878	インターネット販売・通信販売
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	－	100	320	4,454	ホテル・レストラン・レジャー
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY-RTS	114	－	－	－	電気設備
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,760	2,200	1,036	14,423	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	－	400	1,334	18,569	バイオテクノロジー
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,960	4,560	674	9,394	資本市場
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	1,340	640	819	11,403	不動産管理・開発
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	1,480	825	2,945	40,997	機械
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	－	280	372	5,183	各種消費者サービス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	－	720	683	9,511	専門小売り
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	－	160	467	6,503	医薬品
CHINA VANKE CO LTD-H	1,208.61	645.61	1,649	22,961	不動産管理・開発
LUYE PHARMA GROUP LTD	1,080	530	203	2,832	医薬品
CAR INC	680	－	－	－	陸運・鉄道
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	390	240	387	5,398	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD	9,810	5,450	1,040	14,490	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
FULLSHARE HOLDINGS LTD	6,950	－	－	－	電気設備
BAIC MOTOR CORP LTD	1,635	820	269	3,755	自動車
GF SECURITIES CO LTD	1,120	756	637	8,871	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	512	216	368	5,129	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	1,458	726	930	12,955	資本市場
3SBIO INC	1,290	780	679	9,456	バイオテクノロジー
LEGEND HOLDINGS CORP	315	135	127	1,781	コンピュータ・周辺機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	1,605	1,040	500	6,963	医薬品
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	9,040	5,210	463	6,454	資本市場
CHINA LITERATURE LTD	240	60	186	2,589	メディア
DALI FOODS GROUP CO LTD	1,880	780	373	5,200	食品
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	1,410	270	104	1,458	電子装置・機器・部品
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	5,250	4,850	446	6,211	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
MEITU INC	1,525	−	−	−	コンピュータ・周辺機器
BOC AVIATION LTD	194	131	650	9,053	商社・流通業
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	230	87	227	3,172	保険
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	960	768	907	12,636	資本市場
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	445	390	4,543	63,245	ライフサイエンス・ツール／サービス
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	20,960	−	−	−	インターネット販売・通信販売
小計 株数・金額	892,466.75	455,669.75	459,608	6,397,743	
小計 銘柄数<比率>	207銘柄	207銘柄	−	<15.5%>	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	−	210	4,326	15,530	通信機器
ACER INC	2,785.32	1,405.32	2,213	7,946	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	675.54	365.54	7,237	25,983	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	456.16	256.16	5,904	21,197	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	1,949.28	939.28	4,085	14,668	建設資材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	310	170	3,289	11,809	電子装置・機器・部品
TAIWAN BUSINESS BANK	3,714.57	3,627.79	3,809	13,674	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	850	410	2,796	10,038	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	650	250	2,325	8,346	コンピュータ・周辺機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	549.75	399.75	3,269	11,739	コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC	2,608.58	1,358.58	8,531	30,629	コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	920.7	320.7	1,324	4,754	不動産管理・開発
EVA AIRWAYS CORP	1,962.69	841.25	866	3,110	旅客航空輸送業
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	627.6	337.6	7,325	26,300	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,123.45	2,347.71	4,765	17,109	銀行
CHINA AIRLINES	2,321.56	681.56	488	1,754	旅客航空輸送業
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	1,961.69	1,241.69	4,109	14,754	自動車部品
CHINA STEEL CORP	12,110.58	5,780.58	11,416	40,985	金属・鉱業
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	2,649.94	1,779.94	3,533	12,684	保険
ADVANTECH CO LTD	298.89	138.89	3,875	13,911	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	3,913.04	2,393.04	4,474	16,065	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,976.63	966.63	13,001	46,674	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,080	670	4,093	14,696	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,573.27	1,753.27	19,022	68,292	各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	8,731.94	3,911.94	2,883	10,350	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,468	778	8,246	29,606	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	1,982.76	988.2	1,012	3,636	海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	3,218.24	1,788.24	4,443	15,953	コングロマリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	298.25	203.07	2,964	10,643	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	153.22	73.22	2,050	7,360	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	512.85	242.85	4,492	16,128	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	4,246.33	2,166.33	18,023	64,705	化学
FORMOSA TAFFETA CO LTD	950	190	606	2,175	繊維・アパレル・贅沢品
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	3,355.94	1,755.94	12,484	44,820	化学
GIANT MANUFACTURING	301.51	111.51	1,577	5,664	レジャー用品
MEDIATEK INC	1,435.07	745.07	27,418	98,432	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	6,319.36	3,249.36	13,192	47,360	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	6,342.32	3,994.59	7,449	26,745	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	260	150	7,515	26,978	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	1,440	690	4,547	16,324	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	8,761.41	5,141.41	8,663	31,101	各種金融サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,749.2	3,769.41	14,399	51,692	保険
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	12,234.03	7,584.03	6,522	23,414	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,361.68	5,255.45	13,821	49,620	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	12,492.25	6,082.25	46,103	165,511	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	10,264.95	5,214.95	15,149	54,386	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	92.2	52.2	20,097	72,148	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	9,785.89	4,285.93	5,250	18,848	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	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	9,430.61	4,830.61	4,077	14,636	保険
INVENTEC CO LTD	2,060.05	1,460.05	3,445	12,370	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,848.45	938.45	4,030	14,470	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	10,584.43	4,714.43	5,610	20,140	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	16,720.48	9,120.48	17,876	64,175	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,322.2	5,028.52	10,559	37,910	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	855.6	355.6	3,449	12,383	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	4,898.28	2,528.28	15,194	54,549	化学
WISTRON CORP	2,669.16	1,359.16	3,540	12,710	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	2,289.9	1,459.9	4,168	14,963	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	4,622.97	2,402.97	16,292	58,488	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	543.92	293.92	8,435	30,283	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,084.8	484.8	4,004	14,375	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	126.58	56.58	1,530	5,494	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	543.93	283.93	1,186	4,260	不動産管理・開発
RUENTEX INDUSTRIES LTD	338.29	118.29	785	2,819	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	955.88	455.88	2,484	8,919	電子装置・機器・部品
STANDARD FOODS CORP	346.39	256.39	1,681	6,038	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	1,518.99	478.99	1,841	6,611	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT CORP	4,445.61	2,496.84	10,486	37,647	建設資材
TATUNG CO LTD	1,640	610	1,381	4,960	家庭用耐久財
TAIWAN SEMICONDUCTOR	23,370.83	12,020.83	368,438	1,322,693	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	11,565.25	5,665.25	8,526	30,609	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	3,180	2,170	2,886	10,361	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORP	231.6	131.6	4,467	16,039	電子装置・機器・部品
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	2,030	1,090	3,515	12,619	運送インフラ
INNOLUX CORPORATION	8,203.45	5,143.45	3,214	11,540	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	1,432.03	722.03	2,725	9,785	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	190.73	86.45	2,118	7,603	機械
TAIMED BIOLOGICS INC	180	−	−	−	バイオテクノロジー
PEGATRON CORP	1,925.54	1,025.54	6,676	23,967	コンピュータ・周辺機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	90	40	1,988	7,136	機械
WIN SEMICONDUCTORS CORP	310	140	3,836	13,771	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,117.37	650.29	6,470	23,228	各種金融サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	453.85	223.85	2,294	8,237	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	8,394.12	4,516.74	8,988	32,268	銀行
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	2,990	1,769.93	7,557	27,131	銀行
WIWYNN CORP	−	30	1,989	7,140	コンピュータ・周辺機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	3,329.03	1,779.03	11,883	42,663	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	190	90	3,415	12,261	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	150	60	1,263	4,534	家庭用耐久財
小計 株数・金額	311,006.96	164,158.29	949,323	3,408,070	
小計 銘柄数<比率>	87銘柄	88銘柄	−	<8.3%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	227.56	97.78	148	20,040	金属・鉱業
小計 株数・金額	227.56	97.78	148	20,040	
小計 銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	−	<0.0%>	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
AKBANK TAS	2,958.91	1,660.79	961	15,029	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	197.24	35.73	65	1,028	飲料
ARCELIK	189.02	8.01	12	192	家庭用耐久財
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	317.66	91.92	249	3,896	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	1,259.6	887.23	730	11,412	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	59.19	46.68	270	4,224	自動車
KOC HOLDING AS	673.25	302.17	453	7,093	コングロマリット
PETKIM PETROKIMYA HOLDING	881.74	−	−	−	化学
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	543.97	−	−	−	コングロマリット

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURK HAVA YOLLARI	490.81	430.05	452	7,071	旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	931.18	549.66	730	11,417	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI AS	2,383.94	1,316.2	1,104	17,260	銀行
TURKIYE IS BANKASI	1,510.63	694.78	343	5,375	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	106.81	72.64	633	9,900	石油・ガス・消耗燃料
HACI OMER SABANCI HOLDING AS	1,091.14	213.6	166	2,597	各種金融サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	190.11	191.76	1,069	16,709	食品・生活必需品小売り
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	137.35	30.4	61	955	運送インフラ
TURKIYE HALK BANKASI AS	619.7	－	－	－	銀行
小計 株数・金額	14,542.25	6,531.62	7,304	114,164	
小計 銘柄数<比率>	18銘柄	15銘柄	－	<0.3%>	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
ALFA SAB DE CV	2,641	861	872	3,916	コングロマリット
EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	191	106	720	3,236	複合小売り
GRUPO TELEVISA SAB	2,389	－	－	－	メディア
GRUPO BIMBO SAB DE CV	1,626	720	2,409	10,820	食品
GRUMA SAB DE CV	216.4	103.85	2,155	9,677	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	202.6	77.6	1,183	5,312	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	376	92	446	2,003	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	2,484	1,332	8,454	37,959	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	940.25	327.25	895	4,020	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	161.55	75.55	1,320	5,929	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	1,343	910	3,179	14,276	家庭用品
ALSEA SAB DE CV	437	294	489	2,197	ホテル・レストラン・レジャー
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	204.65	100.75	2,419	10,862	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	3,389.52	1,747.52	7,804	35,041	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE CV	32,125.78	16,379.78	21,654	97,226	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	1,988	1,521	2,441	10,961	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	426	258	2,522	11,325	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	4,962	2,535	14,685	65,936	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	312	198.4	2,729	12,255	運送インフラ
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	274	－	－	－	メディア
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	544	187	1,270	5,702	ガス
BANCO SANTANDER MEXICO SA	1,545.9	－	－	－	銀行
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	515	－	－	－	飲料
小計 株数・金額	59,294.65	27,826.7	77,653	348,663	
小計 銘柄数<比率>	23銘柄	19銘柄	－	<0.8%>	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	7,186	3,801	11,992	25,423	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,798.9	1,096.3	4,829	10,237	コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	855.7	248.2	1,511	3,204	銀行
AYALA CORP	244.33	154.33	9,213	19,532	コングロマリット
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	3,077	－	－	－	コングロマリット
DMCI HOLDINGS INC	3,518.5	－	－	－	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC	27.85	15.55	3,467	7,351	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	814.2	620.8	4,997	10,594	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,892.4	1,519.9	8,177	17,335	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP	437.2	289.3	4,194	8,893	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,449.97	1,186.75	4,942	10,478	銀行
BDO UNIBANK INC	1,925.83	912.73	9,583	20,317	銀行
MEGAWORLD CORP	9,620	1,980	554	1,175	不動産管理・開発
PLDT INC	86	47.05	5,354	11,351	無線通信サービス
ROBINSONS LAND CORP	2,187.22	940	1,434	3,041	不動産管理・開発
SECURITY BANK CORP	234.2	113.1	1,181	2,505	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC	9,700.75	4,911.75	15,693	33,269	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	791.3	414.9	5,260	11,153	食品
SM INVESTMENTS CORP	219.38	106.38	9,148	19,395	コングロマリット

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP		11,489	3,529	952	2,019	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP		1,282	510	1,366	2,897	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY		234.3	148	3,981	8,440	電力
GT CAPITAL HOLDINGS INC		91.37	24.11	1,181	2,504	コングロマリット
小計	株数・金額	60,163.4	22,569.15	109,019	231,121	
	銘柄数<比率>	23銘柄	21銘柄	－	<0.6%>	
(チリ)		百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE		64,144.7	27,996.58	91,828	11,597	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES		47.7	33.79	96,301	12,162	銀行
BANCO DE CHILE		22,134.93	25,958.42	184,564	23,310	銀行
EMPRESAS CMPC SA		1,115.77	390.74	63,897	8,070	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA		376.73	180.31	92,336	11,662	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		130.24	53.63	35,663	4,504	飲料
ENTEL CHILE SA		135.72	66.1	28,489	3,598	無線通信サービス
ENEL AMERICAS SA		28,187.18	19,544.64	266,784	33,694	電力
COLBUN SA		8,191.36	2,568.74	29,861	3,771	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AGUAS ANDINAS SA		2,240.14	868.53	22,581	2,852	水道
EMBOTELLADORA ANDINA SA		404.01	200.26	37,849	4,780	飲料
LATAM AIRLINES GROUP SA		306.55	38.99	12,355	1,560	旅客航空輸送業
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA		106.24	40.1	76,049	9,605	化学
FALABELLA SA		674.78	514.1	113,102	14,284	複合小売り
ITAU CORPBANCA		132,369.77	12,369.77	2,981	376	銀行
CENCOSUD SA		1,511.41	732.05	71,382	9,015	食品・生活必需品小売り
ENEL CHILE SA		28,910.6	17,039.55	111,609	14,096	電力
小計	株数・金額	290,987.83	108,596.3	1,337,638	168,943	
	銘柄数<比率>	17銘柄	17銘柄	－	<0.4%>	
(コロンビア)		百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP		441.5	216.75	390,150	10,690	電力
ECOPETROL SA		4,555.98	2,603.36	507,655	13,909	石油・ガス・消耗燃料
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF		101.38	－	－	－	各種金融サービス
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF		3,418.31	1,960.73	185,288	5,076	銀行
CEMENTOS ARGOS SA		377.2	－	－	－	建設資材
GRUPO ARGOS SA		282.17	148.97	168,336	4,612	建設資材
BANCOLOMBIA SA		209.47	67.47	178,795	4,898	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		449.76	275.34	758,286	20,777	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA		240.67	92.36	222,772	6,103	各種金融サービス
小計	株数・金額	10,076.44	5,364.98	2,411,284	66,069	
	銘柄数<比率>	9銘柄	7銘柄	－	<0.2%>	
(カタール)		百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR INSURANCE CO SAQ		144.17	822.82	177	5,248	保険
QATAR NATIONAL BANK		429.98	2,186.04	3,869	114,260	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC		182.02	758.09	304	8,990	銀行
OOREDOO QSC		67.6	534.59	327	9,659	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC		－	292.53	492	14,555	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		50.5	326.18	482	14,255	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC		－	286.75	230	6,810	銀行
INDUSTRIES QATAR QSC		174.05	940.11	644	19,030	コングロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ		114.06	589.69	893	26,381	銀行
MASRAF AL RAYAN		365.35	1,604.22	601	17,755	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		167.63	1,000.55	276	8,163	不動産管理・開発
EZDAN HOLDING GROUP QSC		694.16	－	－	－	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO		－	1,769.57	326	9,646	化学
小計	株数・金額	2,389.52	11,111.14	8,627	254,757	
	銘柄数<比率>	10銘柄	12銘柄	－	<0.6%>	
(サウジアラビア)		百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO		－	124.66	536	15,445	化学
JARIR MARKETING CO		－	21.89	301	8,681	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
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	−	20.3	130	3,756	保険
ETIHAD ETISALAT CO	−	207.81	516	14,856	無線通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	−	365.42	778	22,400	銀行
AL RAJHI BANK	−	578.93	3,085	88,806	銀行
ARAB NATIONAL BANK	−	303.9	561	16,163	銀行
BANK ALBILAD	−	210.92	434	12,492	銀行
BANK AL-JAZIRA	−	294.76	333	9,586	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	−	273.61	746	21,497	銀行
RIYAD BANK	−	594.73	915	26,359	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP	−	487.48	1,011	29,097	銀行
SAUDI TELECOM CO	−	190.84	1,742	50,145	各種電気通信サービス
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	−	86.58	557	16,047	化学
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	−	353.28	2,691	77,475	化学
SAUDI CEMENT CO	−	27.73	141	4,062	建設資材
SAUDI ELECTRICITY CO	−	407.14	676	19,474	電力
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	−	76.5	130	3,742	化学
SAVOLA GROUP	−	140.14	574	16,536	食品
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	−	284.89	273	7,871	化学
ALMARAI CO JSC	−	130.48	626	18,043	食品
EMAAR ECONOMIC CITY	−	153.95	107	3,105	不動産管理・開発
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	−	249.29	346	9,972	化学
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	−	37.51	164	4,728	化学
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	−	484.81	387	11,162	化学
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	−	208.3	169	4,879	不動産管理・開発
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	−	60.66	86	2,479	石油・ガス・消耗燃料
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	−	7.18	73	2,107	保険
ALINMA BANK	−	500.3	755	21,741	銀行
SAUDI ARABIAN MINING CO	−	225.49	795	22,908	金属・鉱業
SAUDI AIRLINES CATERING CO	−	31.19	221	6,373	ホテル・レストラン・レジャー
SAUDI ARABIAN OIL CO	−	545.76	1,645	47,356	石油・ガス・消耗燃料
NATIONAL COMMERCIAL BANK	−	573.06	2,011	57,889	銀行
小計 株数・金額	−	8,259.49	23,531	677,245	
小計 銘柄数<比率>	−銘柄	33銘柄	−	<1.6%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	2,705.06	1,400.2	171,384	243,365	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	729.4	282.46	10,171	14,443	石油・ガス・消耗燃料
ASIAN PAINTS LTD	278.04	144.6	25,395	36,061	化学
EICHER MOTORS LTD	12.23	5.58	8,241	11,703	自動車
GRASIM INDUSTRIES LTD	326.39	134.74	7,350	10,438	建設資材
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	721.96	405.49	14,727	20,912	自動車
SHREE CEMENT LTD	8.46	5.11	9,681	13,748	建設資材
ICICI BANK LTD	2,271.54	2,368.52	88,949	126,308	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	584.63	202.28	4,403	6,253	石油・ガス・消耗燃料
STATE BANK OF INDIA LTD	1,709.63	945.52	18,272	25,946	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	189.35	66.92	2,522	3,581	陸運・鉄道
LIC HOUSING FINANCE LTD	262.42	144.36	4,009	5,693	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LTD	301.06	138.26	4,055	5,759	金属・鉱業
TATA MOTORS LTD	1,561.48	581.68	4,470	6,347	自動車
JSW STEEL LTD	834.15	381.77	6,768	9,611	金属・鉱業
TATA POWER CO LTD	1,004.83	371.95	1,279	1,816	電力
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	57.51	33.56	9,504	13,496	食品
NESTLE INDIA LTD	22.5	11.92	20,650	29,323	食品
GAIL INDIA LTD	700.27	979.27	8,784	12,473	ガス
VEDANTA LTD	1,150.72	874.77	7,356	10,446	金属・鉱業
AXIS BANK LTD	1,810.46	1,059.19	50,714	72,013	銀行
TITAN COMPANY LTD	276.48	163.05	15,905	22,585	繊維・アパレル・贅沢品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,226.55	1,078.1	8,225	11,680	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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	–	20.97	2,890	4,104	パーソナル用品
LUPIN LTD	224.53	123.45	10,150	14,413	医薬品
BAJAJ FINANCE LTD	165.95	94.3	21,765	30,907	消費者金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,555.5	808.64	135,900	192,978	貯蓄・抵当・不動産金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	438.7	311.62	4,367	6,201	メディア
INFOSYS LTD	3,320.56	1,672.84	105,179	149,355	情報技術サービス
WIPRO LTD	1,346.1	491.1	9,183	13,040	情報技術サービス
INDIAN OIL CORP LTD	1,682.52	728.1	6,261	8,891	石油・ガス・消耗燃料
HINDUSTAN UNILEVER LTD	615.5	400.78	95,586	135,732	家庭用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	518.18	551.59	25,111	35,657	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	515.6	229.89	11,266	15,999	パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	45.09	41.43	7,606	10,800	自動車
DR REDDYS LABORATORIES LTD	103.89	58.8	23,105	32,810	医薬品
BHARTI AIRTEL LTD	1,351.06	1,217.56	61,176	86,870	無線通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	292.61	175.15	9,283	13,183	飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	813.13	362.94	16,589	23,557	医薬品
DIVI'S LABORATORIES LTD	77.03	43.4	10,121	14,372	ライフサイエンス・ツール／サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	101.11	54.52	30,013	42,618	自動車
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	136.89	–	–	–	医薬品
AUROBINDO PHARMA LTD	262.23	114.18	6,196	8,799	医薬品
HAVELLS INDIA LTD	264.92	156.33	8,263	11,734	電気設備
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	950.48	426.76	3,704	5,260	自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	138.34	37.77	3,029	4,301	消費者金融
PETRONET LNG LTD	528.75	418.74	8,860	12,581	石油・ガス・消耗燃料
CIPLA LTD/INDIA	318.7	187.92	11,237	15,957	医薬品
LARSEN & TOUBRO LTD	456.02	262.27	24,467	34,743	建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	93.55	53.62	18,949	26,908	建設資材
ASHOK LEYLAND LTD	1,108.86	500.57	2,447	3,475	機械
BOSCH LTD	6.87	2.22	2,384	3,385	自動車部品
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	853.92	439.12	79,313	112,625	情報技術サービス
NTPC LTD	2,100.66	1,142.12	10,907	15,488	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	74.74	55.89	4,989	7,084	医薬品
YES BANK LTD	1,622.58	–	–	–	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	546.35	468.06	8,095	11,495	建設資材
BHARAT FORGE LTD	184.21	76.44	2,169	3,080	自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,161.35	561.31	6,968	9,895	金属・鉱業
ITC LTD	3,281.99	1,760.58	33,116	47,025	タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	116.66	71.98	10,588	15,035	化学
UNITED PHOSPHORUS LTD	348.38	301.31	10,946	15,544	化学
SIEMENS INDIA LTD	–	26.78	3,207	4,554	コングロマリット
INFO EDGE INDIA LTD	–	21.51	5,348	7,594	インタラクティブ・メディアおよびサービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	328.23	156.95	8,675	12,319	パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	455.27	204.62	10,432	14,814	情報技術サービス
VODAFONE IDEA LTD	1,965.27	–	–	–	無線通信サービス
MARICO LTD	456.6	282.57	8,481	12,043	パーソナル用品
PAGE INDUSTRIES LTD	5.28	1.91	3,272	4,646	繊維・アパレル・贅沢品
DLF LTD	–	240.13	3,287	4,668	不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,710.78	959.97	16,103	22,866	電力
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	508.92	354.33	9,501	13,491	運送インフラ
REC LTD	551.73	263.09	2,512	3,567	各種金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD	37.23	21.74	10,869	15,434	保険
BAJAJ AUTO LTD	79.67	33.92	8,070	11,459	自動車
COAL INDIA LTD	1,124.57	544.64	8,101	11,504	石油・ガス・消耗燃料
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	289.33	86.21	1,550	2,201	消費者金融
BHARTI INFRATEL LTD	322.96	140.7	2,367	3,362	各種電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	254.66	–	–	–	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	23.33	23.33	77	109	金属・鉱業

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)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	–	216.72	10,738	15,248	保険
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	–	25.14	6,729	9,556	資本市場
BANDHAN BANK LTD	–	99.23	2,146	3,047	銀行
BERGER PAINTS INDIA LTD	–	79.54	4,102	5,825	化学
CADILA HEALTHCARE LTD	169.62	–	–	–	医薬品
AVENUE SUPERMARTS LTD	112.16	65.1	14,400	20,449	食品・生活必需品小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	–	79.31	9,512	13,507	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	–	115.66	4,278	6,075	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	83	36.35	3,883	5,514	旅客航空輸送業
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	–	149.7	10,515	14,932	保険
小計 株数・金額	54,947.24	30,432.72	1,513,188	2,148,727	
小計 銘柄数<比率>	79銘柄	85銘柄	–	<5.2%>	
(パキスタン)	百株	百株	千パキスタン・ルピー	千円	
MCB BANK LTD	390	124	1,909	1,241	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	745	218.68	2,106	1,369	石油・ガス・消耗燃料
HABIB BANK LTD	544	193	2,035	1,322	銀行
小計 株数・金額	1,679	535.68	6,051	3,933	
小計 銘柄数<比率>	3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	
BARITO PACIFIC TBK PT	–	14,625	1,447,875	10,135	化学
UNITED TRACTORS TBK PT	1,670.01	1,039.01	1,800,084	12,600	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	4,588	2,769	1,730,625	12,114	食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,375	3,608	2,480,500	17,363	家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	19,392	10,655	4,048,900	28,342	自動車
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	47,363	24,831	8,020,413	56,142	各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	6,756	2,440	1,034,560	7,241	食品
GUDANG GARAM TBK PT	448	158	726,800	5,087	タバコ
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	7,955	4,563	746,050	5,222	タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	1,803	1,098	1,205,055	8,435	建設資材
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	2,620	1,428	742,560	5,197	紙製品・林産品
BUKIT ASAM TBK PT	2,567	2,300	455,400	3,187	石油・ガス・消耗燃料
BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	2,613.16	–	–	–	銀行
BANK MANDIRI	17,900	9,617	4,212,246	29,485	銀行
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	980	868	457,870	3,205	紙製品・林産品
BANK RAKYAT INDONESIA	52,904	27,728	7,847,024	54,929	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	10,641	4,772	398,462	2,789	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	7,244	4,400	1,830,400	12,812	銀行
KALBE FARMA TBK PT	18,222	13,344	1,594,608	11,162	医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	2,765	1,009	653,327	4,573	建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	9,338	4,753	12,892,512	90,247	銀行
XL AXIATA TBK PT	–	355	85,200	596	無線通信サービス
JASA MARGA PERSERO TBK PT	2,001.25	416.25	121,545	850	運送インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT	7,465	6,631	527,164	3,690	不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT	14,345	6,845	708,457	4,959	石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK	16,599	2,185	92,644	648	不動産管理・開発
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	2,385	774	789,480	5,526	食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	1,808	–	–	–	各種電気通信サービス
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	4,803	1,579	151,584	1,061	銀行
ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	–	1,104	147,936	1,035	専門小売り
PT SURYA CITRA MEDIA TBK	5,113	–	–	–	メディア
小計 株数・金額	273,663.42	155,894.26	56,949,284	398,644	
小計 銘柄数<比率>	28銘柄	28銘柄	–	<1.0%>	
(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	1,361.45	630.16	218	6,433	銀行
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	1,648.45	876.04	1,289	37,937	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	2,010.06	1,545.32	673	19,822	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,589.74	1,363.91	1,579	46,466	銀行

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	
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,431.66	2,271.65	572	16,841	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	3,561.42	1,419.95	214	6,308	不動産管理・開発
EMAAR DEVELOPMENT PJSC	774.63	–	–	–	不動産管理・開発
EMAAR MALLS PJSC	1,781.66	953.55	107	3,170	不動産管理・開発
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	1,902.35	–	–	–	不動産管理・開発
小計 株数・金額	19,061.42	9,060.58	4,655	136,979	
小計 銘柄数<比率>	9銘柄	7銘柄	–	<0.3%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
BRF SA	474.92	325.92	620	12,790	食品
VALE SA	3,005.21	1,557.21	6,851	141,145	金属・鉱業
RAIA DROGASIL SA	206	120	1,246	25,686	食品・生活必需品小売り
TIM PARTICIPACOES SA	763	483	628	12,954	無線通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	238.5	94.5	277	5,711	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	198	178	461	9,515	電力
BANCO DO BRASIL SA	847	439	1,298	26,750	銀行
INVESTIMENTOS ITAU SA	4,323.6	2,183.6	1,995	41,113	銀行
LOJAS AMERICANAS SA	770.74	318.74	693	14,281	複合小売り
GERDAU SA	1,010.3	495.3	609	12,549	金属・鉱業
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	158.06	–	–	–	食品・生活必需品小売り
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	–	65.06	416	8,577	食品・生活必需品小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,782.1	1,839.1	3,071	63,268	石油・ガス・消耗燃料
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	328	382	703	14,487	専門小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	3,774.12	2,056.12	3,316	68,320	石油・ガス・消耗燃料
COGNA EDUCACAO	1,373.68	642.47	323	6,670	各種消費者サービス
CCR SA	1,214.2	539.2	684	14,095	運送インフラ
WEG SA	900.72	424.72	1,633	33,649	電気設備
BANCO BRADESCO SA PREF	3,505.5	2,168.85	4,415	90,965	銀行
BANCO BRADESCO SA	997.41	600.25	1,132	23,333	銀行
NATURA COSMETICOS SA	198	–	–	–	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	617.06	195.06	148	3,049	金属・鉱業
SUZANO SA	523.75	282.75	1,013	20,875	紙製品・林産品
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4,639.47	2,352.47	5,462	112,526	銀行
PORTO SEGURO SA	88	46	214	4,428	保険
B2W CIA DIGITAL	162	91	562	11,585	インターネット販売・通信販売
BRASKEM SA	157.3	103.3	216	4,468	化学
ENGIE BRASIL SA	211.87	110.87	444	9,147	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LOCALIZA RENT A CAR	584.8	272.89	874	18,005	陸運・鉄道
TELEFONICA BRASIL S.A.	434.28	228.28	1,092	22,511	各種電気通信サービス
LOJAS RENNER SA	713.7	433.37	1,625	33,477	複合小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	358.52	442.04	621	12,793	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	162	101	540	11,131	石油・ガス・消耗燃料
EQUATORIAL ENERGIA SA	177	417	792	16,321	電力
EMBRAER SA	656.6	211.6	202	4,162	航空宇宙・防衛
M DIAS BRANCO SA	104	–	–	–	食品
BR MALLS PARTICIPACOES SA	765.65	294.65	282	5,820	不動産管理・開発
JBS SA	900	453	965	19,886	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	794.49	549.49	557	11,477	電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	338.98	182.98	771	15,895	水道
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	344.4	206.4	432	8,907	不動産管理・開発
SUL AMERICA SA	178.69	–	–	–	保険
HYPERA SA	365	211	661	13,630	医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	1,987.16	1,013.16	4,005	82,503	資本市場
MAGAZINE LUIZA SA	75	375	1,672	34,445	複合小売り
BANCO SANTANDER BRASIL SA	408	–	–	–	銀行
CIELO SA	1,113.07	465.07	210	4,339	情報技術サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	689	296	767	15,804	保険
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	–	251	1,395	28,748	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	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	–	122	639	13,169	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	373	163	332	6,849	食品・生活必需品小売り
AMBEV SA	4,481.95	2,326.95	2,699	55,604	飲料
KLABIN SA	648	–	–	–	容器・包装
NATURA &CO HOLDING SA	–	345	1,150	23,694	パーソナル用品
RUMO SA	1,080	571	1,155	23,807	陸運・鉄道
IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	137	250	298	6,138	保険
小計 株数・金額	51,338.8	28,276.37	62,188	1,281,077	
小計 銘柄数<比率>	52銘柄	50銘柄	–	<3.1%>	
(チェコ)	百株	百株	千チェコ・コルナ	千円	
KOMERCNI BANKA AS	71.13	46.48	2,486	10,692	銀行
CEZ	150.14	80.01	3,760	16,170	電力
MONETA MONEY BANK AS	551.83	209.73	1,098	4,725	銀行
小計 株数・金額	773.1	336.22	7,346	31,588	
小計 銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄	–	<0.1%>	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
CHEIL WORLDWIDE INC	75.51	33.54	56,850	5,042	メディア
HANMI SCIENCE CO LTD	11.87	–	–	–	医薬品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	31.24	15.15	95,899	8,506	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	29.4	13.75	263,312	23,355	保険
DB INSURANCE CO LTD	48.71	16.28	61,375	5,444	保険
COWAY CO LTD	50.7	27.6	170,292	15,104	家庭用耐久財
KT&G CORP	113.07	59.33	462,774	41,048	タバコ
S-1 CORPORATION	14.44	4.87	40,761	3,615	商業サービス・用品
KOREA GAS CORP	24.69	26.07	70,128	6,220	ガス
CJ CORP	16.95	3.09	22,309	1,978	コングロマリット
KAKAO CORP	48.62	25.98	446,856	39,636	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	5.63	63,337	5,618	インターネット販売・通信販売
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	26.34	31.83	52,837	4,686	機械
KMW CO LTD	–	8.63	55,922	4,960	通信機器
SK TELECOM CO LTD	18.59	10.13	201,587	17,880	無線通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO	26.49	16.47	129,618	11,497	建設・土木
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	403.22	223.72	121,703	10,795	資本市場
NCSOFT CORPORATION	16.88	8.24	534,776	47,434	娯楽
LG UPLUS CORP	96.56	115.51	140,344	12,448	各種電気通信サービス
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	135.4	50.23	16,852	1,494	建設・土木
POSCO INTERNATIONAL CORP	36	16.34	21,650	1,920	商社・流通業
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	8.96	4.74	592,026	52,512	パーソナル用品
LG CHEM LTD	43.91	22.58	818,525	72,603	化学
LG CHEM LTD	7.26	3.54	61,242	5,432	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	2.01	0.78	52,650	4,670	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	407.81	225.41	642,418	56,982	銀行
S-OIL CORP	43.83	25.95	174,384	15,467	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	82.89	32.34	46,569	4,130	化学
MERITZ SECURITIES CO LTD	–	134.12	40,437	3,586	資本市場
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	59.97	25.6	73,856	6,551	資本市場
POSCO CHEMICAL CO LTD	21.26	6.83	35,584	3,156	建設資材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	16.77	8.37	162,378	14,402	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	28.26	10.53	81,818	7,257	専門小売り
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	38.44	18.35	150,470	13,346	機械
HYUNDAI MOBIS	64.84	32.73	587,503	52,111	自動車部品
SK HYNIX INC	554.2	267.27	2,247,740	199,374	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	74.08	42.68	141,484	12,549	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	19.54	7.44	44,714	3,966	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	135.32	76.24	766,212	67,963	自動車
HYUNDAI STEEL CO	71.94	44.76	88,401	7,841	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	226.06	158.08	124,567	11,049	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
KCC CORP	5.54	4.02	57,888	5,134	化学
KIA MOTORS CORP	251.7	132.1	394,979	35,034	自動車
KOREA ZINC CO LTD	8.38	4.27	172,508	15,301	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	247.64	129.26	266,275	23,618	電力
HANWHA CORP	37.85	18.37	33,708	2,989	コングロマリット
KOREAN AIR CO LTD	43.87	8.79	18,371	1,629	旅客航空輸送業
OCI COMPANY LTD	18.29	5.28	20,882	1,852	化学
CJ LOGISTICS	8.6	4.33	63,867	5,665	陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	15.09	12.71	84,140	7,463	化学
KT CORP	20.48	–	–	–	各種電気通信サービス
HLB INC	29.94	17.32	182,206	16,161	レジャー用品
LG ELECTRONICS INC	102.93	46.01	250,754	22,241	家庭用耐久財
LOTTE CORP	28.1	21.83	59,923	5,315	コングロマリット
LG CORP	92.19	46.92	291,373	25,844	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	133.62	51.45	46,870	4,157	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	60.04	25.23	59,795	5,303	建設・土木
NAVER CORP	133.74	68.85	1,232,415	109,315	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	12.49	2.34	15,420	1,367	複合小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	42.91	21.33	104,730	9,289	資本市場
OTTOGI CORP	1.12	1.21	64,856	5,752	食品
AMOREPACIFIC GROUP	27.61	8.4	52,500	4,656	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	106.55	65.2	162,674	14,429	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	74.46	38.29	673,904	59,775	金属・鉱業
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	144.49	47.34	54,204	4,807	建設・土木
SAMSUNG SDI CO LTD	52.65	27.24	780,426	69,223	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	54.55	28.89	329,346	29,212	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,532.55	2,336.06	12,007,348	1,065,051	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	391.72	242.94	105,314	9,341	機械
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	782.05	403.27	1,776,404	157,567	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	6.46	4.13	104,282	9,249	複合小売り
YUHAN CORP	9.51	27.09	126,510	11,221	医薬品
HANON SYSTEMS	171.56	110.87	101,113	8,968	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	56.67	30.18	74,091	6,571	保険
GS HOLDINGS CORP	47.51	21.16	82,100	7,282	石油・ガス・消耗燃料
LG DISPLAY CO LTD	228.49	108.38	124,637	11,055	電子装置・機器・部品
CELLTRION INC	79.64	46.63	983,893	87,271	バイオテクノロジー
HELIXMITH CO LTD	11.9	9.58	81,621	7,239	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL GROUP	289.14	154.1	381,397	33,829	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	18	7.41	77,434	6,868	航空貨物・物流サービス
CELLTRION PHARM INC	14.57	–	–	–	医薬品
LOTTE SHOPPING CO	10.03	5.5	47,630	4,224	複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	67.76	37.37	181,431	16,092	保険
AMOREPACIFIC CORP	31.23	16.57	299,088	26,529	パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	8.48	3.68	23,588	2,092	パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	28.77	8.75	25,375	2,250	消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	61.75	24.96	243,859	21,630	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	8.58	4.84	114,708	10,174	食品
STX PAN OCEAN CO LTD	183.95	215.02	70,096	6,217	海運業
LG INNOTEK CO LTD	14.4	6.98	92,485	8,203	電子装置・機器・部品
SK HOLDINGS CO LTD	30.8	15.27	287,839	25,531	コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	380.76	196.69	636,292	56,439	銀行
MEDY-TOX INC	4.21	2.29	43,739	3,879	バイオテクノロジー
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	66.02	45.7	103,282	9,161	航空宇宙・防衛
BNK FINANCIAL GROUP INC	249.23	214.32	102,873	9,124	銀行
HANMI PHARM CO LTD	6.53	4.16	108,992	9,667	医薬品
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	284.68	113.69	20,634	1,830	保険
FILA HOLDINGS CORP	43.1	24.24	80,719	7,159	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
E-MART CO LTD	18.78	11.97	138,253	12,263	食品・生活必需品小売り
DGB FINANCIAL GROUP INC	163.21	–	–	–	銀行
GS RETAIL CO LTD	24.82	8.21	26,148	2,319	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	65.9	47.69	102,056	9,052	自動車部品
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	24.82	12.33	23,242	2,061	建設・土木
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDIMGS CO LTD	8.63	5.76	134,496	11,929	機械
BGF RETAIL CO LTD	6.31	2.53	38,203	3,388	食品・生活必需品小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	20.71	13.23	155,452	13,788	食品
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	27.63	–	–	–	保険
NETMARBLE CORP	22.91	8.62	83,096	7,370	娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	443.48	246.32	202,475	17,959	銀行
SAMSUNG SDS CO LTD	33.52	15.37	252,068	22,358	情報技術サービス
SAMSUNG C&T CORP	73.94	41.71	399,998	35,479	コングロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	15.63	8.24	466,384	41,368	ライフサイエンス・ツール／サービス
PEARL ABYSS CORP	5.34	3.14	64,935	5,759	娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	36.36	9.89	22,203	1,969	機械
SILLAJEN INC	53.19	–	–	–	バイオテクノロジー
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	44.6	27.41	220,924	19,596	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	14,106.56	7,601.96	36,274,914	3,217,584	
小計 銘柄数<比率>	114銘柄	110銘柄	–	<7.8%>	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
EVE ENERGY CO LTD	–	27	170	2,599	電気設備
LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	–	173	135	2,072	化学
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	–	54	139	2,121	電子装置・機器・部品
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	–	30	180	2,757	飲料
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	–	35	155	2,374	金属・鉱業
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	–	323	160	2,451	化学
UNISPLENDOUR CORP LTD	–	56	210	3,208	電子装置・機器・部品
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	–	12	92	1,407	ライフサイエンス・ツール／サービス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	–	3	166	2,537	医薬品
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	–	81	154	2,354	機械
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	–	52	223	3,402	娯楽
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	–	238	136	2,078	保険
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	–	66	126	1,932	家庭用耐久財
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	–	103	386	5,897	建設資材
GEM CO LTD	–	291	137	2,097	金属・鉱業
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	–	69	252	3,843	バイオテクノロジー
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	–	36	135	2,060	電子装置・機器・部品
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	–	59.04	178	2,720	家庭用耐久財
ZHEJIANG NHU CO LTD	–	42	118	1,803	医薬品
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	–	19	67	1,022	医薬品
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	–	18	61	943	電子装置・機器・部品
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	–	142	319	4,869	情報技術サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	–	154	386	5,883	情報技術サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	–	37	152	2,322	食品
VENUSTECH GROUP INC	–	95	366	5,587	ソフトウェア
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	–	76	942	14,358	食品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	–	37	287	4,379	バイオテクノロジー
GLODON CO LTD	–	23	105	1,607	ソフトウェア
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	–	112	130	1,988	コンピュータ・周辺機器
NAVINFO CO LTD	–	218	325	4,956	家庭用耐久財
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	–	143	115	1,767	不動産管理・開発
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	–	120	261	3,986	医薬品
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	–	60	292	4,459	バイオテクノロジー
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	–	96	114	1,742	化学
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	–	53	315	4,803	半導体・半導体製造装置
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	–	35.7	133	2,029	コンピュータ・周辺機器

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	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	－	127	136	2,076	コンピュータ・周辺機器
O-FILM TECH CO LTD	－	86	127	1,950	電子装置・機器・部品
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	－	86	370	5,647	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	－	184	365	5,571	電子装置・機器・部品
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	－	69	269	4,100	ヘルスケア機器・用品
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	－	382	223	3,399	機械
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	－	67	263	4,013	医薬品
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	－	153	185	2,833	通信機器
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	－	50	126	1,927	エネルギー設備・サービス
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	－	66	239	3,655	娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	－	68	532	8,117	飲料
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	－	74	219	3,349	機械
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	－	149.5	122	1,870	食品
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	－	177	147	2,252	資本市場
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	－	213	339	5,174	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	－	33	89	1,362	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	－	38	112	1,714	ソフトウェア
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	－	160	128	1,950	不動産管理・開発
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	－	21	247	3,773	資本市場
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	96	198.5	835	12,732	電子装置・機器・部品
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	263	269	116	1,775	メディア
NEW HOPE LIUHE CO LTD	－	111	362	5,526	食品
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	－	65	109	1,666	電子装置・機器・部品
DHC SOFTWARE CO LTD	－	262	351	5,350	情報技術サービス
IFLYTEK CO LTD	64	75	259	3,958	ソフトウェア
GOERTEK INC	－	105	200	3,062	電子装置・機器・部品
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	－	374	372	5,682	商業サービス・用品
BANK OF NINGBO CO LTD	－	126	292	4,458	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD	－	43	72	1,106	電子装置・機器・部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	－	474	218	3,330	家庭用耐久財
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	－	568	365	5,574	資本市場
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	－	376	238	3,638	ホテル・レストラン・レジャー
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	－	122	121	1,844	自動車
WESTERN SECURITIES CO LTD	－	423	342	5,215	資本市場
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	－	79	315	4,803	食品
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	23	30	255	3,894	医薬品
AVIC AIRCRAFT CO LTD	－	107	185	2,824	航空宇宙・防衛
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	－	202	356	5,430	資本市場
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	25	30	269	4,103	飲料
WULIANGYE YIBIN CO LTD	72	123	1,584	24,147	飲料
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	－	208	169	2,580	バイオテクノロジー
SUNING.COM CO LTD	295	291	257	3,924	専門小売り
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	799	791	307	4,689	電子装置・機器・部品
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	123	192	322	4,909	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	57	107	585	8,919	家庭用耐久財
MIDEA GROUP CO LTD	80	－	－	－	家庭用耐久財
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	120	322	973	14,839	電子装置・機器・部品
GUOSEN SECURITIES CO LTD	－	170	185	2,826	資本市場
PING AN BANK CO LTD	272	670	863	13,161	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	－	121	372	5,677	食品
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	790	657	289	4,415	資本市場
CHINA VANKE CO LTD	137	373	996	15,189	不動産管理・開発
ZTE CORP	－	97	388	5,913	通信機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	－	405	260	3,968	機械
WEICHAI POWER CO LTD	299	220	295	4,509	機械
GF SECURITIES CO LTD	227	183	254	3,873	資本市場
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	－	62	61	942	電気設備

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	
BYD CO LTD	75	100	588	8,961	自動車
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	－	110	170	2,605	化学
NANJI E-COMMERCE CO LTD	－	129	178	2,726	メディア
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	－	12	164	2,500	電子装置・機器・部品
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	－	37	185	2,830	娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	－	12	152	2,328	飲料
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	－	120	143	2,192	化学
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	－	42	287	4,377	家庭用耐久財
YUNDA HOLDING CO LTD	－	54	168	2,569	航空貨物・物流サービス
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	－	338	95	1,462	半導体・半導体製造装置
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	－	151	172	2,632	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
SF HOLDING CO LTD	－	50	243	3,707	航空貨物・物流サービス
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	－	65	147	2,240	化学
BANK OF SHANGHAI CO LTD	209	655.9	543	8,286	銀行
CSC FINANCIAL CO LTD	－	63	220	3,354	資本市場
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	－	171	236	3,609	化学
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	－	236	160	2,438	銀行
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	－	43.2	147	2,249	金属・鉱業
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	－	95	147	2,251	食品
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	－	5	115	1,754	電子装置・機器・部品
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	－	29	329	5,020	ヘルスケア機器・用品
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	－	16	204	3,117	バイオテクノロジー
CAITONG SECURITIES CO LTD	－	127	124	1,894	資本市場
BANK OF CHENGDU CO LTD	－	270	203	3,094	銀行
NANJING SECURITIES CO LTD	－	98	145	2,217	資本市場
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	－	144	201	3,070	電子装置・機器・部品
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	－	34	881	13,432	ヘルスケア機器・用品
HUAXI SECURITIES CO LTD	－	155	164	2,511	資本市場
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	－	11	192	2,930	ソフトウェア
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	－	41	561	8,557	電気設備
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	－	6	161	2,459	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTEC CO LTD	－	32	316	4,817	ライフサイエンス・ツール／サービス
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	－	25	247	3,768	電子装置・機器・部品
WILL SEMICONDUCTOR LTD	－	14	246	3,750	半導体・半導体製造装置
PETROCHINA CO LTD	328	128	58	887	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	755	1,633	840	12,816	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	825	2,306	793	12,089	銀行
BANK OF CHINA LTD	745	840	300	4,582	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	513	351	160	2,439	石油・ガス・消耗燃料
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	－	100	280	4,276	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	－	61	97	1,490	石油・ガス・消耗燃料
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	315	647	2,126	32,400	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	195	339	2,454	37,404	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD	274	653	1,048	15,982	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	367	948	966	14,736	銀行
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	733.2	1,399	810	12,344	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD	109	175	332	5,067	自動車
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	18	37	4,536	69,131	飲料
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	792	1,232	639	9,744	銀行
CITIC SECURITIES CO LTD	316	404	944	14,394	資本市場
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	109	165	483	7,367	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	－	383	165	2,521	運送インフラ
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	265	628	1,075	16,385	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DAQIN RAILWAY CO LTD	301	661	452	6,900	陸運・鉄道
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	608	1,598	576	8,791	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	616	1,467	773	11,782	建設・土木
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	－	736	312	4,755	機械

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
HAITONG SECURITIES CO LTD	360	242	316	4,820	資本市場
HUAXIA BANK CO LTD	232	229	148	2,261	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	104	228	682	10,406	食品
BANK OF BEIJING CO LTD	428	880	420	6,410	銀行
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	−	795	420	6,409	無線通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	292	407	200	3,057	金属・鉱業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	165	107	622	9,492	建設資材
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	228	157	280	4,280	資本市場
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	204	246	389	5,930	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD	847	1,101	699	10,654	機械
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	102	138	1,333	20,316	医薬品
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	−	366	332	5,064	金属・鉱業
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	274	298	294	4,487	建設・土木
HUATAI SECURITIES CO LTD	236	197	357	5,449	資本市場
CHINA RAILWAY GROUP LTD	−	497	290	4,423	建設・土木
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	−	71	302	4,617	保険
HAIER SMART HOME CO LTD	−	286	423	6,459	家庭用耐久財
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	211	333	652	9,946	機械
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	−	618	126	1,921	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	110	36	128	1,952	医薬品
GEMDALE CORP	−	106	145	2,222	不動産管理・開発
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	−	75	161	2,459	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	−	71	313	4,773	化学
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	−	99	211	3,228	不動産管理・開発
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GROUP CO LTD	−	384	350	5,343	メディア
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	−	700	289	4,405	金属・鉱業
FOUNDER SECURITIES CO LTD	310	159	112	1,710	資本市場
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	−	120	92	1,406	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NARI TECHNOLOGY CO LTD	−	145	305	4,653	電気設備
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	−	298	158	2,420	エネルギー設備・サービス
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	39	82	666	10,159	専門小売り
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	−	1,739	198	3,021	金属・鉱業
TSINGTAO BREWERY CO LTD	−	73	339	5,178	飲料
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LTD	−	669	232	3,537	運送インフラ
AVIC CAPITAL CO LTD	498	322	126	1,933	各種金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	−	658	191	2,918	金属・鉱業
AIR CHINA LTD	−	284	193	2,951	旅客航空輸送業
TBEA CO LTD	−	457	360	5,495	電気設備
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	−	425	260	3,976	建設・土木
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	1,512	336	88	1,341	建設・土木
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	954	264	99	1,512	建設・土木
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	−	33	223	3,405	運送インフラ
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	−	69	217	3,320	医薬品
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	−	84	175	2,675	自動車部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD	−	148	142	2,167	資本市場
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	−	48	57	877	化学
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	237	237	209	3,196	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	99	187	365	5,577	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	93	211	3,228	航空宇宙・防衛
BANK OF NANJING CO LTD	−	156	116	1,773	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	160	76	133	2,037	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	−	618	220	3,362	金属・鉱業
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	532	282	172	2,630	資本市場
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	64	106	267	4,082	医薬品
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	80	68	247	3,764	金属・鉱業
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	−	76	189	2,889	電気設備
BBMG CORP	−	542	178	2,725	建設資材

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	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	240	294	303	4,632	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO LTD	−	186	160	2,443	石油・ガス・消耗燃料
SHENERGY CO LTD	−	464	249	3,797	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	−	882	375	5,726	旅客航空輸送業
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	−	150.19	133	2,041	電気設備
AISINO CORP	64	103	197	3,017	ソフトウェア
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	−	18	171	2,611	ソフトウェア
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	−	65	293	4,466	ソフトウェア
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	665	327	171	2,611	旅客航空輸送業
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	−	1,068	350	5,338	建設・土木
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	−	17	32	498	自動車部品
XIAMEN C & D INC	−	304	233	3,553	商社・流通業
AVIC HELICOPTER CO LTD	−	46	203	3,095	航空宇宙・防衛
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	−	168	133	2,027	資本市場
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	−	850	218	3,329	化学
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	−	140	127	1,945	電気設備
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	18	17	229	3,493	医薬品
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	−	17	165	2,524	飲料
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	−	114	369	5,637	通信機器
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD	−	157	123	1,875	各種金融サービス
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	−	1,602	334	5,102	金属・鉱業
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	−	129	97	1,490	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	−	126	137	2,094	電気設備
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	−	119	168	2,573	運送インフラ
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	−	45	130	1,986	電子装置・機器・部品
TONGWEI CO LTD	−	116	148	2,266	食品
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	−	53	140	2,135	ホテル・レストラン・レジャー
CHINA RAILWAY HI-TECH INDUSTRY CO LTD	−	228	226	3,446	建設・土木
CHINA JUSHI CO LTD	−	234	198	3,031	建設資材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	−	53	358	5,466	機械
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	81	67	112	1,717	通信機器
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	−	65	187	2,864	半導体・半導体製造装置
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	−	323.51	244	3,722	石油・ガス・消耗燃料
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	−	74	932	14,204	食品
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	−	124	252	3,847	自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	−	58	176	2,694	電気設備
DONGXING SECURITIES CO LTD	−	132	144	2,202	資本市場
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	−	128	125	1,911	旅客航空輸送業
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	−	215	360	5,488	資本市場
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	513	214	95	1,451	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HUAAN SECURITIES CO LTD	−	165	123	1,880	資本市場
BANK OF JIANGSU CO LTD	324	218	129	1,966	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD	−	236	183	2,794	銀行
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	−	12	319	4,871	半導体・半導体製造装置
SDIC CAPITAL CO LTD	−	65	79	1,210	資本市場
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SERVICES CO LTD	−	351	126	1,920	専門小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	−	21	141	2,162	機械
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	248	449	423	6,459	資本市場
SPRING AIRLINES CO LTD	−	75	263	4,018	旅客航空輸送業
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	240	160	179	2,738	資本市場
DAWNING INFORMATION INDUSTRY CO LTD	−	75	345	5,260	コンピュータ・周辺機器
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	−	292	160	2,447	不動産管理・開発
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	−	106	335	5,111	不動産管理・開発
小計 株数・金額	22,976.2	64,044.54	82,257	1,253,600	
小計 銘柄数<比率>	73銘柄	259銘柄	−	<3.0%>	
(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	1,345	844	261	6,454	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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
GENTING PLANTATIONS BHD	375	141	135	3,349	食品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	4,651	2,774	1,006	24,841	銀行
DIGI.COM BHD	2,887	1,208	553	13,649	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	1,014.2	588.2	299	7,400	運送インフラ
RHB BANK BHD	777.8	577.8	277	6,842	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	632	344	248	6,135	コングロマリット
TOP GLOVE CORP BHD	1,338	563	382	9,444	ヘルスケア機器・用品
GAMUDA BHD	1,946	696	225	5,563	建設・土木
GENTING BHD	2,117	1,367	539	13,320	ホテル・レストラン・レジャー
YTL CORP BHD	2,837.1	1,070.1	81	2,019	総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	202.56	87.56	117	2,894	銀行
HONG LEONG BANK BHD	624.08	237.08	325	8,036	銀行
IJM CORP BHD	2,303.6	1,080.6	189	4,665	建設・土木
IOI CORP BHD	1,872.13	1,222.13	488	12,059	食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	445	265	560	13,820	食品
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	128	88	277	6,842	飲料
MALAYAN BANKING BHD	3,662.75	1,785.75	1,375	33,921	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	884	–	–	–	銀行
MISC BHD	902.8	561.8	444	10,962	海運業
NESTLE MALAYSIA BHD	48	29	402	9,930	食品
PPB GROUP BHD	475.6	262.6	439	10,844	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	196	208	437	10,786	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	604	394	610	15,065	ガス
GENTING MALAYSIA BHD	2,986	1,396	311	7,679	ホテル・レストラン・レジャー
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	147	–	–	–	タバコ
TELEKOM MALAYSIA BHD	1,034	567	224	5,539	各種電気通信サービス
SP SETIA BHD	1,367	–	–	–	不動産管理・開発
TENAGA NASIONAL BHD	3,046.5	1,524.5	1,936	47,763	電力
QL RESOURCES BHD	538	372	303	7,479	食品
DIALOG GROUP BHD	3,205.44	1,504.44	491	12,136	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	2,762.3	1,545.3	2,478	61,148	銀行
AIRASIA GROUP BHD	1,479	555	43	1,074	旅客航空輸送業
CARLSBERG BREWERY-MALAY BHD	–	70	197	4,869	飲料
SIME DARBY BERHAD	2,296	1,531	283	6,987	コングロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,171	765	587	14,494	ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD	2,746	1,528	582	14,362	無線通信サービス
MAXIS BHD	2,384	910	496	12,257	無線通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,331	1,323	747	18,440	化学
IHH HEALTHCARE BHD	2,137	1,148	599	14,783	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,092	145	56	1,402	運送インフラ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	1,240	880	340	8,401	金属・鉱業
SIME DARBY PROPERTY BHD	2,327	–	–	–	不動産管理・開発
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,161	876	425	10,502	食品
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	1,745.48	–	–	–	不動産管理・開発
小計 株数・金額	70,464.34	33,034.86	19,788	488,177	
小計 銘柄数<比率>	44銘柄	40銘柄	–	<1.2%>	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
BIDVEST GROUP LTD	334.72	159.91	2,299	13,221	コングロマリット
CLICKS GROUP LTD	224.23	108.58	2,924	16,813	食品・生活必需品小売り
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	453.11	–	–	–	専門小売り
DISCOVERY LTD	358.24	226.58	1,910	10,982	保険
REDEFINE PROPERTIES LTD	5,458.11	–	–	–	エクイティ不動産投資信託（ＲＥＩＴｓ）
GOLD FIELDS LTD	699.36	437.64	5,263	30,267	金属・鉱業
REMGRO LTD	506.21	228.62	2,989	17,191	各種金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	198.73	75.72	588	3,386	専門小売り
NORTHAM PLATINUM LTD	–	126.32	1,090	6,271	金属・鉱業
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	808.77	395.05	662	3,811	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
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	2,898.26	–	–	–	エクイティ不動産投資信託（ＲＥＩＴｓ）
EXXARO RESOURCES LTD	248.46	79.98	912	5,247	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	37.04	26.28	2,390	13,747	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	114.38	54.22	366	2,109	保険
MTN GROUP LTD	1,626.78	867.7	4,577	26,318	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	405.22	216.67	8,933	51,367	金属・鉱業
TELKOM SA SOC LTD	220.8	74.7	157	904	各種電気通信サービス
FIRSTRAND LTD	3,195.17	1,694.08	6,381	36,694	各種金融サービス
PSG GROUP LTD	149.38	49.09	691	3,975	各種金融サービス
NASPERS LTD	416.43	217.22	60,290	346,669	インターネット販売・通信販売
NEDBANK GROUP LTD	387.61	213.34	2,016	11,592	銀行
NETCARE LTD	1,054.65	–	–	–	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	312.55	149.15	901	5,180	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	611.74	412	2,060	11,845	各種金融サービス
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	50.42	30.72	2,790	16,045	金属・鉱業
SAPPI LTD	538.82	–	–	–	紙製品・林産品
SASOL LTD	537.28	228.48	1,316	7,567	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	433.8	192.18	2,286	13,147	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	234.11	148.01	1,938	11,148	専門小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,235.96	649.38	6,710	38,582	銀行
SPAR GROUP LTD/THE	200.38	80.76	1,493	8,588	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	880.09	611.53	1,847	10,622	複合小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	345.76	206.4	2,301	13,232	医薬品
ABSA GROUP LTD	698.64	307.37	2,560	14,722	銀行
TIGER BRANDS LTD	159.65	72.48	1,294	7,442	食品
SANLAM LTD	1,713.29	960.98	5,264	30,269	保険
INVESTEC LTD	295.37	252.13	931	5,353	資本市場
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	–	412.26	4,452	25,601	金属・鉱業
KUMBA IRON ORE LTD	53.27	30.74	1,055	6,070	金属・鉱業
MONDI LTD	108.66	–	–	–	紙製品・林産品
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	1,371.82	806.61	1,475	8,482	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
RMI HOLDINGS	555.7	482.13	1,148	6,606	保険
VODACOM GROUP PTY LTD	626.12	323.22	3,899	22,422	無線通信サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC	329.83	151.82	1,381	7,943	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	4,758.87	2,218.19	2,757	15,853	保険
REINET INVESTMENTS SCA	139.93	80.54	2,318	13,328	資本市場
PEPKOR HOLDINGS LTD	–	166.33	189	1,089	専門小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	407.24	249.88	2,264	13,018	メディア
SIBANYE STILLWATER LTD	–	912.18	3,029	17,418	金属・鉱業
FORTRESS REIT LTD-A	1,029.5	–	–	–	エクイティ不動産投資信託（ＲＥＩＴｓ）
BID CORP LTD	323.21	175.18	4,067	23,386	食品・生活必需品小売り
小計 株数・金額	37,747.67	15,562.35	166,181	955,545	
小計 銘柄数<比率>	47銘柄	44銘柄	–	<2.3%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・バーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL	220	235	2,690	8,933	銀行
BERLI JUCKER PCL NVDR	1,236	779	3,096	10,280	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	3,480	1,462	1,578	5,242	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	–	236	1,398	4,642	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ROBINSON PCL-NVDR	388	–	–	–	複合小売り
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	1,739	297	2,056	6,828	銀行
TRUE CORP PCL NVDR	10,747.55	5,859.55	1,933	6,419	各種電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL NVDR	621	352	3,484	11,569	銀行
TMB BANK PCL -NVDR	10,100	13,362	1,202	3,992	銀行
IRPC PCL NVDR	10,609	3,796	979	3,251	石油・ガス・消耗燃料
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	1,720	2,119	1,186	3,939	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	131	164	3,919	13,013	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHIN CORP PCL	–	1,002	4,859	16,134	無線通信サービス

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
(タイ)	百株	百株	千タイ・バーツ	千円	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	3,115	2,092	5,596	18,579	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL	1,019	585	11,407	37,872	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	3,805.2	3,186.2	4,301	14,280	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	442	–	–	–	電子装置・機器・部品
PTT PCL	9,960	5,678	19,447	64,564	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,626	1,464	1,888	6,270	食品
LAND AND HOUSES PCL NVDR	2,639	3,678	2,666	8,852	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL NVDR	338.5	386.5	12,638	41,959	建設資材
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	4,064	2,107	12,325	40,922	運送インフラ
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	1,076	566	5,631	18,697	銀行
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	1,192	1,178	5,831	19,359	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	3,813	4,221	8,737	29,008	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ／ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	324	239	2,820	9,363	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ／ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	2,276.1	1,265.1	2,606	8,652	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR	983	813	3,089	10,256	石油・ガス・消耗燃料
GLOW ENERGY PCL NVDR	540	–	–	–	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CP ALL PCL NVDR	4,812	2,843	18,550	61,587	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	5,313	4,168	4,668	15,498	陸運・鉄道
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	1,329.45	728.45	5,572	18,501	石油・ガス・消耗燃料
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	–	132	531	1,763	無線通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	1,709.22	536.22	1,380	4,584	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,172.08	1,246.08	4,579	15,203	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	1,180	934	3,385	11,240	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	7,678	4,208	3,766	12,503	運送インフラ
B GRIMM POWER PCL NVDR	–	481	1,972	6,547	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	342	1,220	4,178	13,872	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
OSOTSPA PCL NVDR	–	267	1,041	3,457	飲料
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	–	614.33	2,058	6,832	複合小売り
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	–	460	2,357	7,826	消費者金融
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	594	307	1,389	4,612	消費者金融
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	–	255	1,612	5,354	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計 株数・金額	103,334.1	75,522.43	184,419	612,272	
小計 銘柄数<比率>	36銘柄	41銘柄	–	<1.5%>	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
BANK MILLENNIUM SA	497.82	55.36	17	455	銀行
MBANK	13.83	6.68	145	3,763	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	25.96	–	–	–	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	142.94	82.1	594	15,385	金属・鉱業
BANK PEKAO SA	158.87	68.11	371	9,609	銀行
ORANGE POLSKA SA	586	297.77	197	5,099	各種電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	286.43	157.33	963	24,925	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA	1.31	0.57	324	8,405	繊維・アパレル・贅沢品
SANTANDER BANK POLSKA SA	35.15	24.25	380	9,849	銀行
CD PROJEKT RED SA	60.15	34.22	1,161	30,054	娯楽
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	845.54	440.83	966	25,009	銀行
CCC SA	27.63	20.25	93	2,425	繊維・アパレル・贅沢品
GRUPA LOTOS SA	93.85	39.78	257	6,670	石油・ガス・消耗燃料
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	1,650.76	821.78	307	7,946	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA	234.95	124.85	310	8,042	メディア
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	705.29	416.93	186	4,821	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	538.42	309.05	952	24,640	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	53.8	–	–	–	金属・鉱業
ALIOR BANK SA	90.07	–	–	–	銀行
DINO POLSKA SA	47.09	17.97	334	8,646	食品・生活必需品小売り
AMREST HOLDINGS SE	–	44	112	2,902	ホテル・レストラン・レジャー
小計 株数・金額	6,095.86	2,961.83	7,679	198,656	
小計 銘柄数<比率>	20銘柄	18銘柄	–	<0.5%>	

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	
(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		131.04	75.42	48,495	16,095	医薬品
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT		349.34	179.55	37,274	12,371	石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT		214.83	115.07	97,521	32,367	銀行
小計	株数・金額	695.21	370.04	183,291	60,834	
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄	－	<0.1%>	
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA		－	27	30	3,596	建設資材
小計	株数・金額	－	27	30	3,596	
	銘柄数<比率>	－銘柄	1銘柄	－	<0.0%>	
(ユーロ…ギリシャ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ALPHA BANK A.E.		1,257.32	383.28	26	3,056	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		－	263.48	30	3,615	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.		40.89	－	－	－	建設資材
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		220.51	145.18	170	19,953	各種電気通信サービス
FF GROUP		31.3	31.3	0	0	繊維・アパレル・贅沢品
EUROBANK ERGASIAS SERVICES		－	748.45	27	3,212	銀行
MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN		58.47	22.65	31	3,723	石油・ガス・消耗燃料
OPAP SA		198.46	91.84	62	7,355	ホテル・レストラン・レジャー
JUMBO SA		115.02	54.3	75	8,838	専門小売り
小計	株数・金額	1,921.97	1,740.48	424	49,755	
	銘柄数<比率>	7銘柄	8銘柄	－	<0.1%>	
合計	株数・金額	2,324,818.12	1,249,512.59	－	26,646,081	
	銘柄数<比率>	963銘柄	1,180銘柄	－	<64.7%>	

（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。
（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	－	－	－
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		－	9,465	21	70
合計	証券数・金額	59,033	9,465	－	70
	銘柄数<比率>	1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
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコ・ペソ	千円
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D		184.4	96.1	13,229	59,398
GRUPO TELEVISA SAB		−	103.8	2,805	12,597
CEMEX SAB DE CV		1,485.375	688.475	3,476	15,610
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV		−	25	1,548	6,950
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		326.1	184.9	3,555	15,964
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		−	23.3	2,320	10,417
小計	口数・金額	1,995.875	1,121.575	26,935	120,940
	銘柄数<比率>	3銘柄<0.5%>	6銘柄<0.3%>	−	−
(ブラジル)		千口	千口	千ブラジル・レアル	千円
SUL AMERICA SA		−	16.269	706	14,561
BANCO SANTANDER BRASIL SA		−	13.6	360	7,424
ENERGISA SA		−	6.1	261	5,389
KLABIN SA		−	25.2	399	8,228
BANCO BTG PACTUAL SA		−	7.2	291	6,008
小計	口数・金額	−	68.369	2,020	41,612
	銘柄数<比率>	−銘柄<−%>	5銘柄<0.1%>	−	−
(南アフリカ)		千口	千口	千南アフリカ・ランド	千円
REDEFINE PROPERTIES LTD		−	152.868	400	2,302
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		−	195.763	2,736	15,736
HYPROP INVESTMENTS LTD		22.174	−	−	−
FORTRESS REIT LTD		−	54.518	601	3,460
FORTRESS REIT LTD-B		57.784	−	−	−
RESILIENT REIT LTD		28.6	−	−	−
小計	口数・金額	108.558	403.149	3,739	21,500
	銘柄数<比率>	3銘柄<0.1%>	3銘柄<0.1%>	−	−
合計	口数・金額	2,104.433	1,593.093	−	184,052
	銘柄数<比率>	6銘柄<0.6%>	14銘柄<0.4%>	−	−

(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) 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 14,340	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

2020年４月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	26,646,081	64.5
新株予約権証券	70	0.0
投資信託受益証券、投資証券	184,052	0.4
コール・ローン等、その他	14,474,036	35.0
投資信託財産総額	41,304,240	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、40,906,088千円、99.0％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20日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝107.89円、１香港・ドル＝13.92円、１台湾・ドル＝3.59円、１イギリス・ポンド＝134.75円、１トルコ・リラ＝15.63円、１メキシコ・ペソ＝4.49円、１フィリピン・ペソ＝2.12円、100チリ・ペソ＝12.63円、100コロンビア・ペソ＝2.74円、１カタール・リアル＝29.53円、１サウジアラビア・リアル＝28.78円、１インド・ルピー＝1.42円、１パキスタン・ルピー＝0.65円、100インドネシア・ルピア＝0.70円、１アラブ首長国連邦・ディルハム＝29.42円、１ブラジル・レアル＝20.60円、１チェコ・コルナ＝4.30円、100韓国・ウォン＝8.87円、１オフショア・人民元＝15.24円、１マレーシア・リンギット＝24.67円、１南アフリカ・ランド＝5.75円、１タイ・バーツ＝3.32円、１ポーランド・ズロチ＝25.87円、100ハンガリー・フォリント＝33.19円、１ユーロ＝117.27円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年４月20日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**44,437,160,354円**
コール・ローン等	10,226,515,462
株式(評価額)	26,646,081,119
新株予約権証券(評価額)	70,389
投資信託受益証券(評価額)	146,587,725
投資証券(評価額)	37,464,933
未収入金	4,380,252,971
未収配当金	76,766,082
差入委託証拠金	2,923,421,673
(B) 負債	**3,270,332,874**
未払金	3,269,530,874
未払解約金	802,000
(C) 純資産総額(A－B)	**41,166,827,480**
元本	42,338,367,514
次期繰越損益金	△1,171,540,034
(D) 受益権総口数	**42,338,367,514口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**9,723円**

(注１) 期首元本額 50,190,897,430円
追加設定元本額 64,986,905,142円
一部解約元本額 72,839,435,058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＞	5,997,328,714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）	393,030,146円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,677,342円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,945,691円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	9,485,481円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	38,313,785円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	35,858,209円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	14,497,885円
たわらノーロード　新興国株式	5,964,627,825円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	2,590,247,477円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	954,882,697円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	9,026,402円
たわらノーロード　バランス（標準型）	28,903,810円
たわらノーロード　バランス（積極型）	45,281,993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）	505,018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）	73,928,655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）	147,066,610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）	116,857,099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）	176,423,651円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	503,710円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,231,992円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,222,251円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	3,159,650円
たわらノーロード　全世界株式	27,656,092円
ＯｎｅＤＣ 新興国株式インデックスファンド	26,232,767円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	441,719,912円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国10）	398,227,441円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国20）	400,152,689円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国30）	712,425,282円
投資のソムリエ	12,196,710,455円
クルーズコントロール	530,462,496円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,153,569,344円
ＤＩＡＭ８資産バランスファンドN＜ＤＣ年金＞	363,111,843円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	603,694円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	7,287,401円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	19,375,965円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	423,849,540円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,153,309,653円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,464,721,356円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	915,052,973円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	7,341,516円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	4,897,797円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,862,935円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	8,646,549円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,221,142,588円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	316,194,620円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	1,491,414円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	692,778円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	940,124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）	179,615,850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）	425,370,792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）	318,695,555円
期末元本合計	42,338,367,514円

■損益の状況

当期　自2019年４月19日　至2020年４月20日

項目	当期
(A) 配当等収益	**1,193,010,860円**
受取配当金	1,146,643,739
受取利息	32,304,661
その他収益金	14,298,303
支払利息	△235,843
(B) 有価証券売買損益	**△9,582,484,591**
売買益	3,981,906,152
売買損	△13,564,390,743
(C) 先物取引等取引損益	**△422,187,684**
取引益	2,511,118,711
取引損	△2,933,306,395
(D) その他費用	**△98,691,954**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**△8,910,353,369**
(F) 前期繰越損益金	**11,344,413,332**
(G) 解約差損益金	**△7,282,491,255**
(H) 追加信託差損益金	**3,676,891,258**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**△1,171,540,034**
次期繰越損益金(I)	**△1,171,540,034**

(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12期（決算日　2020年４月20日）

（計算期間　2019年４月19日～2020年４月20日）

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	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
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
12期（2020年４月20日）	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5	－	78,076

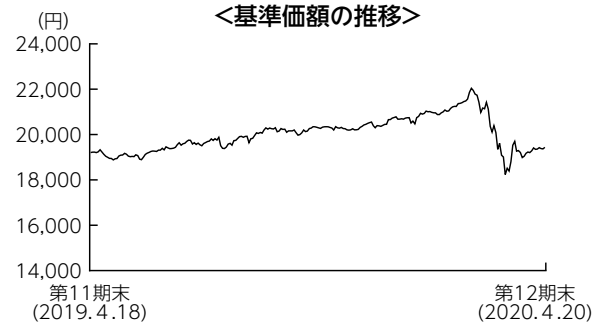
（注１）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
（注２）ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はＪ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します（以下同じ）。
（注３）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

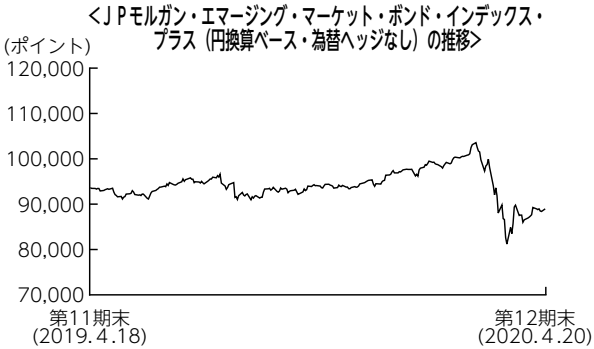
■当期中の基準価額と市況の推移

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	%	%	%
2019　年　4　月　18　日	19,206	－	93,647.60	－	97.5	－
4　月　末	19,229	0.1	92,912.02	△0.8	96.7	－
5　月　末	19,071	△0.7	92,204.77	△1.5	96.5	－
6　月　末	19,439	1.2	94,614.26	1.0	96.0	－
7　月　末	19,755	2.9	95,975.11	2.5	96.3	－
8　月　末	20,076	4.5	91,872.88	△1.9	96.2	－
9　月　末	20,162	5.0	93,068.15	△0.6	96.2	－
10　月　末	20,287	5.6	93,980.92	0.4	97.6	－
11　月　末	20,526	6.9	95,246.45	1.7	98.0	－
12　月　末	20,744	8.0	97,704.58	4.3	96.6	－
2020　年　1　月　末	21,083	9.8	99,206.38	5.9	98.3	－
2　月　末	21,430	11.6	99,779.17	6.5	87.9	－
3　月　末	19,292	0.4	87,584.44	△6.5	113.2	－
(期　末)						
2020　年　4　月　20　日	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5	－

（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**（2019年４月19日から2020年４月20日まで）





基準価額の推移

当期末の基準価額は19,435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

米国金利の低下や債券の利息収入を主因に、基準価額は上昇しました。

投資環境

新興国債券市場は下落しました。期初から2020年２月半ばにかけては概ね堅調に推移しました。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）プラスでの交渉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。期末にかけては感染拡大スピードの鈍化への期待から一部値を戻しました。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。

為替市場では、米ドルは対円で下落しました。期初から2020年２月にかけては、米国の堅調な経済状況、米中貿易問題などを背景に一進一退の展開となりました。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より、急速な円高が進みました。期末にかけては感染拡大スピードの鈍化への期待から一部値を戻したものの、期を通じては円高米ドル安となりました。

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%	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%	－

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%	4.9%	△4.9%
	ブラジル	10.0%	8.6%	1.4%
	メキシコ	15.3%	13.4%	1.9%
	パナマ	5.7%	3.9%	1.8%
	ペルー	4.6%	2.9%	1.7%
	コロンビア	9.2%	8.4%	0.8%
	計	44.7%	42.1%	2.7%
欧州	ハンガリー	4.1%	2.5%	1.6%
	ロシア	14.2%	11.6%	2.6%
	トルコ	0.0%	12.6%	△12.6%
	ウクライナ	0.0%	4.3%	△4.3%
	クロアチア	1.8%	1.1%	0.7%
	ルーマニア	3.5%	2.3%	1.2%
	計	23.6%	34.4%	△10.8%
アジア・オセアニア	インドネシア	13.8%	11.8%	2.1%
	フィリピン	8.8%	8.0%	0.8%
	計	22.6%	19.7%	2.9%
アフリカ	南アフリカ	5.6%	3.8%	1.8%
	計	5.6%	3.8%	1.8%
現金など		3.5%	－	－
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5.0％下落しました。

当ファンドはベンチマークを6.2％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	0.011%
(保管費用)	(2)	(0.011)
(その他)	(0)	(0.000)
合計	2	0.011

（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（20,018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６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４月19日から2020年４月20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	1,892,513	2,183,380 (3,072)

（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（2019年４月19日から2020年４月20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	630,091	698,504	75,361,611	96.5	15.6	74.3	19.2	3.1
合計	－	－	75,361,611	96.5	15.6	74.3	19.2	3.1

（注１）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注２）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	7,900	8,985	969,432	2040/01/11
BRAZIL 5.625 01/07/41	国債証券	5.6250	5,100	5,240	565,370	2041/01/07
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国債証券	4.6000	6,000	5,753	620,747	2046/01/23
BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	4.2500	10,100	10,567	1,140,087	2025/01/07
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	4,800	5,705	615,512	2026/01/29
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債証券	7.7500	4,100	6,026	650,156	2031/01/14
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	4,400	5,324	574,406	2044/01/22
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	国債証券	5.5500	6,400	6,995	754,719	2045/01/21
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	国債証券	4.6650	5,100	5,042	544,048	2024/01/17
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	国債証券	6.3750	2,600	3,531	381,025	2032/01/15
COLOMBIA 6.125 01/18/41	国債証券	6.1250	7,000	8,141	878,332	2041/01/18
INDONESIA 5.25 01/17/42	国債証券	5.2500	5,300	6,120	660,313	2042/01/17
INDONESIA 6.75 01/15/44	国債証券	6.7500	5,500	7,425	801,094	2044/01/15
BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	5.0000	6,800	6,534	705,039	2045/01/27
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	国債証券	4.3500	6,000	5,610	605,360	2047/01/15
INDONESIA 5.125 01/15/45	国債証券	5.1250	3,400	3,830	413,254	2045/01/15
INDONESIA 5.25 01/08/47	国債証券	5.2500	3,400	3,873	417,882	2047/01/08
INDONESIA 4.35 01/11/48	国債証券	4.3500	4,000	4,210	454,278	2048/01/11
BRAZIL 8.25 01/20/34	国債証券	8.2500	5,200	6,531	704,707	2034/01/20
PANAMA 6.7 01/26/36	国債証券	6.7000	6,900	8,354	901,369	2036/01/26
BRAZIL 7.125 01/20/37	国債証券	7.1250	6,300	7,424	801,034	2037/01/20
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	5,500	7,735	834,596	2038/01/17
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国債証券	3.9500	2,800	3,302	356,280	2040/01/20
INDONESIA 5.95 01/08/46	国債証券	5.9500	5,200	6,467	697,758	2046/01/08
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	3.6000	5,200	5,259	567,418	2025/01/30
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	国債証券	5.0000	2,800	3,554	383,456	2037/01/13
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	6,800	7,093	765,306	2025/01/15
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	5,000	5,312	573,147	2027/01/08
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	国債証券	3.7500	3,000	3,417	368,694	2029/01/14
ROMANIA 4.875 01/22/24	国債証券	4.8750	3,600	3,836	413,960	2024/01/22
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	6,000	6,236	672,829	2026/01/28
CROATIA 6.0 01/26/24	国債証券	6.0000	5,400	6,012	648,664	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	7,000	7,175	774,110	2026/01/21
INDONESIA 5.875 01/15/24	国債証券	5.8750	5,200	5,714	616,540	2024/01/15
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	6,800	7,390	797,360	2026/01/08
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国債証券	4.2000	4,800	5,193	560,336	2024/01/21
BRAZIL 2.625 01/05/23	国債証券	2.6250	4,800	4,852	523,568	2023/01/05
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	6,800	7,182	774,919	2028/01/13
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	国債証券	3.7500	5,200	5,120	552,472	2028/01/11
INDONESIA 3.5 01/11/28	国債証券	3.5000	4,200	4,255	459,164	2028/01/11
PANAMA 3.16 01/23/30	国債証券	3.1600	5,000	4,919	530,764	2030/01/23
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国債証券	4.5000	6,000	5,655	610,182	2050/01/31
BRAZIL 8.75 02/04/25	国債証券	8.7500	3,800	4,643	500,998	2025/02/04
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国債証券	3.7000	6,000	7,031	758,670	2042/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	国債証券	4.6000	6,400	6,208	669,781	2048/02/10
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国債証券	9.5000	5,800	9,236	996,513	2030/02/02
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国債証券	5.6250	4,000	4,450	480,110	2044/02/26
ROMANIA 6.75 02/07/22	国債証券	6.7500	7,500	7,988	861,828	2022/02/07
INDONESIA 5.35 02/11/49	国債証券	5.3500	3,000	3,563	384,424	2049/02/11
BRAZIL 5.625 02/21/47	国債証券	5.6250	6,600	6,864	740,556	2047/02/21
COLOMBIA 4.0 02/26/24	国債証券	4.0000	6,100	6,238	673,061	2024/02/26
INDONESIA 4.75 02/11/29	国債証券	4.7500	4,000	4,411	475,966	2029/02/11
HUNGARY 5.375 02/21/23	国債証券	5.3750	6,358	6,896	744,038	2023/02/21
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	国債証券	3.0000	5,000	5,373	579,735	2028/02/01
PANAMA 3.875 03/17/28	国債証券	3.8750	2,100	2,231	240,729	2028/03/17
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	7.5000	9,853	11,135	1,201,448	2030/03/31
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	4.7500	8,400	8,244	889,518	2044/03/08
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	国債証券	4.3750	8,400	9,282	1,001,480	2029/03/21
COLOMBIA 4.5 03/15/29	国債証券	4.5000	5,000	5,193	560,278	2029/03/15
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	国債証券	5.5000	5,600	6,569	708,741	2026/03/30
PERU 6.55 03/14/37	国債証券	6.5500	8,000	11,095	1,197,061	2037/03/14
HUNGARY 7.625 03/29/41	国債証券	7.6250	5,000	8,157	880,074	2041/03/29
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	国債証券	3.7000	5,000	5,836	629,722	2041/03/01
HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	5.3750	6,380	7,112	767,400	2024/03/25
PANAMA 3.75 03/16/25	国債証券	3.7500	4,200	4,383	472,960	2025/03/16
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	国債証券	3.6250	5,900	5,947	641,649	2022/03/15
COLOMBIA 2.625 03/15/23	国債証券	2.6250	3,700	3,639	392,706	2023/03/15
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国債証券	4.1500	8,400	8,526	919,870	2027/03/28
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	5.1000	10,000	11,845	1,278,026	2035/03/28
PANAMA 4.5 04/16/50	国債証券	4.5000	6,300	6,811	734,933	2050/04/16
PANAMA 9.375 04/01/29	国債証券	9.3750	3,900	5,415	584,258	2029/04/01
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	5.6250	9,000	11,373	1,227,113	2042/04/04
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国債証券	4.5000	8,000	8,184	882,980	2029/04/22
INDONESIA 4.625 04/15/43	国債証券	4.6250	4,400	4,714	508,603	2043/04/15
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	国債証券	4.5000	5,800	6,086	656,662	2022/04/04
COLOMBIA 3.875 04/25/27	国債証券	3.8750	4,600	4,609	497,286	2027/04/25
CROATIA 5.5 04/04/23	国債証券	5.5000	6,400	6,899	744,349	2023/04/04
INDONESIA 3.375 04/15/23	国債証券	3.3750	5,700	5,777	623,328	2023/04/15
INDONESIA 4.1 04/24/28	国債証券	4.1000	5,000	5,255	567,051	2028/04/24
BRAZIL 6.0 04/07/26	国債証券	6.0000	6,800	7,694	830,127	2026/04/07
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	5,400	5,094	549,659	2026/04/14
COLOMBIA 8.125 05/21/24	国債証券	8.1250	4,900	5,645	609,070	2024/05/21
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	国債証券	5.8750	3,000	3,091	333,594	2022/05/30
PANAMA 4.5 05/15/47	国債証券	4.5000	3,000	3,233	348,853	2047/05/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	国債証券	5.2000	3,000	3,171	342,151	2049/05/15
INDONESIA 4.875 05/05/21	国債証券	4.8750	1,100	1,121	121,046	2021/05/05
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	4.7500	10,400	11,491	1,239,867	2026/05/27
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	5,000	5,119	552,288	2029/05/30
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	6,400	5,999	647,243	2030/06/22
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	8,000	8,360	901,960	2045/06/15
ROMANIA 5.125 06/15/48	国債証券	5.1250	3,600	3,964	427,776	2048/06/15
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	国債証券	6.3000	3,000	2,551	275,310	2048/06/22
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	5.2500	16,000	19,895	2,146,517	2047/06/23
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	国債証券	4.2500	6,400	6,932	747,953	2027/06/23
PERU 2.844 06/20/30	国債証券	2.8440	3,000	3,081	332,447	2030/06/20
PERU 7.35 07/21/25	国債証券	7.3500	4,300	5,306	572,485	2025/07/21
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	国債証券	5.3750	2,800	2,233	240,918	2044/07/24
COLOMBIA 4.375 07/12/21	国債証券	4.3750	1,200	1,221	131,766	2021/07/12
INDONESIA 3.85 07/18/27	国債証券	3.8500	2,600	2,657	286,685	2027/07/18
PERU 4.125 08/25/27	国債証券	4.1250	4,300	4,815	519,501	2027/08/25
ROMANIA 4.375 08/22/23	国債証券	4.3750	4,000	4,173	450,261	2023/08/22
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	7,200	7,213	778,264	2025/09/16
COLOMBIA 7.375 09/18/37	国債証券	7.3750	7,400	9,435	1,017,942	2037/09/18
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債証券	6.7500	5,200	6,386	689,054	2034/09/27
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	国債証券	5.6500	3,200	2,560	276,198	2047/09/27
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	国債証券	5.8750	5,200	6,815	735,324	2043/09/16
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	国債証券	4.8750	7,400	8,099	873,877	2023/09/16
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	3,000	3,030	326,912	2029/09/18
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	5,800	5,800	625,762	2110/10/12
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	3,000	4,290	462,869	2034/10/23
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	5,200	4,499	485,439	2028/10/12
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	国債証券	5.0000	2,800	2,172	234,350	2046/10/12
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	4.0000	10,500	10,708	1,155,303	2023/10/02
PERU 5.625 11/18/50	国債証券	5.6250	6,000	8,685	937,024	2050/11/18
HUNGARY 5.75 11/22/23	国債証券	5.7500	7,000	7,805	842,171	2023/11/22
合計	－	－	630,091	698,504	75,361,611	－

■投資信託財産の構成

2020年４月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	75,361,611	92.3
コール・ローン等、その他	6,251,585	7.7
投資信託財産総額	81,613,197	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、77,837,248千円、95.4％です。
（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年４月20日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝107.89円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年４月20日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**81,763,127,639円**
コール・ローン等	5,541,931,170
公社債(評価額)	75,361,611,549
未収入金	149,930,510
未収利息	410,434,211
前払費用	299,220,199
(B) 負債	**3,686,629,884**
未払金	3,686,629,884
(C) 純資産総額(A－B)	**78,076,497,755**
元本	40,172,815,072
次期繰越損益金	37,903,682,683
(D) 受益権総口数	**40,172,815,072口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**19,435円**

(注１) 期首元本額 56,267,402,909円
追加設定元本額 112,332,882,393円
一部解約元本額 128,427,470,230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>	173,461,180円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	473,693,319円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	34,045,374円
たわらノーロード　バランス（標準型）	84,140,453円
たわらノーロード　バランス（積極型）	33,845,192円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	458,070円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,670,703円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,110,027円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	724,523円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	895,956円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	44,240,071円
ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）	196,333,833円
ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）	203,727,538円
ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）	376,267,256円
投資のソムリエ	6,002,310,971円
クルーズコントロール	262,178,890円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>	567,776,156円
ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ<ＤＣ年金>	171,006,640円
クルーズコントロール<ＤＣ年金>	298,079円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,431,478円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	3,833,238円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>リスク抑制型	208,860,582円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,045,144,801円
ワールドアセットバランス（基本コース）	843,793,149円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	490,833,333円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	7,648,741円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	5,104,195円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,898,446円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	14,907,075円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	759,646,337円
９資産分散投資・スタンダード<ＤＣ年金>	149,816,429円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	1,555,458円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	692,951円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	982,107円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	16,090,592,717円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,671,308,252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）	81,643,341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）	200,321,526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）	150,049,889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）	4,026,245,071円
Ｐ－Ｏｎｅマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,787,321,725円
期末元本合計	40,172,815,072円

■損益の状況

当期　自2019年４月19日　至2020年４月20日

項目	当期
(A) 配当等収益	**4,757,865,707円**
受取利息	4,759,051,096
支払利息	△1,185,389
(B) 有価証券売買損益	**1,962,675,660**
売買益	10,342,537,916
売買損	△8,379,862,256
(C) その他費用	**△11,820,297**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**6,708,721,070**
(E) 前期繰越損益金	**51,799,208,886**
(F) 解約差損益金	**△131,569,630,080**
(G) 追加信託差損益金	**110,965,382,807**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**37,903,682,683**
次期繰越損益金(H)	**37,903,682,683**

(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。